

NEUBERGER BERMAN



NEUBERGER BERMAN INVESTMENT FUNDS PLC
INFORME SEMESTRAL 2021

CUENTAS ABREVIADAS NO AUDITADAS
PERIODO FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

Índice

	PÁGINA
DIRECCIÓN Y ADMINISTRACIÓN	1
INFORMACIÓN GENERAL	4
CUENTAS CONSOLIDADAS	6
Neuberger Berman High Yield Bond Fund	9
Neuberger Berman Diversified Currency Fund	29
Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund	34
Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund	44
Neuberger Berman China Equity Fund	54
Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund	65
Neuberger Berman US Small Cap Fund	77
Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund	90
Neuberger Berman Global Bond Fund	105
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund	130
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund	155
Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund	177
Neuberger Berman Strategic Income Fund	196
Neuberger Berman Global Bond Absolute Return Fund	235
Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	238
Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund	259
Neuberger Berman US Long Short Equity Fund	289
Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund	305
Neuberger Berman European High Yield Bond Fund	343
Neuberger Berman Global Equity Fund	355
Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund	358

Índice (cont.)

	PÁGINA
Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund	374
Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund	384
Neuberger Berman Asian Debt – Hard Currency Fund	394
Neuberger Berman China Bond Fund	408
Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund	418
Neuberger Berman US Equity Fund	430
Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund	439
Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund	457
Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund	480
Neuberger Berman US Equity Index Putwrite Fund	511
Neuberger Berman Global Equity Index Putwrite Fund	519
Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund	527
Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund	671
Neuberger Berman Emerging Markets Sustainable Equity Fund	692
Neuberger Berman China Equity Opportunities Fund	702
Neuberger Berman Multi-Asset Growth Fund	705
Neuberger Berman Global Thematic Equity Fund	708
Neuberger Berman CLO Income Fund	716
Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund	725
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	734
Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund	750
Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund	761
Neuberger Berman Absolute Alpha Fund	775
Neuberger Berman Multi-Style Premia Fund	778
Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund	783

Índice (cont.)

	PÁGINA
Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund	795
Neuberger Berman 5G Connectivity Fund	808
Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund	820
Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund	830
Neuberger Berman Global Diversified Income FMP - 2024 Fund	848
Neuberger Berman China A-Share Equity Fund	858
Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund	866
Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund	874
NOTAS A LAS CUENTAS ABREVIADAS NO AUDITADAS	883
Principales políticas contables	883
Efectivo y equivalentes de efectivo	885
Descubierto bancario	885
Capital social	885
Comisiones del Gestor de inversiones, el Agente administrativo, la Entidad comercializadora y el Depositario	886
Honorarios y gastos de los Administradores	904
Otras comisiones y gastos	904
Transacciones con partes relacionadas	904
Comparativa del Patrimonio neto y del Valor liquidativo	920
Instrumentos financieros: comunicación de datos	995
Tipos de cambio	1048
Ajuste de conversión de divisas	1049
Acuerdos de comisiones en especie	1050
Separación de pasivos	1050
Gestión eficiente de la cartera	1050
Línea de crédito	1052
Compromiso no financiado	1052
Cifras comparativas	1052
Acontecimientos significativos durante el periodo	1052
Acontecimientos significativos ocurridos desde el cierre del periodo	1053
Aprobación de las cuentas	1053
ANEXO I – RATIOS DE GASTOS TOTALES	1054
ANEXO II - REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES	1076
ANEXO III – GLOSARIO DE ÍNDICES	1102

Dirección y administración

Consejo de administración:

Tom Finlay (nacionalidad irlandesa)**
 Gráinne Alexander (nacionalidad irlandesa)***
 Michelle Green (nacionalidad británica)*
 Naomi Daly (nacionalidad irlandesa)***
 Alex Duncan (nacionalidad británica)*

*Consejero no ejecutivo

**Consejero independiente no ejecutivo y Presidente permanente

***Consejero independiente no ejecutivo

Asesores jurídicos en lo relativo al Derecho irlandés:

Matheson
 70 Sir John Rogerson's Quay
 Dublín 2
 Irlanda

Depositario:

Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited
 30 Herbert Street
 Dublín 2
 Irlanda

Intermediario patrocinador para Euronext Dublin:

Matheson
 70 Sir John Rogerson's Quay
 Dublín 2
 Irlanda

Sociedad gestora:

Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited
 (nombrado el 1 de julio de 2021)
 32 Molesworth Street
 Dublín 2
 Irlanda

Entidades distribuidoras y Gestores delegados de inversiones:

Neuberger Berman Asia Limited
 20th Floor
 Jardine House
 1 Connaught Place
 Central Hong Kong

Neuberger Berman Singapore Pte. Limited
 Nivel 15
 Ocean Financial Centre
 10 Collyer Quay
 Singapur 049315

Entidades distribuidoras y Gestores delegados de inversiones (continuación):

Neuberger Berman Europe Limited
 (nombrado el 1 de julio de 2021)
 The Zig Zag Building
 70 Victoria Street
 London SW1E 6SQ
 Inglaterra

Entidad comercializadora:

Neuberger Berman BD LLC
 (nombrado el 1 de julio de 2021)
 1290 Avenue of the Americas
 New York, NY 10104-0002
 EE. UU.

Subasesor afiliado:

Neuberger Berman Investment Management
 (Shanghai) Limited
 Room B01 of Units 4205, 4206 and 4207
 No.479 Lujiazui Ring Road
 China (Shanghai) Pilot Free Trade Zone, 200120
 República de China

Agente administrativo:

Brown Brothers Harriman Fund
 Administration Services (Ireland) Limited
 30 Herbert Street
 Dublín 2
 Irlanda

Auditores:

Ernst & Young
 Chartered Accountants
 Block One, Harcourt Centre
 Harcourt Street
 Dublín 2
 Irlanda

Representante suizo:****

BNP Paribas Securities Services S.A. Paris
 Succursale de Zürich
 Selnaustrasse 16
 P.O. Box 2119 CH-8002
 Zúrich
 Suiza

****El Folleto, los Estatutos, los documentos de datos fundamentales para el inversor y los informes anuales y semestrales, así como una lista de todas las compras y ventas realizadas durante el periodo del informe, pueden obtenerse de forma gratuita en la oficina del Representante suizo.

Dirección y administración (cont.)

Secretario de la Sociedad y domicilio social:

Matsack Trust Limited
70 Sir John Rogerson's Quay
Dublín 2
Irlanda

Gestores delegados de inversiones:

Neuberger Berman Investment Advisers LLC
1290 Avenue of the Americas
New York, NY 10104-0002
EE. UU.

Neuberger Berman Breton Hill ULC
2 Bloor Street East Suite 2830
Toronto, ON M4W 1A8
Canadá

Neuberger Berman Alternatives Advisers LLC
325 N Saint Paul Street, Suite 4900
Dallas, TX 75201
EE. UU.

Neuberger Berman East Asia Limited
(nombrado el 1 de julio de 2021)
351 Manunouchi 1-Chrome
Chiyoda-ku
Tokyo
Japón

Agente principal (Master Agent) y Entidad comercializadora en Taiwán:

Neuberger Berman Taiwan (SITE) Limited
20F., No. 68, Sec 5, Zhongxiao E. Road
XinYi District
Taipei City 110
Taiwán
República de China

Subasesores no afiliados:

Cramer Rosenthal McGlynn, LLC
520 Madison Avenue, 20th Floor
Nueva York, NY 10022
EE. UU.

Good Hill Partners LP
(cesado el 19 de junio de 2021)
1 Greenwich Office Park
Greenwich, CT 06831
EE. UU.

Subasesores no afiliados (cont.):

Portland Hill Asset Management Limited
21 Knightsbridge
Londres SW1X 7LY
Reino Unido

GAMCO Asset Management Inc.
One Corporate Center
Rye, NY 10580
EE. UU.

Green Court Capital Management Limited
20th Floor
Jardine House
1 Connaught Place
Central Hong Kong

Altiq LLP
29 Farm Street
Londres W1J 5RL
Reino Unido

BH-DG Systematic Trading LLP
10 Grosvenor Street, 3rd Floor
Londres W1K 4QB
Reino Unido

True Partner Capital USA Holding Inc
111 West Jackson Boulevard, Suite 1700
Chicago, IL 60604
EE. UU.

Alcova Asset Management LLP
21 Knightsbridge
Londres SW1X 7LY
Reino Unido

Sandbar Asset Management LLP
Warnford Court
29 Throgmorton Street
Londres EC2N 2AT
Reino Unido

P/E Global LLC
75 State Street, 31st Floor
Boston, MA 02109
EE. UU.

Dirección y administración (cont.)

Subasesores no afiliados (cont.):

Crabel Capital Management, LLC
10250 Constellation Blvd., Suite 2650
Los Ángeles, CA 90067
EE. UU.

Trium Capital LLP
60 Gresham Street
London EC2V 7BB
Reino Unido

AllianceBernstein LP
1345 Avenue of the Americas
Nueva York, NY 10105
EE. UU.

Subasesores no afiliados (cont.):

LCJ Investments SA
(cesado el 31 de marzo de 2021)
118 Rue du Rhone
1204 Ginebra
Suiza

Portman Square Capital
Park House
116 Park Street
London W1K 6SS
Reino Unido

Información general

La información que se expone a continuación se deriva del texto completo y el apartado de definiciones del Folleto, y debe leerse conjuntamente con estos.

Neuberger Berman Investment Funds plc (la "Sociedad") es una sociedad de inversión de capital variable constituida en Irlanda el 11 de diciembre de 2000 con el número de registro 336425, como sociedad anónima (public limited company) en virtud de lo dispuesto en la Ley de Sociedades (Companies Act) de 2014 (en su versión modificada). La Sociedad está autorizada por el Banco Central de Irlanda (el «Banco Central») como Organismo de Inversión Colectiva en Valores Mobiliarios, de conformidad con el reglamento irlandés denominado European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) de 2011 (en su versión modificada) (el «Reglamento sobre OICVM»). La Sociedad está constituida como fondo paraguas en tanto en cuanto su capital social se divide en distintas series de acciones, cada una de las cuales representa una cartera de activos que se invierte de forma independiente ("Cartera"). Las Acciones de cualquier Cartera se pueden dividir en diferentes clases para permitir la existencia de distintas condiciones de suscripción, reembolso, dividendos, gastos, comisiones o divisas, incluidos ratios de gastos totales diferentes.

A 30 de junio de 2021, la Sociedad se componía de cuarenta y siete carteras de inversión independientes (las "Carteras"), cada una de ellas representada por una serie independiente de Acciones de participación reembolsables. Se indican en la tabla siguiente:

Cartera	Fecha de creación*
Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund ¹	1 de febrero de 2006
Neuberger Berman High Yield Bond Fund ¹	3 de mayo de 2006
Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund ¹	13 de junio de 2006
Neuberger Berman China Equity Fund ¹	14 de julio de 2009
Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund ¹	4 de octubre de 2010
Neuberger Berman US Small Cap Fund ¹	1 de julio de 2011
Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund ¹	20 de diciembre de 2011
Neuberger Berman Global Bond Fund ¹	16 de julio de 2012
Neuberger Berman Strategic Income Fund ¹	26 de abril de 2013
Neuberger Berman Emerging Market Debt – Hard Currency Fund ¹	31 de mayo de 2013
Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund ¹	14 de junio de 2013
Neuberger Berman Emerging Market Debt – Local Currency Fund ¹	28 de junio de 2013
Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund ²	15 de octubre de 2013
Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund ¹	31 de octubre de 2013
Neuberger Berman US Long Short Equity Fund ²	28 de febrero de 2014
Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund ¹	23 de abril de 2014
Neuberger Berman European High Yield Bond Fund ¹	27 de junio de 2014
Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund ²	18 de diciembre de 2014
Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund ¹	30 de diciembre de 2014
Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund ²	30 de abril de 2015
Neuberger Berman Asian Debt – Hard Currency Fund ²	29 de junio de 2015
Neuberger Berman China Bond Fund ¹	28 de agosto de 2015
Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund ²	19 de noviembre de 2015
Neuberger Berman US Equity Fund ²	18 de diciembre de 2015
Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund ²	4 de agosto de 2016
Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund ²	20 de diciembre de 2016
Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund ²	28 de diciembre de 2016
Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund ²	30 de diciembre de 2016
Neuberger Berman Global Equity Index PutWrite Fund ²	3 de mayo de 2017
Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund ²	22 de mayo de 2017
Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund ²	10 de julio de 2017
Neuberger Berman Emerging Markets Sustainable Equity Fund ²	24 de octubre de 2017
Neuberger Berman Global Thematic Equity Fund ²	27 de abril de 2018

Información general (cont.)

Cartera	Fecha de creación*
Neuberger Berman CLO Income Fund ²	12 de julio de 2018
Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund ¹	21 de agosto de 2018
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund ²	31 de octubre de 2018
Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund ²	14 de noviembre de 2018
Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund ²	29 de noviembre de 2018
Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund ²	4 de diciembre de 2019
Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund ²	21 de enero de 2020
Neuberger Berman 5G Connectivity Fund ¹	8 de abril de 2020
Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund ²	12 de mayo de 2020
Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund ²	1 de junio de 2020
Neuberger Berman Global Diversified Income FMP – 2024 ²	22 de junio de 2020
Neuberger Berman China A-Share Equity Fund ²	28 de julio de 2020
Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund ²	24 de febrero de 2021
Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund ²	24 de febrero de 2021

*Primer día de operaciones.

¹ Cartera autorizada por la Hong Kong Securities and Futures Commission ("SFC"), por lo que puede ofrecerse públicamente en Hong Kong.

² Cartera autorizada por la SFC y no disponible para inversores de Hong Kong.

La Sociedad ha establecido la separación de pasivos entre sus subfondos y, por consiguiente, todo pasivo en que se incurra en nombre de cualquier subfondo o atribuible a este se liquidará exclusivamente con el activo de dicho subfondo.

El Neuberger Berman Diversified Currency Fund y el Neuberger Berman Multi-Style Premia Fund se liquidaron el 22 de enero de 2021 y el 24 de febrero de 2021 respectivamente, por lo que ya no están disponibles para su suscripción. Neuberger Berman US Large Cap Growth Fund, Neuberger Berman Global Equity Income Fund, Neuberger Berman Global Long Short Equity Fund, Neuberger Berman Long Short Multi Manager Fund, Neuberger Berman Global Credit Long Short Fund, Neuberger Berman Global Dynamic Asset Allocator Fund, Neuberger Berman Asian Opportunities Fund, Neuberger Berman World Equity Fund, Neuberger Berman Multi-Asset Risk Premia Fund, Neuberger Berman China A-Share Opportunities Fund, Neuberger Berman Multi-Asset Growth Fund, Neuberger Berman Global Equity Fund, Neuberger Berman Absolute Alpha Fund, Neuberger Berman Global Bond Absolute Return Fund y Neuberger Berman China Equity Opportunities Fund se liquidaron durante los ejercicios contables anteriores y está pendiente la solicitud al Banco Central para anular las inscripciones de las Carteras.

Balances consolidados*

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		32.486.815.119	30.056.053.421
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	2.431.590.543	1.996.220.852
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		921.294.314	91.079.656
Cuentas a percibir por acciones emitidas		212.268.738	89.362.669
Cuentas por cobrar de intermediarios		439.503.543	358.350.220
Ingresos a percibir y otros activos		346.067.310	329.766.486
Activos totales		36.837.539.567	32.920.833.304
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		478.371.272	333.416.173
Descubierto bancario	3	754.962	191.445
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		259.373.391	50.050.552
Adeudado a los intermediarios		45.909.306	103.737.313
Gastos devengados		30.394.284	26.466.884
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		1.277.891.228	461.679.862
Otras cuentas por pagar		34.141.363	43.558.630
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		2.126.835.806	1.019.100.859
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		34.710.703.761	31.901.732.445

En las presentes cuentas se incluyen las cuentas de cada Cartera.

* 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 de las cuentas abreviadas no auditadas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Cuenta de pérdidas y ganancias consolidada*

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		559.739.415	515.597.958
Ingresos por dividendos		37.547.709	31.578.590
Ingresos por préstamo de valores	15	296.915	49.429
Ingresos varios		880.964	782.753
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(44.275.000)	(1.909.811.229)
		554.190.003	(1.361.802.499)
Gastos			
Comisión de gestión	5	130.109.622	96.233.608
Comisión de distribución	5	8.373.125	7.919.457
Comisión de administración	5	15.238.947	16.314.940
Comisión de compromiso	16	2.172.221	1.447.938
Comisión de depósito	5	2.410.194	2.663.114
Comisión del Depositario	5	880.200	1.267.178
Honorarios profesionales	7	3.068.085	1.862.110
Honorarios de los Consejeros	6	104.783	108.386
Comisión de rentabilidad	5	8.267.616	23.292.438
Costes de transacciones	7	13.205.773	9.955.580
Gastos de constitución	7	95.316	224.830
Honorarios de auditoría	7	511.762	485.971
Reembolso de IVA		(150.733)	(87.060)
Otros gastos	7	2.525.328	1.294.259
Gastos no asumidos	5	(2.260.543)	(3.589.507)
Renuncia a la comisión de asesoría	5	(130.286)	(121.249)
Gastos totales		184.421.410	159.271.993
Costes financieros			
Gastos por intereses		69.528	59.712
Repartos de dividendos abonados	1	173.502.154	173.674.203
		173.571.682	173.733.915
Impuestos retenidos en origen		14.594.462	12.854.011
Impuesto sobre las plusvalías		(1.600.988)	(1.454.270)
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		183.203.437	(1.706.208.148)

Únicamente se generaron ingresos y gastos de las operaciones continuas, salvo en el caso de Neuberger Berman Diversified Currency Fund y Neuberger Berman Multi-Style Premia Fund que se liquidaron el 22 de enero de 2021 y el 24 de febrero de 2021, respectivamente.

No existen ganancias y pérdidas reconocidas en el periodo financiero distintas de las que constan en la Cuenta de pérdidas y ganancias consolidada.

En las presentes cuentas se incluyen las cuentas de cada Cartera.

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

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo		31.901.732.445	27.516.822.086
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		183.203.437	(1.706.208.148)
Variación de los tipos de cambio	12	(100.304.264)	(1.091.185)
Suscripciones		11.121.181.004	8.581.354.963
Reembolsos		(8.395.108.861)	(8.630.653.781)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo		34.710.703.761	25.760.223.935

En las presentes cuentas se incluyen las cuentas de cada Cartera.

* 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.

Neuberger Berman High Yield Bond Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 3,61%. En el mismo período, el índice CE BofA US High Yield Constrained (rentabilidad total en USD) (el "Índice") registró un 3,70%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

El mercado de alta rentabilidad se anotó excelentes resultados en el primer semestre de 2021 gracias al avance de la campaña de vacunación contra la COVID-19, a la reapertura de las economías, al sólido crecimiento del PIB y a la mejora de los fundamentales del crédito. A pesar de esta evolución positiva del entorno económico, la Reserva Federal estadounidense reiteró su intención de mantener una política monetaria acomodaticia y también su confianza en el carácter transitorio del aumento de la inflación. Los diferenciales de crédito, que se habían ampliado al comienzo de la pandemia el pasado año, experimentaron una contracción significativa durante el periodo analizado. El mercado de alta rentabilidad también se caracterizó por la divergencia de rentabilidades entre las diferentes calidades crediticias y entre emisores que atravesaron o no dificultades (distressed/non-distressed) durante el periodo, con un avance del índice ICE BofA Distressed High Yield del 29,9%, frente al 3,1% del índice ICE BofA US Non-Distressed High Yield en el año en curso. A pesar de que la parte del mercado que atravesó dificultades experimentó un fuerte repunte partiendo de unos niveles muy bajos, muchos de los emisores perjudicados a más largo plazo y que afrontan desafíos seculares todavía no satisfacen nuestros estrictos estándares de suscripción de crédito. A 30 de junio de 2021, el índice de valores en dificultades medido como porcentaje del Total US High Yield Index, se situó en apenas el 1,7%, descendiendo respecto al 4,1% registrado al cierre del año pasado, lo que supone el nivel más bajo visto desde octubre de 2006. Por otra parte, desde la perspectiva de la selección de títulos de crédito individuales, encontramos oportunidades de inversión atractivas en el espectro del crédito y en el universo de alta rentabilidad.

La cifra de emisiones nuevas ha sido muy elevada en el primer semestre, dado que los emisores trataron de refinanciar a rentabilidades más bajas. En lo que va de año, la emisión bruta de bonos de alta rentabilidad de EE. UU. alcanzó los 299.100 millones de dólares —100.300 millones de dólares excluyendo refinanciaciones—, superando los 218.400 millones de dólares —94.200 millones de dólares excluyendo refinanciaciones— del mismo periodo del pasado año. Las salidas de capital de fondos de alta rentabilidad del año en curso alcanzan los -13.800 millones de dólares, lo que contrasta con las entradas de capital por valor de 28.600 millones de dólares del primer semestre de 2020.

En junio, la tasa de morosidad ponderada por el valor nominal de las emisiones del mercado de alta rentabilidad de los últimos 12 meses en Estados Unidos descendió hasta el 1,87%, en 430 puntos básicos, desde el 6,17% registrado en diciembre de 2020. Por ponerlo en contexto, cabe señalar que la tasa de morosidad media a largo plazo se sitúa en el 3,5% (basada en las tasas de morosidad anuales desde 1980, según JP Morgan). Habida cuenta de la creciente proporción de mejora de las calificaciones y del descenso de las rebajas de calificación, prevemos que las tasas de impago de las emisiones del mercado de alta rentabilidad seguirán moderándose respecto de los niveles actuales.

La rentabilidad de la Cartera fue inferior a la de su índice de referencia durante el periodo analizado. Durante este periodo, lo que más benefició a la rentabilidad fueron la selección de valores y la infraponderación en el sector de atención sanitaria, así como una sobreponderación en distribución de gas, y la selección de valores y la infraponderación en servicios financieros diversificados. Por contra, los mayores lastres para la rentabilidad fueron una infraponderación y la selección de valores en el sector de la energía, así como la selección de valores en salas de exhibición y ocio, y suministros públicos. En lo que respecta a nuestro posicionamiento por calificaciones crediticias, lo que más benefició a la rentabilidad fue la sobreponderación de emisores con calificación CCC e inferior, la selección de valores en emisores con calificación B y la selección de valores y una infraponderación de emisores con calificación BB, mientras que los principales lastres fueron la selección de valores en el segmento CCC e inferior y la sobreponderación de emisores con calificación B.

Los diferenciales del mercado de alta rentabilidad se han estrechado en el año en curso, pero creemos que las valoraciones compensan a los inversores por unas perspectivas de impago cada vez más benignas. La recuperación económica sigue su curso y creemos que la evolución positiva del crecimiento y de la capacidad de fijación de precios favorecerá a los fundamentales de los emisores. El constante progreso de las campañas de vacunación, unido a la demanda acumulada de los consumidores en los segmentos de los viajes, el ocio y los servicios, la reposición de inventarios y contrataciones por parte de las empresas, así como un FOMC paciente aunque vigilante deberían seguir favoreciendo a la actividad económica de cara al futuro. A pesar de que las nuevas variantes de la COVID-19 y la preocupación por la inflación dan lugar a episodios de volatilidad a corto plazo, creemos que nuestro análisis fundamental del crédito, con un enfoque bottom-up y centrado en la selección de títulos individuales, al tiempo que trata de evitar el deterioro del crédito y de incluir solo nuestras "mejores ideas" en las carteras, nos permite estar bien posicionados para aprovechar cualquier volatilidad.

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		3.120.353.316	3.526.533.941
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	219.392.341	174.165.250
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		21.233.158	5.101.445
Cuentas a percibir por acciones emitidas		22.692.090	8.978.489
Ingresos a percibir y otros activos		46.971.174	52.264.620
Activos totales		3.430.642.079	3.767.043.745
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		12.699.599	21.902.140
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		7.945.200	7.859.395
Adeudado a los intermediarios		600.000	700.000
Gastos devengados		3.594.289	3.645.176
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		47.646.998	23.718.096
Otras cuentas por pagar		333.307	863.441
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		72.819.393	58.688.248
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		3.357.822.686	3.708.355.497

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		90.753.839	86.189.262
Ingresos por dividendos		960.383	741.106
Ingresos por préstamo de valores	15	106.342	16.496
Ingresos varios		74.916	1.050
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		36.896.710	(334.017.502)
		128.792.190	(247.069.588)
Gastos			
Comisión de gestión	5	14.981.706	14.438.944
Comisión de distribución	5	1.506.151	1.877.302
Comisión de administración	5	1.809.221	2.273.960
Comisión de compromiso	16	260.437	196.098
Comisión de depósito	5	32.975	50.629
Comisión del Depositario	5	82.869	151.171
Honorarios profesionales	7	200.416	120.818
Honorarios de los Consejeros	6	2.410	2.380
Costes de transacciones	7	240.069	286.510
Honorarios de auditoría	7	22.624	20.544
Reembolso de IVA		(16.108)	(10.135)
Otros gastos	7	5.415	52.497
Gastos no asumidos	5	–	(44.200)
Renuncia a la comisión de asesoría	5	(120.623)	(112.288)
Gastos totales		19.007.562	19.304.230
Costes financieros			
Repartos de dividendos abonados	1	56.959.559	56.902.556
		56.959.559	56.902.556
Impuestos retenidos en origen		148.822	38.431
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		52.676.247	(323.314.805)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	3.708.355.497	3.501.509.138
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	52.676.247	(323.314.805)
Suscripciones	730.345.198	1.138.813.334
Reembolsos	(1.133.554.256)	(1.176.627.559)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	3.357.822.686	3.140.380.108

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

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
Valores respaldados por activos 0,51% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)					
Dólar estadounidense					
2.250.000	Ares XXVII CLO Ltd Series 2013-2X Class E	6,68%	28/07/2029	2.230.310	0,07
2.650.000	Bardot CLO Ltd Series 2019-2X Class E	7,13%	22/10/2032	2.666.769	0,08
1.000.000	Dryden 49 Senior Loan Fund Series 2017-49X Class E	6,49%	18/07/2030	1.003.610	0,03
3.150.000	Flatiron CLO 17 Ltd Series 2017-1X Class E	6,06%	15/05/2030	3.149.817	0,09
1.250.000	Grippen Park CLO Ltd Series 2017-1X Class E	5,89%	20/01/2030	1.216.815	0,03
900.000	OCP CLO Ltd 2017-13X Class D	6,81%	15/07/2030	903.838	0,03
3.000.000	Trinitas CLO Xii Ltd Series 2020-12X Class E	7,58%	25/04/2033	3.027.467	0,09
3.150.000	Tryon Park CLO Ltd Series 2013-1X Class D	6,13%	15/04/2029	3.115.402	0,09
Total valores respaldados por activos **				17.314.028	0,51
Bonos de empresa 87,11% (31 de diciembre de 2020: 87,67%)					
Dólar estadounidense					
3.295.000	Acadia Healthcare Co Inc**	5,00%	15/04/2029	3.445.614	0,10
8.555.000	Acadia Healthcare Co Inc**	5,50%	01/07/2028	9.149.957	0,27
6.514.000	AerCap Global Aviation Trust*	6,50%	15/06/2045	6.969.557	0,21
14.390.000	Ahead DB Holdings LLC**	6,63%	01/05/2028	14.932.647	0,44
16.873.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	6,75%	15/10/2027	17.754.277	0,53
30.345.000	Altice France Holding SA**	6,00%	15/02/2028	30.259.427	0,90
4.975.000	Altice France SA**	5,13%	15/01/2029	5.009.875	0,15
14.460.000	Altice France SA*	5,50%	15/01/2028	15.023.217	0,45
6.304.000	Altice France SA*	7,38%	01/05/2026	6.563.599	0,20
4.985.000	Altice France SA**	8,13%	01/02/2027	5.437.389	0,16
7.605.000	AMC Networks Inc**	4,25%	15/02/2029	7.681.050	0,23
6.425.000	American Airlines Group Inc**	3,75%	01/03/2025	5.928.123	0,18
11.405.000	American Airlines Group Inc**	5,00%	01/06/2022	11.433.741	0,34
14.985.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,50%	20/04/2026	15.884.100	0,47
12.215.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,75%	20/04/2029	13.222.737	0,39
4.650.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	5,38%	15/06/2029	4.853.461	0,14
5.655.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	5,75%	01/03/2027	5.898.419	0,18
2.140.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	5,75%	15/01/2028	2.254.875	0,07
11.960.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	7,88%	15/05/2026	13.405.964	0,40
6.220.000	Antero Resources Corp**	5,38%	01/03/2030	6.356.094	0,19
12.270.000	Apex Tool Group LLC/BC Mountain Finance Inc**	9,00%	15/02/2023	12.380.859	0,37
12.925.000	APX Group Inc**	6,75%	15/02/2027	13.798.924	0,41
22.795.000	Aramark Services Inc**	5,00%	01/02/2028	23.899.418	0,71
13.030.000	Aramark Services Inc**	6,38%	01/05/2025	13.860.662	0,41
15.545.000	Archrock Partners LP/Archrock Partners Finance Corp**	6,25%	01/04/2028	16.258.671	0,48
5.490.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	5,88%	30/06/2029	5.496.862	0,16

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

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 87,11% (31 de diciembre de 2020: 87,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
11.080.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	7,00%	01/11/2026	11.629.845	0,35
2.875.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	8,25%	31/12/2028	3.168.250	0,09
3.153.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	9,00%	01/11/2027	4.369.632	0,13
5.548.000	ASGN Inc**	4,63%	15/05/2028	5.826.315	0,17
8.075.000	AssuredPartners Inc**	5,63%	15/01/2029	8.091.150	0,24
10.730.000	AssuredPartners Inc**	7,00%	15/08/2025	10.996.480	0,33
6.035.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc**	5,38%	01/03/2029	6.292.544	0,19
2.275.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc**	5,75%	15/07/2027	2.375.953	0,07
3.005.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc 144A**	5,75%	15/07/2027	3.154.784	0,09
16.335.000	Bausch Health Cos Inc**	6,13%	15/04/2025	16.763.794	0,50
16.525.000	BCPE Empire Holdings Inc**	7,63%	01/05/2027	16.944.818	0,50
3.925.000	Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp**	7,63%	15/12/2025	4.258.625	0,13
5.760.000	BroadStreet Partners Inc**	5,88%	15/04/2029	5.893.690	0,18
3.580.000	Buckeye Partners LP**	4,13%	01/12/2027	3.644.905	0,11
5.680.000	Buckeye Partners LP**	4,50%	01/03/2028	5.835.121	0,17
5.414.000	Buckeye Partners LP**	5,85%	15/11/2043	5.396.513	0,16
11.435.000	Cablevision Lightpath LLC**	5,63%	15/09/2028	11.669.417	0,35
4.715.000	Caesars Entertainment Inc**	6,25%	01/07/2025	5.003.794	0,15
7.935.000	Caesars Entertainment Inc**	8,13%	01/07/2027	8.835.226	0,26
9.450.000	Caesars Resort Collection LLC/CRC Finco Inc**	5,25%	15/10/2025	9.579.937	0,29
6.335.000	Callon Petroleum Co**	8,00%	01/08/2028	6.414.187	0,19
21.440.000	Calpine Corp**	4,50%	15/02/2028	21.895.600	0,65
15.569.000	Calpine Corp**	4,63%	01/02/2029	15.350.178	0,46
9.357.000	Calpine Corp**	5,00%	01/02/2031	9.328.929	0,28
11.190.000	Calpine Corp**	5,13%	15/03/2028	11.401.659	0,34
15.590.000	Carnival Corp**	5,75%	01/03/2027	16.350.012	0,49
10.390.000	Carnival Corp**	7,63%	01/03/2026	11.299.125	0,34
6.925.000	Carnival Corp**	9,88%	01/08/2027	8.093.698	0,24
14.070.000	Carnival Corp**	10,50%	01/02/2026	16.399.218	0,49
6.280.000	Cars.com Inc**	6,38%	01/11/2028	6.706.475	0,20
12.685.000	Carvana Co**	5,50%	15/04/2027	13.134.683	0,39
10.605.000	Carvana Co**	5,63%	01/10/2025	11.053.114	0,33
15.350.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	5,00%	01/02/2028	16.117.500	0,48
4.473.000	Cedar Fair LP**	5,25%	15/07/2029	4.616.986	0,14
2.105.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op*	5,38%	15/04/2027	2.171.276	0,06
6.350.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op**	5,50%	01/05/2025	6.635.750	0,20
5.075.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op**	6,50%	01/10/2028	5.475.138	0,16
22.870.000	Cheniere Energy Inc**	4,25%	15/03/2045	19.489.994	0,58

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

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 87,11% (31 de diciembre de 2020: 87,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
6.375.000	CHS/Community Health Systems Inc**	4,75%	15/02/2031	6.406.875	0,19
3.565.000	CHS/Community Health Systems Inc**	5,63%	15/03/2027	3.810.325	0,11
3.885.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,00%	15/01/2029	4.162.098	0,12
21.420.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,13%	01/04/2030	21.768.075	0,65
1.870.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,63%	15/02/2025	1.979.844	0,06
8.345.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,88%	15/04/2029	8.757.118	0,26
9.905.000	CHS/Community Health Systems Inc**	8,00%	15/12/2027	11.032.734	0,33
12.215.000	Churchill Downs Inc**	5,50%	01/04/2027	12.756.998	0,38
2.170.000	Cinemark USA Inc**	5,25%	15/07/2028	2.226.962	0,07
15.085.000	Cinemark USA Inc**	5,88%	15/03/2026	15.833.593	0,47
2.990.000	Cinemark USA Inc**	8,75%	01/05/2025	3.280.030	0,10
6.845.000	Clarios Global LP/Clarios US Finance Co**	6,25%	15/05/2026	7.300.603	0,22
8.420.000	Clarios Global LP/Clarios US Finance Co**	8,50%	15/05/2027	9.190.009	0,27
9.425.000	Clarivate Science Holdings Corp**	4,88%	30/06/2029	9.684.187	0,29
5.615.000	Colgate Energy Partners III LLC**	5,88%	01/07/2029	5.832.581	0,17
7.710.000	CommScope Inc**	7,13%	01/07/2028	8.366.198	0,25
3.800.000	CommScope Inc**	8,25%	01/03/2027	4.066.190	0,12
24.697.000	CommScope Technologies LLC**	5,00%	15/03/2027	25.314.425	0,75
18.818.000	CommScope Technologies LLC**	6,00%	15/06/2025	19.241.405	0,57
6.055.000	Comstock Resources Inc**	5,88%	15/01/2030	6.183.669	0,18
8.159.000	Comstock Resources Inc**	6,75%	01/03/2029	8.701.410	0,26
4.375.000	Constellium SE**	3,75%	15/04/2029	4.336.806	0,13
5.800.000	Constellium SE**	5,63%	15/06/2028	6.242.279	0,19
5.740.000	Cornerstone Building Brands Inc**	6,13%	15/01/2029	6.167.860	0,18
38.720.000	CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**	5,50%	15/06/2031	40.394.253	1,20
3.795.000	Crocs Inc**	4,25%	15/03/2029	3.880.938	0,12
8.085.000	CSC Holdings LLC**	4,63%	01/12/2030	7.942.381	0,24
4.305.000	CSC Holdings LLC**	5,00%	15/11/2031	4.331.476	0,13
28.565.000	CSC Holdings LLC**	5,75%	15/01/2030	29.707.600	0,88
14.625.000	CSC Holdings LLC**	7,50%	01/04/2028	16.094.301	0,48
7.560.000	DaVita Inc**	4,63%	01/06/2030	7.782.793	0,23
2.289.000	DCP Midstream Operating LP*	5,60%	01/04/2044	2.528.841	0,08
7.685.000	DCP Midstream Operating LP**	5,85%	21/05/2043	7.145.321	0,21
8.480.000	Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC**	8,00%	01/02/2028	9.169.975	0,27
8.900.000	Delta Air Lines Inc*	7,38%	15/01/2026	10.449.720	0,31
8.345.000	DISH DBS Corp**	5,13%	01/06/2029	8.250.535	0,25
12.785.000	DISH DBS Corp**	7,38%	01/07/2028	13.774.303	0,41
19.937.000	DISH Network Corp**	3,38%	15/08/2026	20.395.551	0,61

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

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 87,11% (31 de diciembre de 2020: 87,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
12.255.000	Endure Digital Inc**	6,00%	15/02/2029	12.149.668	0,36
6.745.000	Energizer Holdings Inc**	4,75%	15/06/2028	6.925.429	0,21
12.955.000	Envision Healthcare Corp**	8,75%	15/10/2026	9.102.442	0,27
4.030.000	EPR Properties*	3,75%	15/08/2029	4.040.631	0,12
8.931.000	EPR Properties*	4,50%	01/06/2027	9.534.020	0,28
2.795.000	EPR Properties**	4,95%	15/04/2028	3.021.495	0,09
10.130.000	EQM Midstream Partners LP*	4,13%	01/12/2026	10.396.419	0,31
4.170.000	EQM Midstream Partners LP**	4,50%	15/01/2029	4.247.844	0,13
4.170.000	EQM Midstream Partners LP**	4,75%	15/01/2031	4.302.147	0,13
10.990.000	EQM Midstream Partners LP*	5,50%	15/07/2028	11.897.554	0,35
3.420.000	EQM Midstream Partners LP**	6,00%	01/07/2025	3.727.201	0,11
2.725.000	EQM Midstream Partners LP**	6,50%	01/07/2027	3.046.332	0,09
6.865.000	EQT Corp*	5,00%	15/01/2029	7.663.743	0,23
1.435.000	Everi Holdings Inc**	5,00%	15/07/2029	1.435.000	0,04
7.920.000	First Quantum Minerals Ltd**	6,88%	01/03/2026	8.295.091	0,25
6.280.000	First Quantum Minerals Ltd**	6,88%	15/10/2027	6.851.166	0,20
9.645.000	Ford Motor Co*	4,75%	15/01/2043	10.259.869	0,31
4.405.000	Ford Motor Co*	7,45%	16/07/2031	5.798.081	0,17
5.020.000	Ford Motor Co*	9,63%	22/04/2030	7.210.251	0,21
4.930.000	Ford Motor Credit Co LLC*	5,11%	03/05/2029	5.525.741	0,16
3.400.000	Forterra Finance LLC/FRTA Finance Corp**	6,50%	15/07/2025	3.674.856	0,11
6.210.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,00%	01/05/2028	6.427.847	0,19
8.490.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,88%	15/10/2027	9.105.525	0,27
2.265.000	Frontier Communications Holdings LLC**	6,75%	01/05/2029	2.412.837	0,07
4.335.000	Garda World Security Corp**	4,63%	15/02/2027	4.365.410	0,13
10.390.000	Garda World Security Corp**	6,00%	01/06/2029	10.325.634	0,31
8.865.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	6,25%	15/05/2026	8.904.892	0,27
6.475.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	6,50%	01/10/2025	6.552.797	0,20
2.745.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	8,00%	15/01/2027	2.887.397	0,09
32.690.996	Global Aircraft Leasing Co Ltd**	6,50%	15/09/2024	32.896.132	0,98
12.550.000	Global Infrastructure Solutions Inc**	5,63%	01/06/2029	13.040.077	0,39
3.260.000	Global Partners LP/GLP Finance Corp**	6,88%	15/01/2029	3.502.984	0,10
2.825.000	Global Partners LP/GLP Finance Corp*	7,00%	01/08/2027	3.000.150	0,09
6.040.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	5,00%	31/05/2026	6.210.082	0,18
5.365.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	5,00%	15/07/2029	5.623.861	0,17
8.305.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	5,25%	30/04/2031	8.678.725	0,26
9.310.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	9,50%	31/05/2025	10.417.890	0,31
11.955.000	Graham Packaging Co Inc**	7,13%	15/08/2028	12.915.106	0,38

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

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 87,11% (31 de diciembre de 2020: 87,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
4.140.000	Granite Merger Sub 2 Inc**	11,00%	15/07/2027	4.711.051	0,14
5.630.000	Granite US Holdings Corp**	11,00%	01/10/2027	6.299.210	0,19
11.895.000	GTCR AP Finance Inc**	8,00%	15/05/2027	12.709.748	0,38
4.465.000	GYP Holdings III Corp**	4,63%	01/05/2029	4.494.737	0,13
11.255.000	Harsco Corp**	5,75%	31/07/2027	11.822.927	0,35
7.665.000	Harvest Midstream I LP**	7,50%	01/09/2028	8.339.520	0,25
8.005.000	Hexion Inc**	7,88%	15/07/2027	8.646.241	0,26
2.793.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	5,75%	01/02/2029	2.915.627	0,09
4.825.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	6,00%	01/02/2031	5.120.531	0,15
3.000.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	6,25%	01/11/2028	3.195.765	0,10
14.955.000	HUB International Ltd**	7,00%	01/05/2026	15.546.769	0,46
5.200.000	Hudbay Minerals Inc**	4,50%	01/04/2026	5.226.000	0,16
5.410.000	Hudbay Minerals Inc**	6,13%	01/04/2029	5.768.412	0,17
4.210.000	IAA Inc**	5,50%	15/06/2027	4.427.741	0,13
2.930.000	Illuminate Buyer LLC/Illuminate Holdings IV Inc**	9,00%	01/07/2028	3.272.869	0,10
18.310.000	Imola Merger Corp**	4,75%	15/05/2029	18.859.300	0,56
12.625.000	Intelligent Packaging Ltd Finco Inc/Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC**	6,00%	15/09/2028	13.163.519	0,39
13.039.000	Iron Mountain Inc**	4,88%	15/09/2027	13.534.482	0,40
13.275.000	Iron Mountain Inc**	4,88%	15/09/2029	13.721.040	0,41
11.080.000	Iron Mountain Inc**	5,00%	15/07/2028	11.535.942	0,34
11.661.000	Iron Mountain Inc**	5,25%	15/03/2028	12.227.142	0,36
5.725.000	Iron Mountain Inc**	5,25%	15/07/2030	6.068.013	0,18
4.505.000	Iron Mountain Inc**	5,63%	15/07/2032	4.838.685	0,14
8.210.000	ITT Holdings LLC**	6,50%	01/08/2029	8.374.200	0,25
2.730.000	JELD-WEN Inc**	4,63%	15/12/2025	2.788.026	0,08
7.030.000	JELD-WEN Inc**	4,88%	15/12/2027	7.319.777	0,22
7.209.000	Joseph T Ryerson & Son Inc**	8,50%	01/08/2028	8.027.690	0,24
22.925.000	KAR Auction Services Inc**	5,13%	01/06/2025	23.554.291	0,70
7.810.000	Ken Garff Automotive LLC**	4,88%	15/09/2028	7.995.527	0,24
10.595.000	Korn Ferry**	4,63%	15/12/2027	11.021.714	0,33
6.330.000	L Brands Inc**	6,63%	01/10/2030	7.334.887	0,22
6.480.000	LCM Investments Holdings II LLC**	4,88%	01/05/2029	6.650.100	0,20
5.425.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC**	4,25%	01/07/2029	5.506.375	0,16
8.570.000	Legends Hospitality Holding Co LLC/Legends Hospitality Co-Issuer Inc**	5,00%	01/02/2026	8.944.937	0,27
21.401.000	Level 3 Financing Inc**	4,63%	15/09/2027	22.277.692	0,66
3.390.000	Life Time Inc**	5,75%	15/01/2026	3.517.413	0,10
7.415.000	Life Time Inc**	8,00%	15/04/2026	7.927.525	0,24
16.225.000	Lions Gate Capital Holdings LLC**	5,50%	15/04/2029	17.077.543	0,51

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

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 87,11% (31 de diciembre de 2020: 87,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
7.675.000	Live Nation Entertainment Inc**	4,75%	15/10/2027	7.962.812	0,24
7.195.000	Live Nation Entertainment Inc**	4,88%	01/11/2024	7.324.510	0,22
4.780.000	Live Nation Entertainment Inc**	6,50%	15/05/2027	5.319.064	0,16
5.115.000	LPL Holdings Inc**	4,63%	15/11/2027	5.315.482	0,16
8.400.000	Lumen Technologies Inc**	4,50%	15/01/2029	8.208.480	0,24
8.890.000	Lumen Technologies Inc**	5,38%	15/06/2029	9.034.463	0,27
17.605.000	Matador Resources Co**	5,88%	15/09/2026	18.156.917	0,54
7.164.000	Match Group Holdings II LLC**	5,63%	15/02/2029	7.766.707	0,23
9.575.000	Mercer International Inc**	5,13%	01/02/2029	9.864.644	0,29
3.625.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP/MGP Finance Co-Issuer Inc**	4,63%	15/06/2025	3.880.091	0,12
7.935.000	Midwest Gaming Borrower LLC/Midwest Gaming Finance Corp**	4,88%	01/05/2029	7.954.838	0,24
7.979.000	Motion Bondco DAC**	6,63%	15/11/2027	8.110.334	0,24
17.650.000	MPH Acquisition Holdings LLC**	5,75%	01/11/2028	17.760.048	0,53
6.000.000	NCL Corp Ltd**	3,63%	15/12/2024	5.802.150	0,17
11.830.000	NCL Corp Ltd**	5,88%	15/03/2026	12.418.128	0,37
4.930.000	NCL Finance Ltd**	6,13%	15/03/2028	5.180.986	0,15
20.390.000	New Fortress Energy Inc**	6,50%	30/09/2026	20.859.990	0,62
12.170.000	New Fortress Energy Inc**	6,75%	15/09/2025	12.474.250	0,37
5.695.000	Nielsen Co Luxembourg Sarl**	5,00%	01/02/2025	5.875.247	0,18
17.200.000	Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co**	5,63%	01/10/2028	18.187.366	0,54
12.960.000	Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co**	5,88%	01/10/2030	14.139.014	0,42
9.365.000	NOVA Chemicals Corp**	5,25%	01/06/2027	10.105.303	0,30
4.815.000	NuStar Logistics LP*	5,75%	01/10/2025	5.250.854	0,16
8.405.000	Occidental Petroleum Corp**	6,60%	15/03/2046	10.008.338	0,30
6.600.000	Occidental Petroleum Corp*	7,50%	01/05/2031	8.324.514	0,25
6.172.000	ON Semiconductor Corp**	3,88%	01/09/2028	6.366.943	0,19
10.935.000	OneMain Finance Corp*	3,50%	15/01/2027	11.030.681	0,33
5.745.000	OneMain Finance Corp*	8,88%	01/06/2025	6.386.487	0,19
4.090.000	Open Text Corp**	5,88%	01/06/2026	4.242.271	0,13
6.485.000	Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV**	5,13%	30/04/2031	6.688.953	0,20
3.951.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc/Ortho-Clinical Diagnostics SA**	7,38%	01/06/2025	4.258.447	0,13
9.515.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc/Ortho-Clinical Diagnostics SA**	7,25%	01/02/2028	10.411.789	0,31
2.651.000	Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp**	5,00%	15/08/2027	2.748.756	0,08
9.460.000	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer**	5,88%	01/10/2028	10.103.044	0,30
4.690.000	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer**	7,50%	01/06/2025	5.098.710	0,15
7.024.000	PDC Energy Inc**	5,75%	15/05/2026	7.346.612	0,22
14.126.000	Performance Food Group Inc**	5,50%	15/10/2027	14.865.143	0,44
2.005.000	Performance Food Group Inc**	6,88%	01/05/2025	2.144.217	0,06

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

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 87,11% (31 de diciembre de 2020: 87,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
8.200.000	Pilgrim's Pride Corp**	4,25%	15/04/2031	8.507.500	0,25
8.795.000	Post Holdings Inc**	4,63%	15/04/2030	8.954.014	0,27
14.425.000	Presidio Holdings Inc**	8,25%	01/02/2028	15.740.127	0,47
13.685.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	5,75%	15/04/2026	15.153.401	0,45
15.070.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	6,25%	15/01/2028	16.049.851	0,48
14.735.000	Rackspace Technology Global Inc**	5,38%	01/12/2028	15.121.794	0,45
16.650.000	Radiate Holdco LLC/Radiate Finance Inc**	6,50%	15/09/2028	17.515.883	0,52
5.060.000	Range Resources Corp*	4,88%	15/05/2025	5.243.425	0,16
2.845.000	Range Resources Corp**	8,25%	15/01/2029	3.211.336	0,10
9.010.000	Range Resources Corp**	9,25%	01/02/2026	9.949.293	0,30
2.855.000	Raptor Acquisition Corp/Raptor Co-Issuer LLC**	4,88%	01/11/2026	2.898.482	0,09
27.191.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	5,75%	15/01/2029	28.463.267	0,85
7.425.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	7,63%	15/06/2025	8.063.253	0,24
14.900.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	9,38%	01/04/2027	16.575.133	0,49
7.000.000	RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**	4,75%	15/10/2027	7.201.180	0,21
26.805.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	5,50%	01/04/2028	28.106.383	0,84
6.226.000	Scientific Games International Inc**	5,00%	15/10/2025	6.444.875	0,19
15.115.000	Scientific Games International Inc**	7,00%	15/05/2028	16.538.833	0,49
4.445.000	Scientific Games International Inc**	8,25%	15/03/2026	4.772.730	0,14
8.485.000	SCIH Salt Holdings Inc**	4,88%	01/05/2028	8.505.703	0,25
12.310.000	SCIH Salt Holdings Inc**	6,63%	01/05/2029	12.356.163	0,37
6.815.000	Scripps Escrow II Inc**	5,38%	15/01/2031	6.802.017	0,20
6.760.000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc**	9,50%	01/08/2025	7.258.651	0,22
5.625.000	Select Medical Corp**	6,25%	15/08/2026	6.003.619	0,18
1.360.000	Service Properties Trust**	3,95%	15/01/2028	1.285.866	0,04
3.904.000	Service Properties Trust**	4,35%	01/10/2024	3.936.442	0,12
3.870.000	Service Properties Trust**	4,38%	15/02/2030	3.691.786	0,11
1.711.000	Service Properties Trust**	4,65%	15/03/2024	1.744.279	0,05
385.000	Service Properties Trust**	4,95%	15/02/2027	384.286	0,01
3.993.000	Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp**	4,75%	15/02/2028	4.099.553	0,12
3.410.000	Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp**	4,75%	01/04/2029	3.514.875	0,10
5.920.000	Sirius XM Radio Inc**	4,13%	01/07/2030	5.986.985	0,18
7.640.000	Sirius XM Radio Inc**	5,00%	01/08/2027	8.022.955	0,24
13.950.000	Sirius XM Radio Inc**	5,50%	01/07/2029	15.218.753	0,45
9.280.000	Six Flags Entertainment Corp**	5,50%	15/04/2027	9.598.211	0,29
6.380.000	Six Flags Theme Parks Inc**	7,00%	01/07/2025	6.884.180	0,21
6.165.000	Solaris Midstream Holdings LLC**	7,63%	01/04/2026	6.542.606	0,19
6.840.000	SpA Holdings 3 Oy*	4,88%	04/02/2028	6.914.898	0,21

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

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 87,11% (31 de diciembre de 2020: 87,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
4.960.000	Spectrum Brands Inc**	5,50%	15/07/2030	5.363.496	0,16
6.435.000	Spirit AeroSystems Inc**	4,60%	15/06/2028	6.322.548	0,19
6.670.000	Spirit AeroSystems Inc**	7,50%	15/04/2025	7.139.468	0,21
5.615.000	SRS Distribution Inc**	4,63%	01/07/2028	5.748.356	0,17
3.115.000	SRS Distribution Inc**	6,13%	01/07/2029	3.212.904	0,10
9.339.000	SS&C Technologies Inc**	5,50%	30/09/2027	9.919.185	0,30
2.935.000	Summer BC Bidco B LLC**	5,50%	31/10/2026	2.987.654	0,09
6.605.000	Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp*	5,75%	15/04/2025	6.085.748	0,18
5.710.000	Talen Energy Supply LLC**	7,25%	15/05/2027	5.335.281	0,16
1.535.000	Talen Energy Supply LLC**	7,63%	01/06/2028	1.438.510	0,04
10.595.000	Talen Energy Supply LLC**	10,50%	15/01/2026	7.674.753	0,23
2.385.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	5,50%	15/09/2024	2.423.601	0,07
7.380.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	5,50%	15/01/2028	7.519.187	0,22
4.005.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00%	01/03/2027	4.133.160	0,12
5.285.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00%	31/12/2030	5.508.608	0,16
4.555.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	7,50%	01/10/2025	5.002.848	0,15
17.892.000	Team Health Holdings Inc**	6,38%	01/02/2025	17.053.402	0,51
5.965.000	TechnipFMC Plc**	6,50%	01/02/2026	6.442.364	0,19
52.090.000	Tenet Healthcare Corp**	6,13%	01/10/2028	55.657.644	1,66
4.230.000	Tenet Healthcare Corp**	6,25%	01/02/2027	4.420.350	0,13
8.195.000	Terex Corp**	5,00%	15/05/2029	8.553.531	0,25
4.320.000	TK Elevator US Newco Inc**	5,25%	15/07/2027	4.557.600	0,14
7.660.000	TMS International Corp**	6,25%	15/04/2029	8.052.575	0,24
32.555.000	TransDigm Inc*	5,50%	15/11/2027	33.979.281	1,01
9.390.000	TransDigm Inc*	6,38%	15/06/2026	9.739.496	0,29
8.340.000	TransDigm Inc*	7,50%	15/03/2027	8.882.934	0,26
6.675.000	Trident TPI Holdings Inc**	9,25%	01/08/2024	7.004.211	0,21
8.180.000	Trivium Packaging Finance BV*	8,50%	15/08/2027	8.914.237	0,27
7.240.000	Tronox Inc**	4,63%	15/03/2029	7.321.378	0,22
1.489.718	United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust**	4,88%	15/01/2026	1.582.114	0,05
9.135.000	United Airlines Holdings Inc**	4,88%	15/01/2025	9.490.260	0,28
4.410.000	United Airlines Holdings Inc**	5,00%	01/02/2024	4.592.199	0,14
17.945.000	United Airlines Inc**	4,38%	15/04/2026	18.598.736	0,55
4.560.000	United Airlines Inc**	4,63%	15/04/2029	4.725.300	0,14
10.245.000	Uniti Group LP/Uniti Fiber Holdings Inc/CSL Capital LLC**	7,13%	15/12/2024	10.603.575	0,32
20.010.000	Uniti Group LP/Uniti Fiber Holdings Inc/CSL Capital LLC**	7,88%	15/02/2025	21.483.336	0,64
21.500.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC**	6,50%	15/02/2029	21.583.743	0,64
9.835.000	Univar Solutions USA Inc**	5,13%	01/12/2027	10.371.106	0,31

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

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 87,11% (31 de diciembre de 2020: 87,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
3.655.000	US Acute Care Solutions LLC**	6,38%	01/03/2026	3.789.431	0,11
14.955.000	US Foods Inc**	4,75%	15/02/2029	15.273.467	0,45
7.555.000	US Foods Inc**	6,25%	15/04/2025	8.017.744	0,24
7.223.000	USA Compression Partners LP/USA Compression Finance Corp**	6,88%	01/04/2026	7.583.644	0,23
6.532.000	USA Compression Partners LP/USA Compression Finance Corp**	6,88%	01/09/2027	6.991.069	0,21
2.130.000	Vertical Holdco GmbH**	7,63%	15/07/2028	2.315.715	0,07
3.646.000	VICI Properties LP/VICI Note Co Inc**	4,25%	01/12/2026	3.797.200	0,11
11.420.000	Vine Energy Holdings LLC**	6,75%	15/04/2029	12.033.825	0,36
4.500.000	Virgin Media Finance Plc**	5,00%	15/07/2030	4.552.290	0,14
12.985.000	Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC*	5,00%	15/07/2028	13.291.511	0,40
6.535.000	Vistra Operations Co LLC**	4,38%	01/05/2029	6.575.844	0,20
3.300.000	Vistra Operations Co LLC**	5,00%	31/07/2027	3.392.004	0,10
4.945.000	Vizient Inc**	6,25%	15/05/2027	5.246.942	0,16
9.995.000	VM Consolidated Inc**	5,50%	15/04/2029	10.205.495	0,30
10.480.000	Vmed O2 UK Financing I Plc**	4,75%	15/07/2031	10.663.400	0,32
11.055.000	Watco Cos LLC/Watco Finance Corp**	6,50%	15/06/2027	11.861.131	0,35
9.525.000	Western Midstream Operating LP*	5,30%	01/02/2030	10.695.337	0,32
3.420.000	White Capital Buyer LLC**	6,88%	15/10/2028	3.664.992	0,11
4.550.000	White Capital Parent LLC**	8,25%	15/03/2026	4.723.856	0,14
7.215.000	William Carter Co**	5,63%	15/03/2027	7.612.114	0,23
3.065.000	WR Grace & Co-Conn**	5,63%	01/10/2024	3.398.886	0,10
8.690.000	Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp**	5,25%	15/05/2027	9.358.696	0,28
18.605.000	Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp**	5,50%	01/03/2025	20.080.190	0,60
3.635.000	XHR LP**	4,88%	01/06/2029	3.757.681	0,11
11.860.000	Zayo Group Holdings Inc**	6,13%	01/03/2028	12.128.510	0,36
Total bonos de empresa				2.925.124.214	87,11
Préstamos a plazo^ 3,89% (31 de diciembre de 2020: 3,80%)					
Dólar estadounidense					
3.895.238	ADMI Corp	3,25%	23/12/2027	3.857.103	0,12
3.382.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/Aru Finance Corp	10,00%	01/11/2025	3.745.565	0,11
4.247.100	Carnival Corp	0,00%	30/06/2025	4.357.716	0,13
15.760.189	Gainwell Acquisition Corp	4,75%	01/10/2027	15.838.990	0,47
5.063.800	Granite Generation LLC	4,75%	09/11/2026	4.953.029	0,15
6.820.117	Granite US Holdings Corp	4,15%	30/09/2026	6.854.218	0,20
28.020.014	Great Outdoors Group LLC	5,00%	06/03/2028	28.155.771	0,84
12.763.013	Ivanti Software Inc	5,75%	01/12/2027	12.801.110	0,38
6.270.380	Mauser Packaging Solutions Holding Co	3,35%	03/04/2024	6.130.770	0,18

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

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
Préstamos a plazo[^] 3,89% (31 de diciembre de 2020: 3,80%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
211.079	National Mentor Holdings Inc	0,00%	02/03/2028	211.679	0,01
6.316.531	National Mentor Holdings Inc	4,50%	02/03/2028	6.334.501	0,19
6.209.652	Redstone Holdco 2 LP	5,50%	27/04/2028	6.207.075	0,18
5.363.940	Service Logic Acquisition Inc	4,75%	29/10/2027	5.394.112	0,16
4.666.631	Solenis Holdings LLC	4,14%	26/06/2025	4.671.624	0,14
3.550.000	Solenis Holdings LLC	8,64%	26/06/2026	3.562.869	0,11
17.890.466	Team Health Holdings Inc	3,75%	06/02/2024	17.428.266	0,52
Total préstamos a plazo[†]				130.504.398	3,89

Número de acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Fondos de inversión 1,08% (31 de diciembre de 2020: 0,90%)			
Libra esterlina			
25.312.164	NB Global Monthly Income Fund Ltd	30.771.389	0,92
Total libra esterlina		30.771.389	0,92
Dólar estadounidense			
459.982	Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund	5.427.788	0,16
Total dólar estadounidense		5.427.788	0,16
Total fondos de inversión[‡]		36.199.177	1,08
Total inversiones		3.109.141.817	92,59

Contratos de divisas a plazo 0,32% (31 de diciembre de 2020: 2,70%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases AUD con cobertura						
115 AUD	86 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
3.923.057 USD	5.102.666 AUD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	91.905	0,00
5.039.375 USD	6.538.706 AUD	19/07/2021	UBS AG	2	130.024	0,01
18.746.937 USD	24.263.005 AUD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	76	529.935	0,02
Clases CAD con cobertura						
6.134.329 CAD	4.881.260 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	72.522	0,00
6.134.329 CAD	4.883.028 USD	19/07/2021	UBS AG	1	70.754	0,00
6.119.452 CAD	4.872.500 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	69.269	0,00

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,32% (31 de diciembre de 2020: 2,70%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases CHF con cobertura						
120.446 CHF	130.160 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	204	0,00
1.196.870 USD	1.101.071 CHF	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	5.135	0,00
1.196.860 USD	1.101.071 CHF	19/07/2021	UBS AG	1	5.126	0,00
1.641.246 USD	1.505.198 CHF	19/07/2021	Westpac Banking Corp	15	12.106	0,00
Clases CNY con cobertura						
17.300.502 CNY	2.630.013 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	44.321	0,00
17.300.502 CNY	2.629.941 USD	19/07/2021	UBS AG	1	44.392	0,00
17.570.798 CNY	2.670.342 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	45.774	0,00
Clases EUR con cobertura						
5 €	6 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
66.880.627 USD	55.785.876 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	700.343	0,02
66.852.957 USD	55.785.876 €	19/07/2021	UBS AG	1	672.673	0,02
81.225.275 USD	67.689.957 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	48	922.862	0,03
Clases GBP con cobertura						
48.961.408 £	67.395.721 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	245.388	0,01
48.961.408 £	67.402.380 USD	19/07/2021	UBS AG	1	238.729	0,01
48.354.073 £	66.537.269 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	7	264.795	0,01
3.998.715 USD	2.837.488 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	49	78.673	0,00
Clases HKD con cobertura						
747.341 HKD	96.170 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	68	0,00
782.049 USD	6.071.634 HKD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	182	0,00
781.965 USD	6.071.634 HKD	19/07/2021	UBS AG	1	98	0,00
1.153.798 USD	8.956.991 HKD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	373	0,00
Clases SEK con cobertura						
560.556 SEK	65.170 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	387	0,00
514.070 SEK	59.589 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	5	531	0,00
829.752 USD	7.028.283 SEK	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	7.801	0,00
830.844 USD	7.028.283 SEK	19/07/2021	UBS AG	1	8.893	0,00
1.099.197 USD	9.301.996 SEK	19/07/2021	Westpac Banking Corp	45	11.340	0,00
Clases SGD con cobertura						
6.625 SGD	4.926 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	3	0,00
681.186 USD	910.745 SGD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	3.676	0,00
681.132 USD	910.745 SGD	19/07/2021	UBS AG	1	3.622	0,00
1.628.280 USD	2.164.516 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	9	18.083	0,00

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,32% (31 de diciembre de 2020: 2,70%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases ZAR con cobertura						
1.389.922 USD	18.917.401 ZAR	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	67.927	0,00
1.676.763 USD	23.903.904 ZAR	19/07/2021	UBS AG	1	6.298	0,00
6.686.430 USD	93.208.025 ZAR	19/07/2021	Westpac Banking Corp	43	172.821	0,01
1.252.220.413 ZAR	85.583.871 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	1.924.417	0,06
1.279.913.967 ZAR	87.479.402 USD	19/07/2021	UBS AG	2	1.964.181	0,06
1.275.701.600 ZAR	87.020.876 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	20	2.128.338	0,06
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					10.563.969	0,32

Contratos de swap de rentabilidad total (0,02%) (31 de diciembre de 2020: 0,02%)

Importe nocional	Fecha de extinción	Tipo variable ¹	Entidad de referencia ²	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
USD 56.249.827	20/09/2021	0,14	iBoxx USD Liquid High Yield Index	371.420	0,01
USD 40.000.290	20/09/2021	0,14	iBoxx USD Liquid High Yield Index	276.110	0,01
Plusvalía latente total sobre contratos de swap de rentabilidad total [∞]				647.530	0,02

¹ El LIBOR a 3 meses es la referencia para la totalidad de los contratos de swap de rentabilidad total.

² La contraparte en todos los contratos de swap de rentabilidad total es JPMorgan Chase Bank.

Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
	3.120.353.316	92,93

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,38%) (31 de diciembre de 2020: (0,59%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
35.390.710 USD	25.664.232 £	19/07/2021	UBS AG	2	(64.911)	(0,00)
Clases AUD con cobertura						
103.342.934 AUD	79.428.421 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(1.837.112)	(0,06)
101.927.239 AUD	78.359.317 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(1.830.931)	(0,06)
104.394.294 AUD	80.283.545 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	33	(1.902.861)	(0,06)
863.589 USD	1.153.488 AUD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	(2.466)	(0,00)
Clases CAD con cobertura						
61.519 CAD	49.941 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	(261)	(0,00)
1.359.116 USD	1.708.014 CAD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(20.193)	(0,00)
1.359.608 USD	1.708.014 CAD	19/07/2021	UBS AG	1	(19.701)	(0,00)
3.128.406 USD	3.900.194 CAD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	(21.199)	(0,00)

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (0,38%) (31 de diciembre de 2020: (0,59%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases CHF con cobertura						
3.837.313 CHF	4.174.085 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	(20.803)	(0,00)
3.773.578 CHF	4.101.761 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(17.461)	(0,00)
4.362.408 CHF	4.750.550 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	9	(28.934)	(0,00)
Clases CNY con cobertura						
9.533.200 CNY	1.478.837 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	(5.182)	(0,00)
1.219.562 USD	8.022.407 CNY	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(20.552)	(0,00)
1.219.529 USD	8.022.407 CNY	19/07/2021	UBS AG	1	(20.585)	(0,00)
1.200.831 USD	7.902.670 CNY	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(20.774)	(0,00)
Clases EUR con cobertura						
149.619.449 €	179.360.215 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(1.862.643)	(0,06)
152.040.362 €	182.233.952 USD	19/07/2021	UBS AG	4	(1.864.385)	(0,06)
148.001.735 €	177.306.762 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	43	(1.728.326)	(0,05)
Clases GBP con cobertura						
721.096 £	1.007.414 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(11.206)	(0,00)
3.515.129 £	4.964.464 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	25	(108.248)	(0,00)
38.438.392 USD	27.924.589 £	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(139.954)	(0,01)
38.442.190 USD	27.924.589 £	19/07/2021	UBS AG	1	(136.157)	(0,00)
39.034.962 USD	28.368.049 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	11	(156.034)	(0,01)
Clases HKD con cobertura						
24.456.611 HKD	3.150.104 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(735)	(0,00)
24.741.005 HKD	3.186.406 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(415)	(0,00)
25.452.169 HKD	3.278.157 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	5	(586)	(0,00)
160.832 USD	1.249.717 HKD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	(99)	(0,00)
Clases SEK con cobertura						
43.169.913 SEK	5.098.046 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	(49.366)	(0,00)
42.600.298 SEK	5.035.688 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(53.625)	(0,00)
43.420.698 SEK	5.125.182 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	27	(47.172)	(0,00)
19.843 USD	169.876 SEK	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	(24)	(0,00)
Clases SGD con cobertura						
10.131.834 SGD	7.578.681 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	(41.544)	(0,00)
9.815.551 SGD	7.340.892 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(39.040)	(0,00)
13.273.494 SGD	9.940.750 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	18	(66.511)	(0,00)
Clases ZAR con cobertura						
4.972.289 USD	72.752.051 ZAR	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(111.806)	(0,00)
4.973.209 USD	72.752.051 ZAR	19/07/2021	UBS AG	1	(110.886)	(0,00)
9.137.791 USD	133.753.974 ZAR	19/07/2021	Westpac Banking Corp	27	(209.269)	(0,01)
17.674.177 ZAR	1.295.175 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(60.059)	(0,00)
49.453.930 ZAR	3.523.547 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	25	(67.583)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(12.699.599)	(0,38)

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

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	(12.699.599)	(0,38)
	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	3.107.653.717	92,55
Otro activo neto	250.168.969	7,45
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	3.357.822.686	100,00

^ Puede que los préstamos a plazo con cupón del 0,00% no se hayan liquidado a 30 de junio de 2021, por lo que no tienen tipos de interés efectivos. Los tipos de interés no tienen efecto hasta la liquidación.

Análisis de la cartera	USD	% de los Activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	272.117.158	7,93
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	2.670.321.084	77,84
† Otros valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario	130.504.398	3,80
μ Fondos de inversión	36.199.177	1,06
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(1.488.100)	(0,04)
Total inversiones	3.107.653.717	90,59

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
38.720.000	CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC, 5.50%, 15/06/2031	38.982.918
28.160.818	Great American Outdoors Group LLC, 5.00%, 6/03/2028	28.020.014
26.805.000	Royal Caribbean Cruises Ltd, 5.50%, 01/04/2028	27.879.594
27.191.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp, 5.75%, 15/01/2029	27.730.138
24.215.000	United Airlines Inc, 4.38%, 15/04/2026	24.741.175
21.500.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC, 6.50%, 15/02/2029	21.616.427
21.420.000	CHS/Community Health Systems Inc, 6.13%, 01/04/2030	21.420.000
20.390.000	New Fortress Energy Inc, 6.50%, 30/09/2026	20.390.000
18.310.000	Imola Merger Corp, 4.75%, 15/05/2029	18.455.725
18.130.000	US Foods Inc, 4.75%, 15/02/2029	18.241.488
16.525.000	BCPE Empire Holdings Inc, 7.63%, 01/05/2027	16.549.554
16.225.000	Lions Gate Capital Holdings LLC, 5.50%, 15/04/2029	16.251.094
15.590.000	Carnival Corp, 5.75%, 01/03/2027	15.984.663
15.085.000	Cinemark USA Inc, 5.88%, 15/03/2026	15.556.073
15.937.640	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 6.50%, 15/09/2024	15.165.103
14.985.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.50%, 20/04/2026	15.091.650
14.390.000	Ahead DB Holdings LLC, 6.63%, 01/05/2028	14.587.088
13.825.000	NRG Energy Inc, 3.63%, 15/02/2031	14.279.494
13.310.000	CommScope Technologies LLC, 5.00%, 15/03/2027	13.279.946
12.756.000	Level 3 Financing Inc, 4.63%, 15/09/2027	13.161.804

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas (cont.)

20 ventas de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
30.745.000	Tenet Healthcare Corp, 7.00%, 01/08/2025	31.872.290
28.162.133	Bass Pro Group, LLC, 5.75%, 25/09/2024	28.162.133
26.185.000	Beacon Roofing Supply Inc, 4.88%, 01/11/2025	26.778.381
23.160.000	Mileage Plus Holdings LLC/Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 6.50%, 20/06/2027	25.307.650
18.465.000	TransDigm Inc, 5.50%, 15/11/2027	19.171.094
18.230.000	Garda World Security Corp, 8.75%, 15/05/2025	19.035.420
16.040.000	Carnival Corp, 11.50%, 01/04/2023	18.398.050
16.727.000	Cheniere Energy Partners LP, 4.50%, 01/10/2029	17.500.764
16.055.000	American Axle & Manufacturing Inc, 6.88%, 01/07/2028	17.228.200
16.685.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co, 7.25%, 15/04/2025	16.427.228
15.570.000	Staples Inc, 7.50%, 15/04/2026	16.159.869
15.783.000	CrownRock LP/CrownRock Finance Inc, 5.63%, 15/10/2025	15.974.821
15.125.000	Cheniere Energy Inc, 4.63%, 15/10/2028	15.938.013
13.885.000	Occidental Petroleum Corp, 5.88%, 01/09/2025	14.884.069
13.760.000	Ford Motor Credit Co LLC, 5.13%, 16/06/2025	14.861.631
11.605.000	FirstEnergy Corp, 4.85%, 15/07/2047	13.759.375
11.825.000	Royal Caribbean Cruises Ltd, 10.88%, 01/06/2023	13.586.519
13.825.000	NRG Energy Inc, 3.63%, 15/02/2031	13.531.400
11.560.000	Royal Caribbean Cruises Ltd, 11.50%, 01/06/2025	13.456.756
13.686.003	Lower Cadence Holdings LLC, 4.15%, 22/05/2026	13.437.892

Neuberger Berman Diversified Currency Fund*

Informe del Gestor de inversiones

Desde el 1 de enero de 2021 hasta el cierre de la Cartera el 22 de enero de 2021, la rentabilidad total de la Clase de Acumulación USD I fue del 0,18%. En el mismo periodo, el índice ICE BofA US 3-Month Treasury Bill (Total Return, USD) (el "Índice") obtuvo una rentabilidad del 0%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

A lo largo del primer semestre de 2021, las divisas con mejor comportamiento fueron el dólar canadiense y la libra esterlina. Por el extremo contrario destacaron el yen japonés y el franco suizo. La Cartera generó una rentabilidad positiva en el periodo. La infraponderación en francos suizos y una sobreponderación en dólares canadienses fueron las posiciones que mejor se comportaron, mientras que las infraponderaciones en yenes y reales brasileños lastraron la rentabilidad relativa.

Los datos económicos se deterioraron de forma generalizada durante el periodo, tanto en términos absolutos como en relación con las expectativas. Sin embargo, el aumento de las presiones inflacionistas provocó un ascenso de las rentabilidades del segmento a corto plazo de la curva estadounidense durante el semestre, lo que dio lugar a una ventaja de rentabilidad del país respecto de otras grandes economías y dio impulso al dólar estadounidense a pesar del amplio consenso que apuntaba a una bajada del billete verde a comienzos de año.

Por otra parte, las excelentes expectativas para el PIB nominal hicieron que los precios de las materias primas continuasen subiendo, en consonancia con las monedas de exportación de estos productos, y en detrimento de monedas de financiación tradicionales como el yen japonés y el franco suizo. La aparición de la variante dominante Delta generó preocupación por el posible aplazamiento de la plena reapertura de las economías hasta que las tasas de vacunación sean notablemente más elevadas.

Por lo que respecta a la evolución de la reapertura, el Reino Unido se situó a la cabeza de las principales economías en el avance de la vacunación y se espera que reabra antes que otras, lo que, unido a la desaparición de la incertidumbre asociada al Brexit, benefició a la libra esterlina.

*La Cartera se liquidó el 22 de enero de 2021.

Neuberger Berman Diversified Currency Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		–	517.360
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	37.295	1.362.895
Ingresos a percibir y otros activos		2.029	12.235
Activos totales		39.324	1.892.490
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		–	502.532
Descubierto bancario	3	243	–
Gastos devengados		18.323	40.795
Otras cuentas por pagar		20.758	37.571
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		39.324	580.898
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		–	1.311.592

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Diversified Currency Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021*	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
		USD	USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		9	23.528
Ingresos varios		10.106	–
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		2.635	(473.354)
		12.750	(449.826)
Gastos			
Comisión de gestión	5	446	209.361
Comisión de distribución	5	17	433
Comisión de administración	5	11.347	40.734
Comisión de compromiso	16	–	4.392
Comisión de depósito	5	–	5.996
Comisión del Depositario	5	4	2.411
Honorarios profesionales	7	2.660	22.561
Honorarios de los Consejeros	6	–	2.380
Costes de transacciones	7	–	18.814
Honorarios de auditoría	7	8.897	7.810
Reembolso de IVA		(6)	(160)
Otros gastos	7	–	4.344
Gastos no asumidos	5	(12.754)	(56.661)
Gastos totales		10.611	262.415
Gastos por intereses		–	174
		–	174
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		2.139	(712.415)

*La Cartera se liquidó el 22 de enero de 2021.

Todos los beneficios y pérdidas proceden exclusivamente de operaciones interrumpidas.

Neuberger Berman Diversified Currency Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021*	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	1.311.592	68.283.212
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	2.139	(712.415)
Suscripciones	–	23.627.827
Reembolsos	(1.313.731)	(82.075.584)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	–	9.123.040

*La Cartera se liquidó el 22 de enero de 2021.

Neuberger Berman Diversified Currency Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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 período 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 período. Como mínimo, se presentan las 20 compras y las 20 ventas más importantes, siempre que se disponga de dicha información.

En el período no se produjeron ni compras ni ventas.

Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 13,64%. En el mismo periodo, el índice de referencia, el S&P 500 (Total Return, Net of Tax, USD) (el "Índice"), registró una rentabilidad del 15,00%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Durante el periodo analizado, los mercados de renta variable estadounidense se vieron favorecidos por un sólido crecimiento económico y la mejora de los fundamentales de las empresas. La economía estadounidense se benefició de unos esfuerzos de vacunación prósperos y constantes, de estímulos fiscales adicionales, de la demanda acumulada de los consumidores, del aumento de la actividad empresarial y de la mejora del mercado laboral. Esto permitió una aceleración espectacular del crecimiento económico. Actualmente se espera un crecimiento del PIB real estadounidense superior al 6,5% en 2021 y de un 4,1% adicional en 2022. El avance hacia la aprobación de un proyecto de ley de infraestructuras en EE. UU. representa un posible catalizador adicional para el crecimiento. Esto está dando lugar a lo que consideramos un panorama favorable para nuestro análisis fundamental y bottom-up. Creemos que nuestra cartera sigue estando bien posicionada para hacer frente al entorno actual.

La acertada selección de valores en los sectores de consumo básico, atención sanitaria y tecnología de la información benefició a la rentabilidad relativa en el año en curso. La selección de valores en servicios de comunicación, finanzas y materiales lastró la rentabilidad. En general, el posicionamiento de la cartera benefició a la rentabilidad relativa durante el semestre. La ausencia de exposición de la Cartera a los sectores de la energía e inmobiliario lastró la rentabilidad. La Cartera se benefició de una sobreponderación del sector financiero y de una infraponderación de los sectores de atención sanitaria, tecnología de la información y suministros públicos.

La rentabilidad del último año ha sido sólida en términos absolutos y relativos. La Cartera, con una rentabilidad del 44,14%, batió al índice 40,14% en 400 puntos básicos durante el periodo. Diez de los 11 sectores que la componen aportaron valor.

La cartera cerró el periodo con sobreponderaciones en consumo discrecional, finanzas y materiales, con infraponderaciones en atención sanitaria y tecnología de la información, y sin exposición a los sectores de la energía e inmobiliario.

La construcción de la cartera constituye un importante componente de nuestro proceso de inversión y seguimos encontrando lo que nos parecen oportunidades atractivas en nuestras tres categorías de inversión: situaciones especiales, oportunista e inversiones clásicas. Este enfoque equilibrado se ha concebido para mitigar el riesgo y generar alfa mediante la selección de títulos en distintos contextos de mercado.

La esencia de nuestro proceso de inversión es la atención sistemática a la generación de flujo de caja libre de una empresa y al uso que su equipo directivo hace del mismo. Creemos que el flujo de caja libre es una medida más clara de creación de valor que los beneficios recogidos en una cuenta de pérdidas y ganancias, que pueden depender de los diversos métodos contables. En nuestro análisis tenemos en cuenta la estabilidad y el origen de la generación de flujo de caja libre, así como los usos que se pueden dar a este capital. Este enfoque de inversión nos permite estudiar los distintos sectores, capitalizaciones de mercado y perfiles de riesgo para encontrar oportunidades, sobre todo en periodos de mayor volatilidad del mercado.

La combinación de aceleración del crecimiento económico, estímulos fiscales y monetarios, y distorsiones en los precios de determinadas acciones crea un entorno propicio para la estrategia US Multi Cap Opportunities. La demanda acumulada planteó problemas a determinadas cadenas de suministro y el actual cambio del patrón de conducta de los consumidores podrían dar lugar a un entorno único para que las empresas marquen una diferencia frente a sus homólogas. La profundidad de nuestro acervo de conocimientos continúa siendo sólida. Seguimos identificando oportunidades de inversión atractivas a medida que evolucionan las condiciones del mercado de renta variable.

Consideramos que la apertura de la economía estadounidense evolucionará en paralelo con la campaña de vacunación contra la COVID-19, lo que favorecerá al crecimiento de los beneficios de las empresas del país. A nuestro juicio, la Cartera está bien posicionada para sacar partido del constante crecimiento de la actividad económica mundial y la atención cada vez mayor de los inversores a los fundamentales de las empresas.

Seguimos aplicando un análisis fundamental disciplinado para tratar de identificar modelos de negocio de alta calidad con un elevado flujo de caja disponible que coticen a valoraciones atractivas. Consideramos que nuestra estrategia de inversión puede generar valor a largo plazo para los clientes y afrontar de forma eficaz un entorno de mercado dinámico. Seguiremos llevando a cabo nuestra evaluación tanto de las posibles posiciones nuevas como de las posiciones actuales de la cartera desde una perspectiva de inversión a largo plazo. Como siempre, la prioridad es lograr una revalorización de los activos de los clientes aplicando de forma disciplinada nuestra filosofía y nuestro proceso de inversión.

Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		703.496.228	611.979.879
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	3.266.101	9.272.078
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		2.836.800	–
Cuentas a percibir por acciones emitidas		4.907.712	2.764.749
Ingresos a percibir y otros activos		213.819	169.843
Activos totales		714.720.660	624.186.549
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		549.822	1.008.002
Descubierto bancario	3	–	260
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		3.115.129	11.183.620
Gastos devengados		816.750	756.692
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		5.263.120	1.782
Otras cuentas por pagar		101.855	84.328
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		9.846.676	13.034.684
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		704.873.984	611.151.865

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		103	7.883
Ingresos por dividendos		4.160.518	4.466.428
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		82.435.304	(87.381.810)
		86.595.925	(82.907.499)
Gastos			
Comisión de gestión	5	3.655.025	3.550.709
Comisión de distribución	5	459.047	401.255
Comisión de administración	5	358.803	426.703
Comisión de compromiso	16	41.422	37.854
Comisión de depósito	5	7.440	11.485
Comisión del Depositario	5	16.114	31.470
Honorarios profesionales	7	83.508	51.396
Honorarios de los Consejeros	6	1.014	2.380
Costes de transacciones	7	139.640	151.705
Honorarios de auditoría	7	11.128	11.076
Reembolso de IVA		(2.815)	(2.129)
Otros gastos	7	9.087	18.083
Gastos no asumidos	5	–	(4)
Gastos totales		4.779.413	4.691.983
Costes financieros			
Gastos por intereses		397	6.715
Repartos de dividendos abonados	1	7.651	43.662
		8.048	50.377
Impuestos retenidos en origen		1.111.080	1.281.197
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		80.697.384	(88.931.056)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	611.151.865	763.461.480
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	80.697.384	(88.931.056)
Suscripciones	155.532.366	191.401.238
Reembolsos	(142.507.631)	(281.441.171)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	704.873.984	584.490.491

Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (cont.)

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 99,74% (31 de diciembre de 2020: 99,67%)			
Dólar estadounidense			
114.800	Activision Blizzard Inc	10.956.512	1,55
13.500	Alphabet Inc Class C	33.835.320	4,80
6.650	Amazon.com Inc	22.877.064	3,25
85.000	Apollo Global Management Inc Class A	5.287.000	0,75
230.400	Apple Inc	31.555.584	4,48
468.700	Aramark	17.459.075	2,48
243.200	Ball Corp	19.704.064	2,79
113.700	Berkshire Hathaway Inc Class B	31.599.504	4,48
184.200	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	8.764.236	1,24
3.400	Booking Holdings Inc	7.439.506	1,06
523.600	Brookfield Asset Management Inc Class A	26.693.128	3,79
98.000	Brookfield Renewable Corp Class A	4.110.120	0,58
60.000	Brunswick Corp	5.977.200	0,85
5.100	Cable One Inc	9.755.331	1,38
209.700	Charles Schwab Corp	15.268.257	2,17
86.200	Chubb Ltd	13.700.628	1,94
341.400	Cisco Systems Inc	18.094.200	2,57
50.700	Columbia Sportswear Co	4.986.852	0,71
383.800	Comcast Corp Class A	21.884.276	3,10
565.200	CSX Corp	18.131.616	2,57
71.000	Eagle Materials Inc	10.089.810	1,43
470.000	Graphic Packaging Holding Co	8.525.800	1,21
116.400	HCA Healthcare Inc	24.064.536	3,41
150.000	Hill-Rom Holdings Inc	17.038.500	2,42
93.700	Intercontinental Exchange Inc	11.122.190	1,58
139.900	JPMorgan Chase & Co	21.760.046	3,09
128.100	Lamb Weston Holdings Inc	10.332.546	1,47
177.000	Las Vegas Sands Corp	9.326.130	1,32
92.700	Lowe's Cos Inc	17.981.019	2,55
59.100	McDonald's Corp	13.651.509	1,94
118.700	Microsoft Corp	32.155.830	4,56
174.100	Mondelez International Inc Class A	10.870.804	1,54
105.700	Motorola Solutions Inc	22.921.045	3,25
102.300	NIKE Inc Class B	15.804.327	2,24
49.000	Nordson Corp	10.755.990	1,53
70.350	PayPal Holdings Inc	20.505.618	2,91
361.300	Pfizer Inc	14.148.508	2,01
87.000	Progressive Corp	8.544.270	1,21

Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (cont.)

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 99,74% (31 de diciembre de 2020: 99,67%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
211.800	Raytheon Technologies Corp	18.068.658	2,56
39.100	Rockwell Automation Inc	11.183.382	1,59
43.700	Sherwin-Williams Co	11.906.065	1,69
89.800	Stanley Black & Decker Inc	18.408.102	2,61
423.600	US Foods Holding Corp	16.249.296	2,30
79.300	Walt Disney Co	13.938.561	1,98
22.000	WD-40 Co	5.638.380	0,80
Total valores de renta variable *		703.070.395	99,74
Total inversiones		703.070.395	99,74

Contratos de divisas a plazo 0,06% (31 de diciembre de 2020: 0,47%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases AUD con cobertura						
31.652 AUD	23.747 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	17	0,00
769.261 USD	1.001.616 AUD	19/07/2021	Goldman Sachs International	5	17.234	0,00
765.056 USD	994.604 AUD	19/07/2021	UBS AG	4	18.293	0,00
1.195.209 USD	1.551.227 AUD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	38	30.525	0,01
Clases EUR con cobertura						
445.346 USD	367.716 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	4	9.116	0,00
79.554 USD	65.785 €	19/07/2021	UBS AG	1	1.512	0,00
1.762.271 USD	1.459.455 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	24	30.879	0,01
Clases SGD con cobertura						
439.145 SGD	326.516 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	166	0,00
376.387 SGD	279.813 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	9	185	0,00
1.221.575 USD	1.629.315 SGD	19/07/2021	Goldman Sachs International	5	9.517	0,00
241.585 USD	324.552 SGD	19/07/2021	UBS AG	1	149	0,00
2.881.474 USD	3.834.744 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	52	28.786	0,00
Clases ZAR con cobertura						
174.302 USD	2.487.270 ZAR	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	485	0,00
425.467 USD	6.030.983 ZAR	19/07/2021	UBS AG	4	4.007	0,00
3.009.332 USD	42.086.396 ZAR	19/07/2021	Westpac Banking Corp	27	68.231	0,01
38.867.978 ZAR	2.657.903 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	58.288	0,01
47.351.420 ZAR	3.239.485 USD	19/07/2021	UBS AG	7	69.550	0,01
56.465.208 ZAR	3.867.036 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	23	78.893	0,01
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					425.833	0,06

Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (cont.)

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	703.496.228	99,80				
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados						
Contratos de divisas a plazo (0,08%) (31 de diciembre de 2020: (0,17%))						
Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patri- monio neto
Clases AUD con cobertura						
1.741.866 AUD	1.339.228 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	7	(31.412)	(0,00)
1.660.181 AUD	1.276.535 USD	19/07/2021	UBS AG	6	(30.048)	(0,00)
3.064.093 AUD	2.357.485 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	52	(56.923)	(0,01)
Clases EUR con cobertura						
4.741.856 €	5.693.623 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	12	(68.232)	(0,01)
3.853.465 €	4.619.476 USD	19/07/2021	UBS AG	5	(48.006)	(0,01)
4.573.528 €	5.483.721 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	22	(58.020)	(0,01)
Clases SGD con cobertura						
11.547.017 SGD	8.638.240 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	8	(48.339)	(0,01)
10.071.290 SGD	7.531.887 USD	19/07/2021	UBS AG	4	(39.790)	(0,01)
14.770.572 SGD	11.063.619 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	60	(75.699)	(0,01)
82 USD	110 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(0)	(0,00)
Clases ZAR con cobertura						
188.728 USD	2.718.447 ZAR	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(1.244)	(0,00)
37.541 USD	545.637 ZAR	19/07/2021	UBS AG	1	(590)	(0,00)
1.694.339 USD	24.521.198 ZAR	19/07/2021	Westpac Banking Corp	24	(19.264)	(0,00)
1.831.046 ZAR	128.741 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(783)	(0,00)
4.666.832 ZAR	329.984 USD	19/07/2021	UBS AG	4	(3.854)	(0,00)
43.998.355 ZAR	3.142.332 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	48	(67.618)	(0,01)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(549.822)	(0,08)
					Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados					(549.822)	(0,08)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados					702.946.406	99,72
Otro activo neto					1.927.578	0,28
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables					704.873.984	100,00

Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

Análisis de la cartera	USD	% de los Activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	703.070.395	98,37
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(123.989)	(0,02)
Total inversiones	702.946.406	98,35

Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
475.000	Graphic Packaging Holding Co	8.179.148
3.400	Booking Holdings Inc	7.886.392
167.000	Aramark	6.366.899
85.000	Apollo Global Management Inc Class A	5.242.735
98.000	Brookfield Renewable Corp Class A	4.789.618
1.350	Amazon.com Inc	4.252.488
21.500	Walt Disney Co	3.916.704
70.000	Comcast Corp Class A	3.835.350
98.000	US Foods Holding Corp	3.766.144
1.500	Cable One Inc	2.715.078
31.500	Raytheon Technologies Corp	2.487.042
18.000	NIKE Inc Class B	2.410.308
13.000	Chubb Ltd	2.103.123
9.500	McDonald's Corp	2.026.325
43.400	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	1.907.914
24.000	Lamb Weston Holdings Inc	1.890.230
21.800	Ball Corp	1.872.400
14.700	Intercontinental Exchange Inc	1.657.213
27.000	Las Vegas Sands Corp	1.623.591
44.000	Pfizer Inc	1.600.660
61.100	Shoals Technologies Group Class A	1.527.500
6.000	Nordson Corp	1.222.723
20.000	Mondelez International Inc Class A	1.159.380
11.100	Progressive Corp	1.041.058
36.200	LegalZoom.com Inc	1.013.600
4.000	Microsoft Corp	940.022
9.900	Activision Blizzard Inc	920.183

Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (cont.)

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
196.600	Allison Transmission Holdings Inc	8.222.817
21.450	PayPal Holdings Inc	5.909.792
2.100	Alphabet Inc Class C	4.795.300
16.000	DocuSign Inc	4.045.146
73.965	Array Technologies Inc	3.621.548
79.900	Brookfield Asset Management Inc Class A	3.391.813
31.800	Columbia Sportswear Co	3.120.019
19.500	Apple Inc	2.580.745
7.900	WD-40 Co	2.410.117
48.300	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	2.276.250
19.600	Hill-Rom Holdings Inc	2.097.454
22.100	Activision Blizzard Inc	2.090.125
10.800	Motorola Solutions Inc	2.028.752
8.000	Microsoft Corp	1.901.340
61.100	Shoals Technologies Group Class A	1.874.792
9.000	HCA Healthcare Inc	1.758.450
6.200	Berkshire Hathaway Inc Class B	1.636.242
7.400	Lowe's Cos Inc	1.473.430
9.600	JPMorgan Chase & Co	1.389.705
36.200	LegalZoom.com Inc	1.368.461
27.000	Cisco Systems Inc	1.348.410
12.500	Ball Corp	1.117.276
19.200	Comcast Corp Class A	1.043.348
4.900	Stanley Black & Decker Inc	980.020
7.200	NIKE Inc Class B	979.220
10.100	CSX Corp	965.165
7.000	Eagle Materials Inc	852.100
8.500	Brunswick Corp	818.643
3.000	Rockwell Automation Inc	786.070

Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 21,50%. En el mismo periodo, el índice de referencia de la Cartera, el índice FTSE NAREIT All Equity REITs (Total Return, Net of Tax, USD) (el "Índice") se anotó una rentabilidad del 20,82%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso.)

El conjunto del mercado de valores estadounidenses generó sólidos resultados y alcanzó varios máximos históricos durante el periodo analizado. El mercado se vio favorecido por unos beneficios corporativos generalmente positivos, unos fuertes estímulos fiscales y monetarios, una sólida demanda de los inversores y una intensificación de la actividad económica a medida que avanzaba la campaña de vacunación contra la COVID-19. Estos factores compensaron con creces el aumento de la inflación, que la Reserva Federal estadounidense ("la Fed") calificó de transitorio en gran medida. En resumidas cuentas, el índice S&P 500 avanzó un 15,25% en el periodo del informe. En contraste, la rentabilidad del Índice durante el mismo periodo se situó en un 20,82%.

La Cartera superó al Índice durante el período analizado. Tanto la asignación sectorial como la selección de valores contribuyeron a la rentabilidad relativa de la Cartera. Desde la perspectiva de la selección de valores, las posiciones de la Cartera en los sectores de centros comerciales regionales, oficinas y atención sanitaria ofrecieron las mayores aportaciones a la rentabilidad. En cambio, las posiciones en los sectores de la madera, los centros de datos y artículos de lujo fueron las que más rentabilidad restaron. En términos de posicionamiento sectorial, la sobreponderación en centros comerciales regionales y autoalmacenamiento fue lo que más contribuyó a la rentabilidad. Por el extremo contrario destacaron una infraponderación en artículos de lujo y una pequeña posición en efectivo.

En nuestra opinión, la aprobación de varias vacunas contra la COVID-19 constituyó un punto de inflexión importante en la lucha contra la pandemia mundial y causó una fuerte repunte del mercado. A pesar de que podría ser pronto para decir que la crisis de la COVID-19 ha concluido en EE. UU., creemos que la vacunación de la mayoría de la población estadounidense mayor de 12 años aumenta la visibilidad de un entorno pospandemia y podría dar lugar a una recuperación sostenible del mercado. Los desafíos que plantea la variante Delta entre otras, muchas de ellas con una mayor capacidad de contagio, nos recuerdan que la incertidumbre y la volatilidad del mercado podrían persistir. El nivel excepcional de estímulos fiscales, la aceleración de la reapertura de la economía estadounidense y el posible aumento del gasto en infraestructuras han provocado un aumento de la inflación general. Sin embargo, los comentarios benévolos del Tesoro estadounidense y de la Fed han aliviado estos temores y cabe esperar que mantengan los tipos en niveles próximos a sus mínimos históricos. A más largo plazo, los datos de la política relacionados con el gasto deficitario, la política fiscal y el comercio mundial podrían mermar la confianza de los inversores. El aumento de la inflación se puede considerar positivo para los propietarios de activos inmobiliarios, dado que pueden beneficiarse de ello a través del aumento de los alquileres que cobran a los arrendatarios.

Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (cont.)

Balance

		A	A
	Nota	30 de junio de 2021	31 de diciembre de 2020
		USD	USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		653.003.132	349.110.328
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	3.383.676	4.303.446
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		1.636	-
Cuentas a percibir por acciones emitidas		16.023.079	2.638.623
Ingresos a percibir y otros activos		1.255.984	1.047.629
Activos totales		673.667.507	357.100.026
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		1.966.646	1.306.305
Descubierto bancario	3	37	-
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		3.220.383	2.141.815
Gastos devengados		988.286	622.577
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		9.564.107	6.102
Otras cuentas por pagar		73.773	65.760
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		15.813.232	4.142.559
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		657.854.275	352.957.467

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		122	9.481
Ingresos por dividendos		6.936.429	3.399.391
Ingresos varios		42.811	–
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		81.916.428	(32.740.614)
		88.895.790	(29.331.742)
Gastos			
Comisión de gestión	5	2.931.510	1.622.888
Comisión de distribución	5	515.485	263.102
Comisión de administración	5	444.257	337.536
Comisión de compromiso	16	24.866	17.358
Comisión de depósito	5	6.108	6.140
Comisión del Depositario	5	11.229	11.708
Honorarios profesionales	7	123.592	39.335
Honorarios de los Consejeros	6	994	2.380
Costes de transacciones	7	176.019	149.515
Honorarios de auditoría	7	13.185	11.926
Reembolso de IVA		(1.629)	(731)
Otros gastos	7	5.981	8.841
Gastos no asumidos	5	(47.778)	(170.866)
Gastos totales		4.203.819	2.299.132
Costes financieros			
Gastos por intereses		2.673	548
Repartos de dividendos abonados	1	1.583.496	906.635
		1.586.169	907.183
Impuestos retenidos en origen		1.037.834	893.968
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		82.067.968	(33.432.025)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	352.957.467	270.636.604
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	82.067.968	(33.432.025)
Suscripciones	423.334.378	157.866.891
Reembolsos	(200.505.538)	(164.502.881)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	657.854.275	230.568.589

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (cont.)

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 1,59% (31 de diciembre de 2020: 1,79%)			
Dólar estadounidense			
203.217	Brookfield Asset Management Inc Class A	10.360.003	1,58
1.393	Brookfield Asset Management Reinsurance Partners Ltd Class A	72.464	0,01
Total valores de renta variable *		10.432.467	1,59
Fondos de inversión inmobiliaria 97,52% (31 de diciembre de 2020: 95,91%)			
Dólar estadounidense			
238.844	American Homes 4 Rent Class A	9.279.089	1,41
225.922	American Tower Corp	61.030.569	9,28
262.067	Apartment Income REIT Corp	12.429.838	1,89
177.342	Boston Properties Inc	20.321.620	3,09
70.781	Camden Property Trust	9.390.515	1,43
244.513	Crown Castle International Corp	47.704.486	7,25
109.082	CyrusOne Inc	7.801.545	1,19
140.713	Digital Realty Trust Inc	21.171.678	3,22
343.001	Douglas Emmett Inc	11.531.694	1,75
274.581	Duke Realty Corp	13.001.410	1,98
48.615	Equinix Inc	39.018.399	5,93
220.763	Equity LifeStyle Properties Inc	16.404.899	2,49
430.200	Equity Residential	33.125.400	5,04
66.939	Essex Property Trust Inc	20.082.369	3,05
97.730	Extra Space Storage Inc	16.010.129	2,43
258.857	Four Corners Property Trust Inc	7.147.042	1,09
359.550	Healthcare Trust of America Inc Class A	9.599.985	1,46
472.759	Healthpeak Properties Inc	15.738.147	2,39
389.603	Host Hotels & Resorts Inc	6.658.315	1,01
383.917	Invitation Homes Inc	14.316.265	2,18
81.603	Kilroy Realty Corp	5.682.833	0,86
637.991	Kimco Realty Corp	13.302.112	2,02
131.054	National Retail Properties Inc	6.143.812	0,93
194.465	Omega Healthcare Investors Inc	7.057.135	1,07
333.325	Prologis Inc	39.842.337	6,06
105.611	Public Storage	31.756.172	4,83
194.541	Regency Centers Corp	12.464.242	1,89
366.797	Retail Opportunity Investments Corp	6.477.635	0,98
174.175	Rexford Industrial Realty Inc	9.919.266	1,51
54.341	SBA Communications Corp Class A	17.318.477	2,63
184.429	Simon Property Group Inc	24.064.296	3,66
162.028	Spirit Realty Capital Inc	7.751.420	1,18

Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (cont.)

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
Fondos de inversión inmobiliaria 97,52% (31 de diciembre de 2020: 95,91%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
58.085	Sun Communities Inc	9.955.769	1,51
314.969	VICI Properties Inc	9.770.338	1,48
119.432	Vornado Realty Trust	5.573.891	0,85
299.094	Welltower Inc	24.854.711	3,78
519.315	Weyerhaeuser Co	17.874.822	2,72
Total fondos de inversión inmobiliaria *		641.572.662	97,52
Total inversiones		652.005.129	99,11

Contratos de divisas a plazo 0,15% (31 de diciembre de 2020: 1,21%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases AUD con cobertura						
402.719 AUD	301.767 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	599	0,00
792.283 USD	1.036.950 AUD	19/07/2021	Goldman Sachs International	5	13.726	0,00
476.373 USD	616.404 AUD	19/07/2021	UBS AG	1	13.568	0,00
3.342.392 USD	4.315.526 AUD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	49	102.237	0,02
Clases CHF con cobertura						
51.606 CHF	55.763 USD	19/07/2021	UBS AG	1	92	0,00
218.889 USD	199.304 CHF	19/07/2021	Goldman Sachs International	5	3.174	0,00
45.333 USD	41.716 CHF	19/07/2021	UBS AG	2	182	0,00
429.479 USD	392.680 CHF	19/07/2021	Westpac Banking Corp	5	4.465	0,00
Clases EUR con cobertura						
52.446 €	62.216 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	3	0,00
2.639.587 USD	2.199.855 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	29.840	0,00
2.018.010 USD	1.685.704 €	19/07/2021	UBS AG	3	18.214	0,00
11.274.110 USD	9.366.910 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	46	161.892	0,02
Clases HKD con cobertura						
570.485 HKD	73.369 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	95	0,00
7.529.947 HKD	969.334 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	9	323	0,00
147.060 USD	1.141.709 HKD	19/07/2021	UBS AG	3	38	0,00
368.398 USD	2.859.519 HKD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	16	168	0,00
Clases SGD con cobertura						
10.972 SGD	8.158 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	4	0,00
1.155 SGD	859 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	0	0,00
8.949 USD	12.001 SGD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	22	0,00
3.435 USD	4.614 SGD	19/07/2021	UBS AG	1	2	0,00
88.430 USD	118.248 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	20	465	0,00

Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,15% (31 de diciembre de 2020: 1,21%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases ZAR con cobertura						
540.601 USD	7.707.936 ZAR	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	1.951	0,00
915.079 USD	12.971.565 ZAR	19/07/2021	UBS AG	2	8.594	0,00
5.644.144 USD	78.259.103 ZAR	19/07/2021	Westpac Banking Corp	34	175.204	0,03
72.835.902 ZAR	4.981.596 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	4	108.359	0,02
82.643.675 ZAR	5.658.265 USD	19/07/2021	UBS AG	5	117.082	0,02
225.720.682 ZAR	15.536.219 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	31	237.704	0,04
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					998.003	0,15
					Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados					653.003.132	99,26

Pasivo financiero al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,30%) (31 de diciembre de 2020: (0,37%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases AUD con cobertura						
5.949.139 AUD	4.577.271 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	9	(110.574)	(0,02)
4.808.474 AUD	3.697.937 USD	19/07/2021	UBS AG	4	(87.668)	(0,02)
15.435.824 AUD	11.877.050 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	72	(287.620)	(0,05)
789 USD	1.054 AUD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(2)	(0,00)
Clases CHF con cobertura						
1.103.602 CHF	1.206.344 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	12	(11.872)	(0,00)
851.887 CHF	926.129 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(4.097)	(0,00)
921.842 CHF	1.003.329 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	6	(5.580)	(0,00)
Clases EUR con cobertura						
24.428.841 €	29.394.294 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	12	(413.703)	(0,06)
16.528.731 €	19.811.113 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(202.635)	(0,03)
33.602.187 €	40.471.165 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	69	(607.985)	(0,09)
Clases HKD con cobertura						
5.525.480 HKD	711.750 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	6	(214)	(0,00)
6.398.752 HKD	824.144 USD	19/07/2021	UBS AG	10	(154)	(0,00)
27.524.998 HKD	3.546.095 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	37	(1.598)	(0,00)
54.392 USD	422.472 HKD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(11)	(0,00)
113.250 USD	879.654 HKD	19/07/2021	UBS AG	2	(26)	(0,00)
1.286 USD	10.000 HKD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(2)	(0,00)

Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (0,30%) (31 de diciembre de 2020: (0,37%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases SGD con cobertura						
66.222 SGD	49.590 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	10	(327)	(0,00)
53.549 SGD	40.098 USD	19/07/2021	UBS AG	3	(263)	(0,00)
525.699 SGD	395.324 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	50	(4.254)	(0,00)
35.438 USD	47.659 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	(14)	(0,00)
Clases ZAR con cobertura						
553.002 USD	7.943.555 ZAR	19/07/2021	UBS AG	2	(2.113)	(0,00)
1.082.641 USD	15.719.717 ZAR	19/07/2021	Westpac Banking Corp	18	(15.890)	(0,00)
14.523.038 ZAR	1.053.407 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	(38.501)	(0,01)
12.121.374 ZAR	867.269 USD	19/07/2021	UBS AG	4	(20.197)	(0,00)
116.713.312 ZAR	8.307.563 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	39	(151.346)	(0,02)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(1.966.646)	(0,30)
					Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados					(1.966.646)	(0,30)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados					651.036.486	98,96
Otro activo neto					6.817.789	1,04
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables					657.854.275	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					652.005.129	96,78
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC					(968.643)	(0,14)
Total inversiones					651.036.486	96,64

Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
100.091	American Tower Corp	24.273.205
95.307	Crown Castle International Corp	17.183.735
21.699	Equinix Inc	15.561.836
129.923	Prologis Inc	14.713.761
132.983	Simon Property Group Inc	14.638.401
167.687	Equity Residential	12.322.978
41.167	Public Storage	11.154.751
153.643	Equity LifeStyle Properties Inc	10.202.761
319.757	VICI Properties Inc	9.470.077
116.583	Welltower Inc	8.728.663
54.850	Digital Realty Trust Inc	8.082.717
69.125	Boston Properties Inc	7.576.421
26.109	Essex Property Trust Inc	7.479.752
202.425	Weyerhaeuser Co	7.363.479
368.871	Retail Opportunity Investments Corp	6.392.508
21.194	SBA Communications Corp Class A	6.154.726
184.275	Healthpeak Properties Inc	6.028.926
121.247	Vornado Realty Trust	5.777.599
82.843	Kilroy Realty Corp	5.691.200
38.094	Extra Space Storage Inc	5.508.707
149.650	Invitation Homes Inc	5.110.609
248.689	Kimco Realty Corp	5.019.958
107.426	Duke Realty Corp	4.809.518
75.829	Regency Centers Corp	4.645.176
102.148	Apartment Income REIT Corp	4.588.493
133.699	Douglas Emmett Inc	4.477.552
140.148	Healthcare Trust of America Inc Class A	3.931.509
268.862	Macerich Co	3.920.105
22.673	Sun Communities Inc	3.687.224
79.326	Brookfield Asset Management Inc Class A	3.684.305
67.891	Rexford Industrial Realty Inc	3.679.096
93.102	American Homes 4 Rent Class A	3.335.695
27.587	Camden Property Trust	3.315.520
42.581	CyrusOne Inc	3.017.787
63.158	Spirit Realty Capital Inc	2.897.095
100.900	Four Corners Property Trust Inc	2.829.418
75.802	Omega Healthcare Investors Inc	2.813.711
60.460	National Retail Properties Inc	2.749.924

Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (cont.)

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
102.127	Simon Property Group Inc	11.384.052
268.862	Macerich Co	4.879.039
107.954	Highwoods Properties Inc	4.621.202
303.833	Host Hotels & Resorts Inc	4.366.913
82.002	National Retail Properties Inc	3.528.059
83.826	Duke Realty Corp	3.262.605
6.549	American Tower Corp	1.496.714
5.658	Essex Property Trust Inc	1.398.121
7.402	Crown Castle International Corp	1.219.982
4.233	SBA Communications Corp Class A	1.133.789
28.625	Brookfield Asset Management Inc Class A	1.127.262
7.831	Sun Communities Inc	1.114.402
15.436	CyrusOne Inc	1.086.408
10.091	Prologis Inc	1.049.883
1.407	Equinix Inc	979.277
13.024	Equity Residential	878.496
167.090	Apartment Investment & Management Co Class A	820.581
3.198	Public Storage	769.087
9.056	Welltower Inc	613.756
4.260	Digital Realty Trust Inc	596.261
15.724	Weyerhaeuser Co	546.007
5.370	Boston Properties Inc	527.547

Neuberger Berman China Equity Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 8,52%. En el mismo período, el índice de referencia, el índice MSCI China Net (Total Return, USD) (el "Índice") rindió un 1,83% (los datos de rentabilidad citados representan rentabilidades pasadas y no son indicativos de resultados futuros). La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

De cara a 2021, los mercados de renta variable china arrancaron con un fuerte repunte gracias al aumento de la inversión de los hogares domésticos, tal y como se pone de manifiesto por las entradas de capital sin precedentes de los fondos de inversión nacionales y por los niveles máximos de flujos hacia el mercado de Hong Kong (southbound). El sentimiento de los inversores también mejoró ante las expectativas de recuperación mundial alimentadas por el lanzamiento de las vacunas contra la COVID y por los nuevos estímulos aprobados en EE. UU. por la Administración Biden. Los mercados continuaron repuntando a comienzos de febrero, debido sobre todo a unos datos macroeconómicos que apuntaban a que la recuperación china iba por buen camino, a los planes de MSCI de incluir los títulos del Consejo STAR en su revisión de mayo y a varias OPV y acuerdos de colocación concluidos con éxito. Tras las vacaciones del Año Nuevo chino, tanto el mercado nacional como el extraterritorial experimentaron una fuerte corrección cuando los inversores recogieron beneficios de forma masiva de sus acciones de crecimiento y sobrevaloradas para reasignarlos a estrategias temáticas reflacionistas tras la aceleración de la campaña de vacunación contra la COVID-19. Esta venta masiva se intensificó todavía más hacia finales de mes, después de que la rentabilidad del bono del Tesoro a 10 años de referencia alcanzase sus niveles máximos en más de un año. Las "dos sesiones" de marzo no sorprendieron demasiado, pero China fijó un objetivo de crecimiento del PIB superior al 6% durante la reunión del Congreso Nacional Popular ("CNP"). Los títulos de valor repuntaron gracias al optimismo desatado por las perspectivas de crecimiento mundial y los nuevos estímulos fiscales aprobados en EE. UU. El objetivo de neutralidad climática de China también elevó los precios de las materias primas, pero los mercados retrocedieron durante el mes debido a que los ADR estadounidenses experimentaron presiones ante el potencial riesgo de que se retiren de la cotización.

Las acciones chinas se anotaron buenos resultados a comienzos de abril, después de que el presidente estadounidense Biden presentase un paquete de estímulos por valor de 2,25 billones de dólares y el Consejo de Estado anunciase profundas rebajas de impuestos para apoyar a la empresa privada. Sin embargo, el sentimiento de los inversores se deterioró posteriormente como consecuencia del impago de los bonos de Huarong Asset Management y de las repercusiones reguladoras resultantes de constantes investigaciones antimonopolio sobre empresas de Internet chinas. No obstante, los mercados avanzaron durante el mes gracias al sólido crecimiento del PIB durante el primer trimestre, a unos beneficios empresariales positivos y a los signos de sólido rebote del gasto de los consumidores. Los mercados de renta variable china experimentaron una corrección en mayo debido a que la preocupación mundial por la inflación dio lugar a una corriente de ventas de acciones extranjeras, a un endurecimiento de la reglamentación y supervisión de materias primas nacionales sobrecalentadas y a la persistente batalla contra las prácticas monopolísticas. Más avanzado el mes, tanto el mercado nacional como el extraterritorial demostraron resiliencia: el mercado de acciones A se benefició de una abundante liquidez, el yuan cotizó a sus niveles máximos en tres años y Stock Connect registró los mayores flujos de capital en sentido norte de la historia. Los mercados se consolidaron en junio después de que el gobierno central anunciase medidas para frenar el repunte del RMB y el aumento de precios de las materias primas, y el sentimiento de los inversores se deterioró a consecuencia de una nueva orden ejecutiva estadounidense para prohibir inversiones en 59 empresas chinas e imponer restricciones comerciales sobre determinadas empresas de energía solar por acusaciones de trabajo forzoso. Hacia finales de mes, la publicación del Banco Popular de China ("PBoC") acalló las especulaciones de problemas de liquidez y la entidad retomó las inyecciones diarias mediante operaciones de mercado abierto.

Durante el primer semestre de 2021, entre los sectores que más contribuyeron a la rentabilidad de la Cartera en comparación con su índice de referencia se incluyeron los materiales (sobreponderación significativa y selección de valores, en particular en productos químicos y materiales de construcción), la atención sanitaria (sobreponderación y selección de valores en productos farmacéuticos y biotecnología) y tecnología de la información (infraponderación significativa y selección de valores en equipos electrónicos, instrumentos y componentes). Entre los sectores que más lastraron la rentabilidad relativa en comparación con el índice de referencia se incluyeron los de consumo discrecional (selección de valores, principalmente en productos domésticos no perecederos, comercio minorista en establecimientos físicos y por Internet, y textiles, moda y artículos de lujo), consumo básico (sobreponderación) y energía (infraponderación).

A 30 de junio de 2021, la mayor infraponderación sectorial de la Cartera con respecto al índice de referencia era la mantenida en servicios de comunicaciones y la mayor sobreponderación sectorial era la de materiales. La Cartera tenía también posiciones infraponderadas en los sectores de consumo discrecional y tecnología de la información, y sobreponderadas en industria y atención sanitaria. Las 10 principales posiciones de la Cartera representaban más del 54% de los activos totales a finales de junio.

En China, los indicadores económicos dibujaron una imagen heterogénea de la recuperación en el segundo trimestre de 2021. Las estimaciones medias sitúan el crecimiento del PIB del trimestre en el 8% interanual. La producción industrial se mantiene en niveles elevados en comparación con 2019 y el crecimiento de las ventas minoristas siguió recuperándose, aunque por debajo de las expectativas del mercado. El mercado también se benefició de una sólida recuperación de los servicios de consumo y las ventas por Internet. Por otra parte, el índice de gestores de compras de manufacturas cayó en junio y el crecimiento de la inversión en activos fijos se ralentizó en parte debido a un elevado efecto de base. Habida cuenta del avance de la recuperación económica, es posible que los responsables políticos vayan normalizando de forma gradual tanto la política monetaria como la fiscal en 2021. Después del giro restrictivo episódico en materia de política económica observado entre enero y febrero, el PBoC mantuvo una postura neutral desde marzo hasta mayo. Aparte de esto, el banco central aumentó el coeficiente de reservas obligatorias para depósitos en moneda extranjera en un 2% con efecto a partir del 15 de junio, con vistas a frenar la apreciación del RMB y el aumento de precios de las materias primas. Con independencia de lo anterior, es posible que la solidez de la cadena de suministro china

Neuberger Berman China Equity Fund

Informe del Gestor de inversiones

logre compensar la inflación. Dado el elevado nivel de base de las exportaciones relacionadas con la pandemia en 2020, es probable que el crecimiento interanual se ralentice en el segundo semestre del año, aunque prevemos un sólido crecimiento en el conjunto del ejercicio 2021.

China publicó los resultados de su séptimo censo nacional en mayo, con un repunte del envejecimiento de su población. En concreto, la población activa se contrajo en la última década y probablemente se reducirá aún más cuando la población china alcance su punto máximo en la próxima década. El posible descenso resultante de la mano de obra podría ralentizar el crecimiento del PIB y ejercer presión sobre los fondos de la seguridad social. Para contrarrestar esta tendencia, es posible que el gobierno trate de aumentar gradualmente la edad de jubilación para adaptarla a la esperanza de vida y a los cambios demográficos. Con el gasto público centrado en áreas como la educación, el empleo, la salud pública y el bienestar social, se prevé una transferencia constante de recursos laborales de las zonas rurales a las urbanas, así como un giro continuo de la productividad agrícola a la no agrícola para fomentar el crecimiento anual futuro del PIB. Habida cuenta de las tendencias demográficas dominantes, cabría esperar un descenso controlado de los sectores intensivos en mano de obra y una aceleración del crecimiento en los sectores de la automatización, la robótica y la digitalización en China. Al mismo tiempo, los patrones de gasto se inclinarán por los servicios de consumo, en particular por lo que respecta a la atención sanitaria, los seguros, la planificación fiscal y la atención a edades avanzadas. Las tendencias anteriormente mencionadas presentan diversas oportunidades estructurales a largo plazo que están representadas en la Cartera.

Neuberger Berman China Equity Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		683.884.119	701.912.795
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	24.036.850	12.354.044
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		2.568.568	7.227.762
Ingresos a percibir y otros activos		1.182.645	—
Activos totales		711.672.182	721.494.601
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		218.645	452.722
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		506.401	74.319
Gastos devengados		895.738	896.476
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		16	7.201.203
Otras cuentas por pagar		93.148	63.166
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		1.713.948	8.687.886
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		709.958.234	712.806.715

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman China Equity Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		–	35.736
Ingresos por dividendos		7.927.477	10.932.680
Ingresos varios		26.370	–
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		58.626.787	(43.223.848)
		66.580.634	(32.255.432)
Gastos			
Comisión de gestión	5	4.617.584	4.584.249
Comisión de distribución	5	255.969	187.151
Comisión de administración	5	265.168	365.105
Comisión de compromiso	16	52.463	42.421
Comisión de depósito	5	85.949	107.573
Comisión del Depositario	5	18.355	36.595
Honorarios profesionales	7	75.835	49.938
Honorarios de los Consejeros	6	1.938	2.380
Costes de transacciones	7	517.292	1.051.316
Honorarios de auditoría	7	9.549	9.781
Reembolso de IVA		(3.421)	(2.592)
Otros gastos	7	9.667	36.140
Gastos totales		5.906.348	6.470.057
Costes financieros			
Gastos por intereses		37	379
Repartos de dividendos abonados	1	7.669	30.258
		7.706	30.637
Impuestos retenidos en origen		532.216	683.844
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		60.134.364	(39.439.970)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Neuberger Berman China Equity Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	712.806.715	858.685.014
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	60.134.364	(39.439.970)
Suscripciones	81.971	6.097
Reembolsos	(63.064.816)	(144.310.762)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	709.958.234	674.940.379

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman China Equity Fund (cont.)

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 96,31% (31 de diciembre de 2020: 98,35%)			
Yuan renminbi chino			
438.600	Eve Energy Co Ltd Class A	7.055.372	0,99
5.250.000	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai Class A	42.335.761	5,96
3.500.000	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A	19.951.709	2,81
11.500.083	Jiangsu Eastern Shenghong Co Ltd Class A	37.201.256	5,24
1.500.054	JL Mag Rare-Earth Co Ltd Class A	7.343.725	1,03
1.250.072	Midea Group Co Ltd Class A	13.808.963	1,95
998.200	Yunnan Energy New Material Co Ltd Class A	36.168.402	5,10
3.500.225	Zhejiang Satellite Petrochemical Co Ltd Class A	21.231.543	2,99
15.000.003	Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co Ltd Class A	21.452.290	3,02
Total yuan renminbi chino		206.549.021	29,09
Dólar de Hong Kong			
2.000.000	Akeso Inc	16.134.744	2,27
1.750.000	Alibaba Group Holding Ltd	49.576.028	6,98
563.400	CanSino Biologics Inc - H Shares	29.933.470	4,22
5.000.000	China Merchants Bank Co Ltd - H Shares	42.654.700	6,01
30.000.000	China National Building Material Co Ltd - H Shares	35.231.172	4,96
8.500.000	China Pacific Insurance Group Co Ltd - H Shares	26.761.398	3,77
1.750.000	China Resources Beer Holdings Co Ltd	15.717.855	2,21
7.000.000	China Resources Land Ltd	28.348.474	3,99
18.000.000	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	32.217.980	4,54
23.300.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	33.723.546	4,75
7.500.000	Haier Smart Home Co Ltd - H Shares	26.172.280	3,69
550.000	JD.com Inc Class A	21.629.313	3,05
474.600	New Oriental Education & Technology Group Inc	3.911.278	0,55
1.000.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H Shares	9.792.875	1,38
500.000	Shenzhou International Group Holdings Ltd	12.625.791	1,78
1.250.000	Smoore International Holdings Ltd	6.929.377	0,98
400.000	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	12.639.956	1,78
550.000	Tencent Holdings Ltd	41.360.572	5,83
14.326.000	Weichai Power Co Ltd - H Shares	31.840.270	4,48
Total dólar de Hong Kong		477.201.079	67,22
Total valores de renta variable *		683.750.100	96,31
Total inversiones		683.750.100	96,31

Neuberger Berman China Equity Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,02% (31 de diciembre de 2020: 0,12%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases CHF con cobertura						
63.996 USD	58.298 CHF	19/07/2021	Goldman Sachs International	9	897	0,00
8.867 USD	8.028 CHF	19/07/2021	UBS AG	2	178	0,00
44.981 USD	40.945 CHF	19/07/2021	Westpac Banking Corp	8	666	0,00
Clases EUR con cobertura						
2.953.420 USD	2.461.216 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	7	33.613	0,01
2.718.758 USD	2.269.007 €	19/07/2021	UBS AG	4	26.974	0,00
3.020.558 USD	2.517.360 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	38	34.146	0,01
Clases GBP con cobertura						
311.670 £	429.000 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	1.579	0,00
324.290 £	446.419 USD	19/07/2021	UBS AG	3	1.594	0,00
298.197 £	410.331 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	1.634	0,00
14.345 USD	10.136 £	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	342	0,00
57.996 USD	41.421 £	19/07/2021	UBS AG	3	773	0,00
128.341 USD	91.654 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	10	1.720	0,00
Clases HKD con cobertura						
20.248 HKD	2.602 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	6	0,00
32.014 HKD	4.120 USD	19/07/2021	UBS AG	2	2	0,00
18.459 HKD	2.377 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
265.186 USD	2.058.836 HKD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	62	0,00
281.213 USD	2.183.474 HKD	19/07/2021	UBS AG	7	39	0,00
269.009 USD	2.088.637 HKD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	5	46	0,00
Clases SGD con cobertura						
3 SGD	2 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	0	0,00
1.811.740 USD	2.422.535 SGD	19/07/2021	Goldman Sachs International	7	9.601	0,00
1.676.354 USD	2.241.925 SGD	19/07/2021	UBS AG	2	8.572	0,00
1.990.518 USD	2.660.204 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	25	11.575	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					134.019	0,02
					Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados					683.884.119	96,33

Neuberger Berman China Equity Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,03%) (31 de diciembre de 2020: (0,06%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases CHF con cobertura						
219.722 CHF	239.399 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	7	(1.585)	(0,00)
204.600 CHF	222.661 USD	19/07/2021	UBS AG	4	(1.214)	(0,00)
226.477 CHF	246.681 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	7	(1.556)	(0,00)
3.805 USD	3.520 CHF	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(5)	(0,00)
Clases EUR con cobertura						
4.337.613 €	5.203.021 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	7	(57.196)	(0,01)
4.343.487 €	5.208.039 USD	19/07/2021	UBS AG	5	(55.243)	(0,01)
4.181.689 €	5.013.101 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	14	(52.251)	(0,01)
36.285 USD	30.597 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(13)	(0,00)
Clases GBP con cobertura						
68.566 £	95.946 USD	19/07/2021	UBS AG	5	(1.221)	(0,00)
83.507 £	117.427 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	7	(2.061)	(0,00)
18.891 USD	13.740 £	19/07/2021	UBS AG	1	(91)	(0,00)
26.589 USD	19.312 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	(92)	(0,00)
Clases HKD con cobertura						
2.576.728 HKD	331.892 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(78)	(0,00)
2.767.772 HKD	356.470 USD	19/07/2021	UBS AG	10	(53)	(0,00)
2.590.352 HKD	333.625 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	(56)	(0,00)
1.073 USD	8.334 HKD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(0)	(0,00)
11.138 USD	86.529 HKD	19/07/2021	UBS AG	5	(5)	(0,00)
3.030 USD	23.547 HKD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(2)	(0,00)
Clases SGD con cobertura						
3.758.087 SGD	2.811.204 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	6	(15.538)	(0,00)
3.623.276 SGD	2.709.558 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(14.179)	(0,00)
4.027.840 SGD	3.012.520 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	14	(16.183)	(0,00)
39.639 USD	53.316 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	(23)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(218.645)	(0,03)
					Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados					(218.645)	(0,03)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados					683.665.474	96,30
Otro activo neto					26.292.760	3,70
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables					709.958.234	100,00

Neuberger Berman China Equity Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

Análisis de la cartera	USD	% de los Activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	683.750.100	96,07
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(84.626)	(0,01)
Total inversiones	683.665.474	96,06

Neuberger Berman China Equity Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

Total compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
11.500.083	Jiangsu Eastern Shenghong Co Ltd Class A	25.842.685
2.100.000	China Pacific Insurance Group Co Ltd - H Shares	9.732.049
52.503	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	9.471.788
4.999.986	Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co Ltd Class A	9.025.920
700.000	New Oriental Education & Technology Group Inc	8.079.484
1.000.000	China Merchants Bank Co Ltd - H Shares	7.994.642
1.250.000	Smoores International Holdings Ltd	7.355.519
5.800.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	6.226.649
438.600	Eve Energy Co Ltd Class A	6.172.008
1.500.054	JL Mag Rare-Earth Co Ltd Class A	6.038.660
20.000	New Oriental Education & Technology Group Inc	3.503.371
250.100	Midea Group Co Ltd Class A	3.102.198
500.000	Akeso Inc	2.849.019
25.000	Tencent Holdings Ltd	2.025.888
250.000	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A	1.599.740
26.400	CanSino Biologics Inc - H Shares	993.453

Neuberger Berman China Equity Fund (cont.)

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
84.932	Kweichow Moutai Co Ltd Class A	28.336.616
1.100.000	Shenzhou International Group Holdings Ltd	24.390.051
471.300	Alibaba Group Holding Ltd	14.312.994
125.000	Tencent Holdings Ltd	11.680.874
5.000.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	9.922.377
3.674.000	Weichai Power Co Ltd - H Shares	9.551.643
13.736.000	China Everbright Environment Group Ltd	9.155.031
10.000.000	Brilliance China Automotive Holdings Ltd	8.921.990
1.025.400	New Oriental Education & Technology Group Inc	8.283.695
750.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H Shares	7.765.663
8.000.000	CIFI Holdings Group Co Ltd	7.085.813
525.030	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	7.058.608
1.500.000	Minth Group Ltd	6.880.751
750.000	China Merchants Bank Co Ltd - H Shares	6.043.852
2.499.935	New Hope Liuhe Co Ltd Class A	5.957.203
7.245.000	China Overseas Property Holdings Ltd	4.752.484
450.000	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai Class A	4.046.878
500.000	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A	3.896.357
63.000	CanSino Biologics Inc - H Shares	3.135.256
1.500.000	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	2.607.869
1.700.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	2.588.694

Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 5,65%. En el mismo período, el índice de referencia, el MSCI Emerging Markets Index (Total Return, Net of Tax, USD) (el "Índice"), registró una rentabilidad del 7,45%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

La renta variable de mercados emergentes ("ME") avanzó durante el periodo analizado, favorecida por la recuperación de la economía mundial. Sin embargo, la renta variable de ME se situó a la zaga de su homóloga de mercados desarrollados, debido sobre todo al impacto de variantes nuevas y más contagiosas de la COVID-19 en determinados países, así como a los cambios de reglamentación y a los posibles giros políticos en China. Las acciones de momentum continuaron dominando en los ME durante el periodo, tal y como venían haciendo desde marzo de 2020.

Por sectores, destacaron los de materiales, industria y energía, como resultado de la apuesta de los inversores por los valores cíclicos durante la reapertura de las economías. En el caso de la energía, el aumento previsto de la demanda concurrió con la decisión de la Organización de Países Exportadores de Petróleo ("OPEP+") de no aumentar la oferta. El sector inmobiliario retrocedió ligeramente a consecuencia de la preocupación por los cambios de política de China, y los sectores de consumo básico y discrecional también se situaron a la zaga, en el caso de este último con varios cambios de política que afectaron a Internet.

Por países, las economías impulsadas por el petróleo de Arabia Saudí y los Emiratos Árabes Unidos se anotaron los mejores resultados del periodo, seguidas de la República Checa. Turquía, Colombia y Perú fueron los que más retrocedieron.

Nuestro enfoque de inversión disciplinado perjudicó ligeramente a los resultados en el contexto de mercado dominado por el factor momentum de este periodo, dado que las valoraciones son una parte importante de nuestra estrategia a largo plazo. La cartera se anotó una rentabilidad inferior a la del Índice en los sectores de consumo discrecional, tecnología de la información ("TI") e inmobiliario. A pesar de que la asignación sectorial realizó una pequeña contribución positiva y de que nuestras posiciones en atención sanitaria, energía y materiales generaron una rentabilidad superior, esto no bastó para compensar esa diferencia relativa.

Por países, las posiciones en la India y Malasia, así como una inversión en Kazajstán —ausente en el Índice— fueron las que más contribuyeron a la rentabilidad relativa, mientras que las posiciones en Taiwán, Brasil y Corea lastraron los resultados.

El equipo, que aplica un enfoque bottom-up, sigue centrado en la rentabilidad y las tendencias del flujo de efectivo a más largo plazo de las empresas en Cartera. China representa en estos momentos nuestra principal infraponderación, tras la revisión y venta de varias posiciones que habían generado una rentabilidad inferior. La India sigue representando nuestra principal sobreponderación, después de que el equipo consolidase algunas posiciones pequeñas en empresas de alta convicción y recortase la exposición a aquellas que se habían aproximado a sus objetivos de precios.

Consumo discrecional sigue representando nuestra principal infraponderación, mientras que TI sustituyó a consumo básico en tanto que principal sobreponderación después de que el equipo aumentase la exposición a empresas de componentes y servicios que ofrecían precios más atractivos.

De cara al futuro, preveemos que el ruido que ha persistido durante todo este periodo en los ME —reaperturas y repuntes relacionados con la COVID-19, temor a la inflación, tipos de interés del dólar estadounidense y cambios de política del gobierno chino— continuará. Esta incertidumbre ha llevado a los inversores a apostar por las acciones de momentum y, en particular en los mercados asiáticos, por las inversiones temáticas.

Sin embargo, el liderazgo tanto en materia temática (las empresas del sector de la automoción chinas sustituyeron a los títulos de Internet, por ejemplo) como por lo que respecta a las acciones de momentum ha cambiado rápidamente en los últimos meses. Teniendo en cuenta las valoraciones, estas áreas parecen especulativas y posiblemente predispuestas a experimentar una corrección.

Nuestro equipo, en lugar de centrarse en las fluctuaciones de precios a corto plazo y en los titulares sobre acontecimientos recientes, continúa elaborando sus planes a más largo plazo, al considerar que el crecimiento positivo en todo el mundo promueve un aumento de la rentabilidad de los ME a medio plazo.

A pesar de los obstáculos relativos a corto plazo, el equipo sigue creyendo que nuestra exposición diversificada, que apuesta por empresas domésticas junto con proveedores de tecnología diferenciados al servicio de los consumidores de todo el mundo, puede ofrecer una fuerte rentabilidad ajustada por riesgo a largo plazo y ayudar a los inversores a afrontar cualquier ruido a corto plazo que pueda surgir.

Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		535.800.395	484.025.723
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	12.342.027	8.080.406
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		401.988	280.655
Cuentas a percibir por acciones emitidas		699.714	1.094.034
Ingresos a percibir y otros activos		582.841	839.426
Activos totales		549.826.965	494.320.244
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		537.755	1.018.184
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		815.300	1.524.677
Gastos devengados		754.911	657.692
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		248.548	316.340
Otras cuentas por pagar		2.672.295	2.120.013
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		5.028.809	5.636.906
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		544.798.156	488.683.338

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		504	41.821
Ingresos por dividendos		3.997.942	3.881.042
Ingresos por préstamo de valores	15	975	6.661
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		28.915.091	(49.841.465)
		32.914.512	(45.911.941)
Gastos			
Comisión de gestión	5	3.358.796	2.314.185
Comisión de distribución	5	683.656	349.738
Comisión de administración	5	280.277	284.478
Comisión de compromiso	16	27.470	21.623
Comisión de depósito	5	96.040	98.299
Comisión del Depositario	5	13.444	19.564
Honorarios profesionales	7	80.217	49.362
Honorarios de los Consejeros	6	1.934	2.380
Costes de transacciones	7	725.787	588.360
Honorarios de auditoría	7	10.838	15.490
Reembolso de IVA		(2.395)	(1.340)
Otros gastos	7	27.290	23.647
Gastos no asumidos	5	–	(5.883)
Gastos totales		5.303.354	3.759.903
Costes financieros			
Gastos por intereses		2.473	186
Repartos de dividendos abonados	1	375.182	577.940
		377.655	578.126
Impuestos retenidos en origen		420.373	400.332
Impuesto sobre las plusvalías		1.407.586	(530.191)
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		25.405.544	(50.120.111)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	488.683.338	450.664.252
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	25.405.544	(50.120.111)
Suscripciones	135.536.430	117.829.401
Reembolsos	(104.827.156)	(125.584.673)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	544.798.156	392.788.869

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (cont.)

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 98,26% (31 de diciembre de 2020: 97,63%)			
Real brasileño			
1.916.793	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao*	6.425.154	1,18
662.981	Banco Bradesco SA - Preferred Shares*	3.399.564	0,62
1.647.031	CSN Mineracao SA*	3.006.627	0,55
493.709	Energisa SA*	4.584.999	0,84
118.832	Natura & Co Holding SA*	1.343.709	0,25
133.968	Petrobras Distribuidora SA*	712.310	0,13
	Total real brasileño	19.472.363	3,57
Dólar canadiense			
182.146	Parex Resources Inc**	3.044.837	0,56
	Total dólar canadiense	3.044.837	0,56
Yuan renminbi chino			
1.707.478	Beijing Sinnet Technology Co Ltd Class A*	3.802.999	0,70
1.639.633	Fujian Green Pine Co Ltd Class A*	5.354.753	0,98
5.251.968	Jiangsu Changshu Rural Commercial Bank Co Ltd Class A*	5.039.925	0,93
11.886	Kweichow Moutai Co Ltd Class A*	3.783.703	0,69
285.000	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A*	2.029.145	0,37
398.988	NARI Technology Co Ltd Class A*	1.435.180	0,26
2.413.488	Poly Developments & Holdings Group Co Ltd Class A*	4.497.612	0,83
1.006.264	Sichuan Kelun Pharmaceutical Co Ltd Class A*	3.107.171	0,57
225.534	Suofeiya Home Collection Co Ltd Class A*	844.769	0,16
108.691	Wingtech Technology Co Ltd Class A*	1.630.150	0,30
1.901.203	WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd Class A*	4.552.282	0,84
837.304	Xianhe Co Ltd Class A*	4.924.670	0,90
583.360	Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd Class A*	5.064.452	0,93
2.289.656	Zhejiang Juhua Co Ltd Class A*	3.132.801	0,57
	Total yuan renminbi chino	49.199.612	9,03
Euro			
166.846	InPost SA*	3.349.024	0,62
	Total euro	3.349.024	0,62
Dólar de Hong Kong			
1.109.624	Alibaba Group Holding Ltd*	31.434.715	5,77
1.277.000	A-Living Smart City Services Co Ltd*	6.355.525	1,17
311.500	ASM Pacific Technology Ltd*	4.219.731	0,77
657.800	China Gas Holdings Ltd*	2.007.489	0,37

Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (cont.)

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 98,26% (31 de diciembre de 2020: 97,63%) (cont.)			
Dólar de Hong Kong (cont.)			
1.112.000	China Merchants Bank Co Ltd - H Shares*	9.486.405	1,74
5.178.000	Greentown Management Holdings Co Ltd*	3.593.866	0,66
324.450	JD.com Inc Class A*	12.759.328	2,34
135.600	Kuaishou Technology Class B*	3.401.415	0,62
1.091.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H Shares*	10.688.923	1,96
510.600	Tencent Holdings Ltd*	38.397.651	7,05
353.000	Tsingtao Brewery Co Ltd - H Shares*	3.800.074	0,70
	Total dólar de Hong Kong	126.145.122	23,15
Forint húngaro			
84.397	OTP Bank Nyrt*	4.549.122	0,83
173.142	Richter Gedeon Nyrt*	4.615.123	0,85
	Total forint húngaro	9.164.245	1,68
Rupia india			
81.691	Apollo Hospitals Enterprise Ltd*	3.978.329	0,73
169.802	AU Small Finance Bank Ltd*	2.366.331	0,43
17.215	Divi's Laboratories Ltd*	1.020.115	0,19
843.479	EPL Ltd*	3.161.486	0,58
109.096	Gland Pharma Ltd*	5.025.931	0,92
32.528	GMM Pfaudler Ltd*	2.050.669	0,38
254.117	HDFC Bank Ltd*	5.120.972	0,94
166.306	Housing Development Finance Corp Ltd*	5.543.608	1,02
883.853	ICICI Bank Ltd*	7.501.989	1,38
423.003	IndusInd Bank Ltd*	5.776.242	1,06
494.218	JM Financial Ltd*	591.426	0,11
236.363	Mahindra & Mahindra Ltd*	2.473.019	0,45
288.145	Reliance Industries Ltd*	5.761.543	1,06
110.609	Spandana Sphoorty Financial Ltd*	981.761	0,18
1.445.419	State Bank of India*	8.151.751	1,50
57.036	UltraTech Cement Ltd*	5.199.461	0,95
148.467	United Breweries Ltd*	2.862.878	0,52
	Total rupia india	67.567.511	12,40
Rupia indonesia			
1.018.100	Bank Central Asia Tbk PT*	2.115.190	0,39
	Total rupia indonesia	2.115.190	0,39

Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (cont.)

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 98,26% (31 de diciembre de 2020: 97,63%) (cont.)			
Peso mexicano			
546.200	Fomento Economico Mexicano SAB de CV*	4.625.438	0,85
Total peso mexicano		4.625.438	0,85
Nuevo dólar taiwanés			
224.200	Accton Technology Corp*	2.659.420	0,49
1.137.000	Chunghwa Telecom Co Ltd*	4.652.059	0,85
188.000	Keystone Microtech Corp*	2.449.314	0,45
302.000	LandMark Optoelectronics Corp*	2.872.319	0,53
47.000	Largan Precision Co Ltd*	5.229.251	0,96
38.200	Parade Technologies Ltd*	1.898.860	0,35
285.000	RichWave Technology Corp*	4.955.855	0,91
600.802	Tong Hsing Electronic Industries Ltd*	4.582.160	0,84
2.521.000	Uni-President Enterprises Corp*	6.623.139	1,21
Total nuevo dólar taiwanés		35.922.377	6,59
Zloty polaco			
212.345	Allegro.eu SA*	3.660.121	0,67
75.635	Dino Polska SA*	5.560.871	1,02
Total zloty polaco		9.220.992	1,69
Libra esterlina			
642.941	Network International Holdings Plc*	3.248.114	0,59
43.595	Rio Tinto Plc*	3.582.744	0,66
Total libra esterlina		6.830.858	1,25
Dólar de Singapur			
4.995.636	Thai Beverage PCL*	2.508.596	0,46
Total dólar de Singapur		2.508.596	0,46
Rand sudafricano			
251.274	Bid Corp Ltd*	5.448.442	1,00
42.938	Capitec Bank Holdings Ltd*	5.071.458	0,93
33.315	Naspers Ltd Clase N*	6.995.339	1,29
Total rand sudafricano		17.515.239	3,22
Won de Corea del Sur			
15.943	Korea Petrochemical Industries Co Ltd*	3.369.386	0,62
8.778	LG Chem Ltd*	6.625.494	1,22

Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (cont.)

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 98,26% (31 de diciembre de 2020: 97,63%) (cont.)			
Won de Corea del Sur (cont.)			
6.808	NCSOFT Corp*	4.957.208	0,91
38.570	Orion Corp*	4.058.558	0,74
355.720	Samsung Electronics Co Ltd*	25.490.924	4,68
83.105	SK Hynix Inc*	9.408.948	1,73
6.700	SK IE Technology Co Ltd*	1.088.754	0,20
19.620	SK Telecom Co Ltd*	5.575.101	1,02
11.426	Soulbrain Co Ltd*	3.335.014	0,61
	Total won de Corea del Sur	63.909.387	11,73
Baht tailandés			
3.095.400	Ngern Tid Lor PCL*	4.008.084	0,74
	Total baht tailandés	4.008.084	0,74
Dólar estadounidense			
19.492	Credicorp Ltd*	2.360.676	0,43
1.610.945	Detsky Mir PJSC*	3.334.187	0,61
250.068	Fix Price Group Ltd GDR*	2.188.095	0,40
994.952	Gazprom PJSC*	3.831.696	0,70
499.518	Infosys Ltd ADR*	10.584.786	1,94
302.300	iQIYI Inc ADR*	4.709.834	0,86
69.337	Kaspi.KZ JSC GDR*	7.349.722	1,35
104.984	Lukoil PJSC ADR*	9.723.618	1,79
134.328	Momo Inc ADR*	2.056.562	0,38
95.930	Pagseguro Digital Ltd Clase A*	5.364.406	0,99
13.658	Polyus PJSC*	2.648.263	0,49
627.168	Sberbank of Russia PJSC*	2.624.355	0,48
330.374	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR*	39.697.740	7,29
98.900	Trip.com Group Ltd ADR*	3.506.994	0,64
123.831	Vasta Platform Ltd Clase A*	1.005.508	0,18
77.012	X5 Retail Group NV GDR*	2.700.041	0,50
99.686	Yandex NV Clase A*	7.052.785	1,30
	Total dólar estadounidense	110.739.268	20,33
	Total valores de renta variable	535.338.143	98,26
	Total inversiones	535.338.143	98,26

Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (0,09%) (31 de diciembre de 2020: (0,43%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases AUD con cobertura						
12.411 AUD	9.318 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	1	0,00
1.710.443 USD	2.225.844 AUD	19/07/2021	Goldman Sachs International	5	39.247	0,01
1.665.280 USD	2.166.045 AUD	19/07/2021	UBS AG	4	38.983	0,01
2.191.317 USD	2.844.865 AUD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	41	55.351	0,01
Clases EUR con cobertura						
1.740.897 USD	1.450.969 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	5	19.573	0,00
1.767.998 USD	1.475.236 €	19/07/2021	UBS AG	4	17.885	0,00
3.174.046 USD	2.637.779 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	24	44.776	0,01
Clases GBP con cobertura						
299.882 £	412.767 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	1.527	0,00
295.020 £	406.149 USD	19/07/2021	UBS AG	3	1.426	0,00
282.762 £	389.092 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	1.549	0,00
13.980 USD	9.878 £	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	333	0,00
7.448 USD	5.354 £	19/07/2021	UBS AG	1	51	0,00
90.923 USD	65.013 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	7	1.106	0,00
Clases ZAR con cobertura						
98.511 USD	1.404.332 ZAR	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	374	0,00
259.095 USD	3.660.703 ZAR	19/07/2021	UBS AG	4	3.276	0,00
1.641.958 USD	22.919.538 ZAR	19/07/2021	Westpac Banking Corp	36	40.285	0,01
37.049.462 ZAR	2.532.171 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	56.938	0,01
41.223.391 ZAR	2.819.135 USD	19/07/2021	UBS AG	5	61.659	0,01
50.651.980 ZAR	3.461.775 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	30	77.912	0,02
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					462.252	0,09
					Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados					535.800.395	98,35

Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

Pasivo financiero al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,10%) (31 de diciembre de 2020: (0,21%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases AUD con cobertura						
4.274.962 AUD	3.286.330 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	7	(76.629)	(0,01)
4.016.322 AUD	3.087.795 USD	19/07/2021	UBS AG	4	(72.284)	(0,01)
4.974.424 AUD	3.830.404 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	63	(95.539)	(0,02)
15.318 USD	20.467 AUD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(48)	(0,00)
Clases EUR con cobertura						
3.592.780 €	4.313.571 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	10	(51.361)	(0,01)
3.211.067 €	3.849.474 USD	19/07/2021	UBS AG	5	(40.099)	(0,01)
5.225.902 €	6.284.237 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	38	(84.609)	(0,02)
Clases GBP con cobertura						
32.717 £	45.665 USD	19/07/2021	UBS AG	5	(467)	(0,00)
69.498 £	98.004 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	10	(1.991)	(0,00)
17.682 USD	12.861 £	19/07/2021	UBS AG	2	(86)	(0,00)
11.988 USD	8.716 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(53)	(0,00)
Clases ZAR con cobertura						
890.942 USD	13.025.866 ZAR	19/07/2021	Goldman Sachs International	4	(19.339)	(0,00)
867.461 USD	12.684.653 ZAR	19/07/2021	UBS AG	3	(18.975)	(0,00)
1.316.534 USD	19.222.400 ZAR	19/07/2021	Westpac Banking Corp	18	(26.776)	(0,01)
2.884.320 ZAR	208.708 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(7.144)	(0,00)
3.800.758 ZAR	269.780 USD	19/07/2021	UBS AG	6	(4.173)	(0,00)
18.908.036 ZAR	1.359.524 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	32	(38.182)	(0,01)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(537.755)	(0,10)

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(537.755)	(0,10)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	535.262.640	98,25
Otro activo neto	9.535.516	1,75
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	544.798.156	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	532.293.306	96,81
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	3.044.837	0,55
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(75.503)	(0,01)
Total inversiones	535.262.640	97,35

Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
4.366.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H Shares	54.630.102
1.998.072	Infosys Ltd ADR	36.046.957
1.907.200	Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd Class A	22.692.151
718.000	Alibaba Group Holding Ltd	22.397.896
27.232	NCSOFT Corp	20.924.829
1.209.200	iQIYI Inc ADR	19.989.916
1.140.000	RichWave Technology Corp	18.601.671
6.829.912	Beijing Sinnet Technology Co Ltd Class A	18.550.392
6.558.532	Fujian Green Pine Co Ltd Class A	18.092.309
1.130.360	Reliance Industries Ltd – Partly Paid	17.452.741
337.588	OTP Bank Nyrt	17.428.185
194.800	Tencent Holdings Ltd	17.205.427
12.381.600	Ngern Tid Lor PCL	14.909.470
3.979.808	Gazprom PJSC	14.874.935
688.884	InPost SA	14.692.437
8.165.344	CSN Mineracao SA	13.248.993
11.963.200	Jiangsu Changshu Rural Commercial Bank Co Ltd Class A	13.114.097
45.704	Soulbrain Co Ltd	12.435.747
149.764	Lukoil PJSC ADR	11.798.438
248.800	JD.com Inc Class A	11.464.148
3.904.660	WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd Class A	10.599.839
542.400	Kuaishou Technology Class B	10.131.076
1.076.000	Tsingtao Brewery Co Ltd - H Shares	9.916.943
1.000.272	Fix Price Group Ltd GDR	9.750.041
48.056	Polyus PJSC	9.696.345
119.508	Samsung Electronics Co Ltd	9.471.816
679.208	AU Small Finance Bank Ltd	8.733.550
169.268	Pagseguro Digital Ltd Class A	8.106.550
1.019.256	Bharti Airtel International Netherlands BV	7.697.740
421.432	Allegro.eu SA	7.534.132
1.149.200	Rosneft Oil Co PJSC	7.329.352

Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (cont.)

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
3.970.800	Ping An Insurance Group Co of China Ltd Class A	51.418.851
4.564.176	NARI Technology Co Ltd Class A	21.847.591
477.860	Tata Consultancy Services Ltd	20.003.808
714.584	Reliance Industries Ltd	19.157.232
11.590.400	Huatai Securities Co Ltd - H Shares	17.209.534
1.269.712	IndusInd Bank Ltd	16.584.592
101.624	Com2uS Corp	14.615.623
235.860	Coway Co Ltd	14.190.137
55.332	Naspers Ltd Class N	14.022.198
2.922.372	Banco Bradesco SA - Preferred Shares	13.735.100
1.691.812	ICICI Bank Ltd	13.117.612
12.874.400	Yonghui Superstores Co Ltd Class A	13.015.539
1.345.864	Link REIT	12.023.274
2.274.800	Suofeiya Home Collection Co Ltd Class A	11.524.498
127.244	UltraTech Cement Ltd	11.498.307
236.000	Parade Technologies Ltd	11.069.477
837.680	Tech Mahindra Ltd	10.891.709
139.876	Samsung Electronics Co Ltd	10.881.247
11.263.600	CNOOC Ltd	10.703.282
13.968.200	Inari Amertron Bhd	10.645.789
10.986.000	3SBio Inc	10.597.004
5.410.400	CP ALL PCL	9.932.590
112.696	Rio Tinto Plc	9.845.976
2.342.400	China Gas Holdings Ltd	9.621.099
134.108	Dino Polska SA	9.520.166
1.146.000	China Merchants Bank Co Ltd - H Shares	9.265.953
110.800	Tencent Holdings Ltd	9.205.433
1.312.960	Migros Ticaret AS	8.147.931
93.424	Lukoil PJSC ADR	8.142.133
1.149.200	Rosneft Oil Co PJSC	8.091.936
56.740	Credicorp Ltd	8.046.636
179.808	TCS Group Holding Plc GDR	7.676.176
700.000	Accton Technology Corp	7.635.994
1.019.256	Bharti Airtel International Netherlands BV	7.420.693
13.076.000	Greentown Management Holdings Co Ltd	6.703.852
418.000	ASM Pacific Technology Ltd	6.500.233
4.380.000	CICC Financial Trading Ltd, 27/04/2023 - Participatory Notes	6.497.119

Neuberger Berman US Small Cap Fund

Informe del Gestor de inversiones

Durante el periodo de seis meses finalizado el 30 de junio de 2021 (el "periodo analizado") la rentabilidad total de la Clase de Acumulación USD I se situó en el 8,20%. En el mismo periodo, el índice Russell 2000 (Total Return, Net of Tax, USD) (el "Índice") registró una rentabilidad del 17,38%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

El conjunto del mercado de valores estadounidenses generó sólidos resultados y alcanzó varios máximos históricos durante el periodo analizado. El mercado se vio favorecido por el aumento de la actividad económica en consonancia con el avance de la campaña de vacunación contra la COVID-19, así como por unos beneficios empresariales generalmente sólidos, unos fuertes estímulos fiscales y monetarios, y una elevada demanda de los inversores. Estos factores compensaron con creces el aumento de la inflación, que la Reserva Federal estadounidense ("la Fed") calificó de transitorio en gran medida. En resumidas cuentas, el índice S&P 500 avanzó un 15,25% en el periodo del informe. Las acciones de pequeña capitalización, que suelen ser más sensibles a la economía, generaron resultados aún mejores, ya que el índice Russell 2000 avanzó un 17,53%. Dentro del universo de pequeña capitalización, los índices Russell 2000 Growth y Russell 2000 Value rindieron un 8,98% y un 26,69%, respectivamente, durante el periodo analizado.

La Cartera se anotó una rentabilidad absoluta sólida, aunque inferior a la del Índice en el periodo analizado. Las empresas de menor calidad (menos rentables/más endeudadas), más cíclicas (beta más elevada) y más especulativas (capitalizaciones bursátiles más pequeñas y precios de las acciones más bajos) generaron una rentabilidad superior durante el periodo. Tal y como hemos observado en el pasado, la Cartera tiende a generar una rentabilidad inferior en un mercado sólido resultante de una recuperación económica tras una especulación y/o crisis cíclica. La Cartera generó una rentabilidad absoluta positiva en siete de los nueve sectores en los que invirtió, aunque se situó a la zaga del índice de referencia en términos relativos en todos ellos salvo uno —la seña de identidad de un repunte de la baja calidad—. En este contexto, la selección de valores contribuyó a una rentabilidad inferior de la Cartera, siendo las posiciones en industria, consumo discrecional y tecnología de la información las que más perjudicaron a los resultados. En el sector industrial, nuestras posiciones en suministros y servicios comerciales fueron las que más lastraron los resultados. En consumo discrecional, nuestras posiciones en el sector minorista especializado realizaron las mayores contribuciones negativas. En tecnología de la información nos situamos a la zaga del índice de referencia, sobre todo en semiconductores y equipos de semiconductores en el sector industrial. Por el lado positivo, la selección de valores en el sector inmobiliario contribuyó ligeramente a la rentabilidad, gracias a una posición en el sector de la construcción y gestión inmobiliaria. En términos generales, la asignación sectorial perjudicó en cierta medida a los resultados. La ausencia de exposición al sector energético y una sobreponderación en empresas de software fueron los principales lastres de la rentabilidad. Por el contrario, la ausencia de exposición a empresas biotecnológicas tradicionales y a suministros públicos beneficiaron.

Los datos económicos apuntan a la existencia de una sólida base para un fuerte crecimiento continuado a medida que avance el año. Entre los principales factores de impulso de la reactivación económica destacaron la llegada de las vacunas y unos estímulos fiscales y monetarios sin precedentes. En este contexto, los títulos especulativos, de calidad inferior y más cíclicos se anotaron resultados superiores. De cara al futuro, es probable que presenciemos una importante reducción de los estímulos fiscales, y que el aumento de las ayudas y prestaciones asociadas a la COVID sea cosa del pasado. Mientras tanto, la inflación sigue siendo un comodín. La Fed ha señalado en repetidas ocasiones que las subidas de precios son generalmente de carácter transitorio. Aunque puede que esto sea cierto por ejemplo en el caso de las materias primas, la inflación salarial podría ser más persistente. Habida cuenta de la incertidumbre asociada a la inflación, hemos sometido todas las posiciones del Fondo a "pruebas de resistencia" para prever cómo responderían a la posibilidad de un avance más duradero hacia la inflación. Sin embargo, confiamos en que mientras la economía se encuentre en una fase de transición hacia un entorno con menos estímulos y hasta que logre sostenerse por sus propios medios, invertir en una cartera diversificada de empresas con unas finanzas saneadas y unos modelos de negocio sostenibles y altamente diferenciados representa un enfoque prudente para el éxito de la inversión a largo plazo.

Neuberger Berman US Small Cap Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		791.004.801	582.646.570
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	19.288.682	6.760.168
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		3.395.792	611.050
Cuentas a percibir por acciones emitidas		4.548.375	4.077.812
Ingresos a percibir y otros activos		231.551	148.990
Activos totales		818.469.201	594.244.590
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		724.499	216.246
Descubierto bancario	3	–	248
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		18.972.405	1.561.969
Gastos devengados		1.039.848	650.019
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		84.516	2.168.489
Otras cuentas por pagar		41.882	53.155
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		20.863.150	4.650.126
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		797.606.051	589.594.464

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman US Small Cap Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		271	10.156
Ingresos por dividendos		3.101.964	1.918.970
Ingresos varios		8.430	–
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		52.946.845	(5.222.096)
		56.057.510	(3.292.970)
Gastos			
Comisión de gestión	5	4.932.152	1.997.970
Comisión de distribución	5	670.796	436.950
Comisión de administración	5	383.780	261.317
Comisión de compromiso	16	29.805	20.198
Comisión de depósito	5	6.886	5.490
Comisión del Depositario	5	20.560	18.827
Honorarios profesionales	7	82.740	38.240
Honorarios de los Consejeros	6	1.934	2.380
Costes de transacciones	7	126.637	100.360
Honorarios de auditoría	7	10.937	9.809
Reembolso de IVA		(3.281)	(1.345)
Otros gastos	7	6.441	11.532
Gastos totales		6.269.387	2.901.728
Costes financieros			
Gastos por intereses		3.685	1.260
		3.685	1.260
Impuestos retenidos en origen		905.346	539.402
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		48.879.092	(6.735.360)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Neuberger Berman US Small Cap Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	589.594.464	415.107.156
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	48.879.092	(6.735.360)
Suscripciones	436.268.666	104.328.140
Reembolsos	(277.136.171)	(110.446.576)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	797.606.051	402.253.360

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman US Small Cap Fund (cont.)

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 99,10% (31 de diciembre de 2020: 98,71%)			
Libra esterlina			
149.891	Abcam Plc*	2.859.594	0,36
Total libra esterlina		2.859.594	0,36
Dólar estadounidense			
132.288	AAON Inc*	8.279.906	1,04
28.657	Allegiant Travel Co*	5.559.458	0,70
54.469	Altair Engineering Inc Class A*	3.756.727	0,47
127.273	American Software Inc Class A*	2.794.915	0,35
66.477	AMERISAFE Inc*	3.968.012	0,50
59.686	AptarGroup Inc*	8.406.176	1,05
58.584	Artisan Partners Asset Management Inc Class A*	2.977.239	0,37
53.199	Asbury Automotive Group Inc*	9.116.713	1,14
107.258	Aspen Technology Inc*	14.752.265	1,85
8.842	Atrion Corp*	5.490.263	0,69
116.341	Bank of Hawaii Corp*	9.798.239	1,23
43.207	Bio-Techne Corp*	19.454.384	2,44
67.176	BOK Financial Corp*	5.817.442	0,73
52.806	Bright Horizons Family Solutions Inc*	7.768.291	0,97
4.795	Cable One Inc*	9.171.924	1,15
63.143	Certara Inc*	1.788.841	0,22
41.780	Chase Corp*	4.287.046	0,54
27.307	Chemed Corp*	12.957.171	1,62
81.929	Church & Dwight Co Inc*	6.981.989	0,88
63.437	CMC Materials Inc*	9.562.493	1,20
102.938	Cognex Corp*	8.651.939	1,09
131.312	Columbia Banking System Inc*	5.063.391	0,64
117.094	Community Bank System Inc*	8.858.161	1,11
73.447	Computer Services Inc**	4.131.394	0,52
42.626	CSW Industrials Inc*	5.049.476	0,63
69.363	Cullen/Frost Bankers Inc*	7.768.656	0,97
252.202	CVB Financial Corp*	5.192.839	0,65
7.000	Doximity Inc Class A*	407.400	0,05
133.354	Driven Brands Holdings Inc*	4.123.306	0,52
66.223	Eagle Materials Inc*	9.410.951	1,18
132.178	Emergent BioSolutions Inc*	8.325.892	1,04
136.298	Exponent Inc*	12.159.145	1,52
28.445	Fair Isaac Corp*	14.298.733	1,79
191.420	First Financial Bankshares Inc*	9.404.465	1,18

Neuberger Berman US Small Cap Fund (cont.)

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 99,10% (31 de diciembre de 2020: 98,71%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
186.049	First Hawaiian Inc*	5.272.629	0,66
67.131	FirstService Corp*	11.496.855	1,44
76.513	Floor & Decor Holdings Inc Class A*	8.087.424	1,01
63.082	Forward Air Corp*	5.661.609	0,71
115.046	Fox Factory Holding Corp*	17.908.060	2,25
159.963	Glacier Bancorp Inc*	8.810.762	1,10
92.436	Graco Inc*	6.997.405	0,88
148.227	Grocery Outlet Holding Corp*	5.137.548	0,64
146.389	Haemonetics Corp*	9.755.363	1,22
36.452	Hamilton Lane Inc Class A*	3.321.506	0,42
223.966	Hayward Holdings Inc*	5.827.595	0,73
62.447	Houlihan Lokey Inc Class A*	5.107.540	0,64
136.499	IAA Inc*	7.444.655	0,93
27.218	ICON Plc*	5.626.233	0,71
15.096	IDEXX Laboratories Inc*	9.533.879	1,20
42.798	Jack Henry & Associates Inc*	6.997.901	0,88
37.584	Kadant Inc*	6.618.167	0,83
68.243	Lakeland Financial Corp*	4.206.498	0,53
37.531	Lancaster Colony Corp*	7.262.624	0,91
225.204	Lattice Semiconductor Corp*	12.651.961	1,59
59.222	LCI Industries*	7.782.955	0,98
41.582	Lindsay Corp*	6.872.673	0,86
20.389	Lithia Motors Inc Class A*	7.006.476	0,88
42.412	Littelfuse Inc*	10.806.153	1,36
129.057	Manhattan Associates Inc*	18.692.616	2,34
16.864	MarketAxess Holdings Inc*	7.817.982	0,98
55.609	MKS Instruments Inc*	9.895.622	1,24
111.534	Model N Inc*	3.822.270	0,48
67.813	MSA Safety Inc*	11.228.477	1,41
66.271	National Instruments Corp*	2.801.938	0,35
43.647	National Research Corp*	2.003.397	0,25
90.384	Neogen Corp*	4.161.279	0,52
249.703	NetScout Systems Inc*	7.126.524	0,89
90.675	Nexstar Media Group Inc Class A*	13.409.019	1,68
33.136	Nordson Corp*	7.273.683	0,91
82.805	Novanta Inc*	11.158.802	1,40
19.983	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc*	1.681.170	0,21
8.249	Omega Flex Inc*	1.210.211	0,15

Neuberger Berman US Small Cap Fund (cont.)

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 99,10% (31 de diciembre de 2020: 98,71%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
123.874	Petco Health & Wellness Co Inc Class A*	2.776.016	0,35
57.279	Pool Corp*	26.271.586	3,29
165.264	Power Integrations Inc*	13.561.564	1,70
82.205	Prosperity Bancshares Inc*	5.902.319	0,74
41.287	Quaker Chemical Corp*	9.792.864	1,23
101.290	Qualys Inc*	10.198.890	1,28
61.006	RBC Bearings Inc*	12.165.817	1,53
126.129	Richelieu Hardware Ltd**	4.086.486	0,51
75.644	RLI Corp*	7.911.606	0,99
65.528	Rogers Corp*	13.158.022	1,65
193.310	Rollins Inc*	6.611.202	0,83
46.095	Shoals Technologies Group Inc Class A*	1.636.372	0,21
64.691	Simulations Plus Inc*	3.552.183	0,45
32.161	SiteOne Landscape Supply Inc*	5.443.571	0,68
76.927	SPS Commerce Inc*	7.681.161	0,96
80.596	TechTarget Inc*	6.245.384	0,78
67.352	Tetra Tech Inc*	8.219.638	1,03
84.966	Texas Roadhouse Inc Class A*	8.173.729	1,03
106.726	Toro Co*	11.727.053	1,47
27.434	Tractor Supply Co*	5.104.370	0,64
32.885	Transcat Inc*	1.858.331	0,23
20.995	Tyler Technologies Inc*	9.497.508	1,19
132.900	Utz Brands Inc*	2.895.891	0,36
38.258	Valmont Industries Inc*	9.030.801	1,13
154.582	Vertex Inc Class A*	3.391.529	0,43
23.619	Watsco Inc*	6.770.150	0,85
32.636	WD-40 Co*	8.364.280	1,05
52.033	West Pharmaceutical Services Inc*	18.685.050	2,34
49.631	XPEL Inc*	4.162.552	0,52
16.416	Zebra Technologies Corp Class A*	8.692.108	1,09
Total dólar estadounidense		787.580.736	98,74
Total valores de renta variable		790.440.330	99,10
Total inversiones		790.440.330	99,10

Neuberger Berman US Small Cap Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,07% (31 de diciembre de 2020: 0,11%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases AUD con cobertura						
22.876 AUD	17.151 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	24	0,00
351.086 USD	456.919 AUD	19/07/2021	Goldman Sachs International	5	8.024	0,00
212.874 USD	276.125 AUD	19/07/2021	UBS AG	2	5.556	0,00
1.154.421 USD	1.491.505 AUD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	50	34.578	0,00
Clases EUR con cobertura						
18.726 €	22.215 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	1	0,00
2.044.109 USD	1.687.484 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	6	42.201	0,01
1.339.483 USD	1.118.589 €	19/07/2021	UBS AG	4	12.472	0,00
19.450.602 USD	16.193.115 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	48	240.276	0,03
Clases ZAR con cobertura						
168.229 USD	2.357.578 ZAR	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	3.475	0,00
343.774 USD	4.881.577 ZAR	19/07/2021	UBS AG	3	2.637	0,00
774.719 USD	10.811.274 ZAR	19/07/2021	Westpac Banking Corp	36	19.199	0,00
38.574.275 ZAR	2.636.875 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	4	58.792	0,01
45.900.697 ZAR	3.140.125 USD	19/07/2021	UBS AG	7	67.531	0,01
42.418.496 ZAR	2.894.606 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	23	69.705	0,01
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					564.471	0,07
					Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados					791.004.801	99,17

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,09%) (31 de diciembre de 2020: (0,04%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases AUD con cobertura						
2.402.722 AUD	1.849.002 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	8	(45.005)	(0,01)
2.186.445 AUD	1.681.162 USD	19/07/2021	UBS AG	7	(39.549)	(0,00)
4.219.069 AUD	3.252.952 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	64	(85.217)	(0,01)
39.720 USD	52.964 AUD	19/07/2021	UBS AG	1	(46)	(0,00)
Clases EUR con cobertura						
10.818.790 €	12.979.443 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	8	(144.822)	(0,02)
9.902.463 €	11.888.296 USD	19/07/2021	UBS AG	6	(140.738)	(0,02)
14.736.795 €	17.695.457 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	76	(212.801)	(0,03)

Neuberger Berman US Small Cap Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (0,09%) (31 de diciembre de 2020: (0,04%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases ZAR con cobertura						
242.229 USD	3.524.970 ZAR	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	(4.105)	(0,00)
152.037 USD	2.209.781 ZAR	19/07/2021	UBS AG	1	(2.388)	(0,00)
2.597.950 USD	37.719.093 ZAR	19/07/2021	Westpac Banking Corp	27	(37.955)	(0,00)
2.215.611 ZAR	157.837 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(3.005)	(0,00)
2.538.983 ZAR	178.619 USD	19/07/2021	UBS AG	3	(1.188)	(0,00)
7.902.975 ZAR	559.960 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	33	(7.680)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(724.499)	(0,09)
					Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados					(724.499)	(0,09)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados					790.280.302	99,08
Otro activo neto					7.325.749	0,92
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables					797.606.051	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					782.222.450	95,58
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado					8.217.880	1,00
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC					(160.028)	(0,02)
Total inversiones					790.280.302	96,56

Neuberger Berman US Small Cap Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
71.514	Haemonetics Corp	6.923.114
16.296	Pool Corp	5.835.807
45.918	Manhattan Associates Inc	5.551.499
37.950	Aspen Technology Inc	5.543.071
40.331	Fox Factory Holding Corp	5.244.316
46.641	Emergent BioSolutions Inc	4.803.265
43.730	SPS Commerce Inc	4.610.085
8.903	Chemed Corp	4.576.949
48.091	Exponent Inc	4.534.814
52.562	Power Integrations Inc	4.503.679
50.738	Bank of Hawaii Corp	4.307.898
34.127	Nexstar Media Group Inc Class A	4.278.123
35.287	Qualys Inc	4.151.729
59.433	Community Bank System Inc	4.129.087
15.101	Quaker Chemical Corp	4.112.165
23.121	Rogers Corp	4.106.924
14.966	Littelfuse Inc	4.076.616
24.394	CMC Materials Inc	4.074.154
19.118	Valmont Industries Inc	4.060.316
21.522	RBC Bearings Inc	4.030.115
78.290	Glacier Bancorp Inc	4.018.786
29.953	Novanta Inc	3.980.784
223.966	Hayward Holdings Inc	3.950.391
29.070	Tetra Tech Inc	3.861.871
8.074	Fair Isaac Corp	3.858.934
23.802	MSA Safety Inc	3.853.936
32.870	Eagle Materials Inc	3.838.561
86.869	Lattice Semiconductor Corp	3.828.581
37.659	Toro Co	3.796.072
12.353	WD-40 Co	3.697.878

Neuberger Berman US Small Cap Fund (cont.)

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
133.354	Driven Brands Holdings Inc	3.641.290
24.549	FirstService Corp	3.532.578
9.193	Bio-Techne Corp	3.473.178
20.760	Asbury Automotive Group Inc	3.456.002
46.677	AAON Inc	3.403.908
11.882	West Pharmaceutical Services Inc	3.381.847
19.617	MKS Instruments Inc	3.376.542
1.700	Cable One Inc	3.376.002
54.810	IAA Inc	3.289.557
18.630	Bright Horizons Family Solutions Inc	3.027.064
20.899	LCI Industries	2.972.962
21.059	AptarGroup Inc	2.946.485
46.287	Lakeland Financial Corp	2.920.324

Neuberger Berman US Small Cap Fund (cont.)

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
11.039	Pool Corp	4.610.945
27.214	Fox Factory Holding Corp	3.923.569
27.441	Manhattan Associates Inc	3.775.343
8.154	Bio-Techne Corp	3.413.113
6.396	IDEXX Laboratories Inc	3.369.117
9.530	West Pharmaceutical Services Inc	3.224.513
20.758	Aspen Technology Inc	2.945.386
6.077	Zebra Technologies Corp Class A	2.909.076
5.651	MarketAxess Holdings Inc	2.863.954
5.603	Fair Isaac Corp	2.767.302
8.205	FactSet Research Systems Inc	2.619.009
5.276	Tyler Technologies Inc	2.279.838
27.433	Power Integrations Inc	2.246.863
15.127	Nexstar Media Group Inc Class A	2.216.465
5.948	NewMarket Corp	2.147.321
10.964	Rogers Corp	2.108.224
22.803	Exponent Inc	2.056.046
11.559	Asbury Automotive Group Inc	2.053.404
10.208	RBC Bearings Inc	2.029.609
5.859	Lithia Motors Inc Class A	2.013.999
37.684	Lattice Semiconductor Corp	1.955.461
11.232	FirstService Corp	1.888.367
17.860	Toro Co	1.884.844
18.486	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	1.834.773
6.929	WD-40 Co	1.827.672
7.096	Littelfuse Inc	1.825.672
10.930	MSA Safety Inc	1.794.060
16.947	Qualys Inc	1.726.520
19.466	Bank of Hawaii Corp	1.720.128
12.519	Novanta Inc	1.696.894
9.304	MKS Instruments Inc	1.646.987
10.618	CMC Materials Inc	1.629.451
55.631	NetScout Systems Inc	1.614.897
32.029	First Financial Bankshares Inc	1.610.140
11.080	Eagle Materials Inc	1.598.886
19.593	Community Bank System Inc	1.546.608
9.770	Jack Henry & Associates Inc	1.544.570
26.766	Glacier Bancorp Inc	1.536.599

Neuberger Berman US Small Cap Fund (cont.)

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
6.244	Quaker Chemical Corp	1.487.407
22.113	Emergent BioSolutions Inc	1.456.695
22.135	AAON Inc	1.434.530
97.245	Array Technologies Inc	1.433.787
796	Cable One Inc	1.432.939
9.987	AptarGroup Inc	1.420.812
21.348	Haemonetics Corp	1.401.587
11.272	Tetra Tech Inc	1.388.667
17.224	Cognex Corp	1.376.362

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund

Informe del Gestor de inversiones

Durante el periodo de seis meses finalizado el 30 de junio de 2021 (el "periodo analizado"), la rentabilidad total de la Clase de Acumulación USD I se situó en el 3,06%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

El mercado de alta rentabilidad se anotó buenos resultados en el primer semestre de 2021 gracias a la exitosa campaña de vacunación contra la COVID-19, la reapertura de las economías, el sólido crecimiento del PIB y la mejora de los fundamentales del crédito. A pesar de esta evolución positiva del entorno económico, la Reserva Federal estadounidense reiteró su intención de mantener una política monetaria acomodaticia y también su confianza en el carácter transitorio del aumento de la inflación. Los diferenciales de crédito, que se habían ampliado al comienzo de la pandemia el pasado año, experimentaron una contracción significativa durante el periodo analizado. El mercado de alta rentabilidad también se caracterizó por la divergencia de rentabilidades entre las diferentes calidades crediticias y entre emisores que atravesaron o no dificultades (distressed/non-distressed) durante el periodo, con un avance del índice ICE BofA Distressed High Yield del 29,9%, frente al 3,1% del índice ICE BofA US Non-Distressed High Yield en el año en curso. A pesar de que la parte del mercado que atravesó dificultades experimentó un fuerte repunte partiendo de unos niveles muy bajos, muchos de los emisores perjudicados a más largo plazo y que afrontan desafíos seculares todavía no satisfacen nuestros estrictos estándares de suscripción de crédito. Durante el periodo analizado, el índice de valores en dificultades (distressed), medido como porcentaje del Total US High Yield Index, se situó en apenas el 1,7%, descendiendo respecto al 4,1% registrado al cierre del año pasado, lo que supone el nivel más bajo visto desde octubre de 2006. Por otra parte, desde la perspectiva de la selección de títulos de crédito individuales, encontramos oportunidades de inversión atractivas en el espectro del crédito y en el universo de alta rentabilidad.

La cifra de emisiones nuevas ha sido muy elevada en el primer semestre, dado que los emisores trataron de refinanciar a rentabilidades más bajas. En lo que va de año, la emisión bruta de bonos de alta rentabilidad de EE. UU. alcanzó los 299.100 millones de dólares —100.300 millones de dólares excluyendo refinanciaciones—, superando los 218.400 millones de dólares —94.200 millones de dólares excluyendo refinanciaciones— del mismo periodo del pasado año. Las salidas de capital de fondos de alta rentabilidad del año en curso alcanzan los -13.800 millones de dólares, lo que contrasta con las entradas de capital por valor de 28.600 millones de dólares del primer semestre de 2020.

En junio de 2021, la tasa de morosidad ponderada por el valor nominal de las emisiones del mercado de alta rentabilidad de los últimos 12 meses en Estados Unidos descendió hasta el 1,87%, en 430 puntos básicos, desde el 6,17% registrado en diciembre de 2020. Por ponerlo en contexto, cabe señalar que la tasa de morosidad media a largo plazo se sitúa en el 3,5% (basada en las tasas de morosidad anuales desde 1980, según JP Morgan). Habida cuenta de la creciente proporción de mejora de las calificaciones y del descenso de las rebajas de calificación, prevemos que las tasas de impago de las emisiones del mercado de alta rentabilidad seguirán moderándose respecto de los niveles actuales.

Durante el periodo analizado, el posicionamiento en los sectores de la energía, la distribución de gas, inmobiliario y de construcción de vivienda fue lo que más benefició a la rentabilidad, mientras que el posicionamiento en los sectores del ferrocarril, el papel y medios de comunicación diversificados fue el que menos contribuyó a los resultados. Por calificaciones, nuestro posicionamiento en títulos con calificaciones B y BB fue el que más benefició, mientras que el posicionamiento en emisores con calificación BBB y superior fue el que menos contribuyó a los resultados.

Los diferenciales del mercado de alta rentabilidad se han estrechado en el año en curso, pero creemos que las valoraciones compensan a los inversores por unas perspectivas de impago cada vez más benignas. La recuperación económica sigue su curso y creemos que la evolución positiva del crecimiento y de la capacidad de fijación de precios favorecerá a los fundamentales de los emisores. El constante progreso de las campañas de vacunación, unido a la demanda acumulada de los consumidores en los segmentos de los viajes, el ocio y los servicios, la reposición de inventarios y contrataciones por parte de las empresas, así como un FOMC paciente aunque vigilante deberían seguir favoreciendo a la actividad económica de cara al futuro. A pesar de que las nuevas variantes de la COVID y la preocupación por la inflación dan lugar a episodios de volatilidad a corto plazo, creemos que nuestro análisis fundamental del crédito, con un enfoque bottom-up y centrado en la selección de títulos individuales, al tiempo que trata de evitar el deterioro del crédito y de incluir solo nuestras "mejores ideas" en las carteras, nos permite estar bien posicionados para aprovechar cualquier volatilidad.

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		646.355.725	892.700.016
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	22.696.364	33.377.166
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		16.267.272	9.335.519
Cuentas a percibir por acciones emitidas		983.791	330.978
Ingresos a percibir y otros activos		9.047.853	11.540.237
Activos totales		695.351.005	947.283.916
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		5.619.042	3.224.432
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		23.361.378	127.119
Gastos devengados		502.023	590.192
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		6.625.042	15.523.047
Otras cuentas por pagar		117.671	90.837
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		36.225.156	19.555.627
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		659.125.849	927.728.289

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		19.557.331	24.988.352
Ingresos por dividendos		72.191	55.708
Ingresos por préstamo de valores	15	10.226	4.344
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(17.434.156)	(72.818.605)
		2.205.592	(47.770.201)
Gastos			
Comisión de gestión	5	2.276.552	2.750.233
Comisión de distribución	5	55.072	88.037
Comisión de administración	5	315.378	509.278
Comisión de compromiso	16	69.584	51.437
Comisión de depósito	5	11.012	11.139
Comisión del Depositario	5	17.851	45.596
Honorarios profesionales	7	91.867	56.426
Honorarios de los Consejeros	6	1.941	2.379
Costes de transacciones	7	47.099	49.323
Honorarios de auditoría	7	16.479	14.900
Reembolso de IVA		(3.747)	(3.111)
Otros gastos	7	24.230	43.888
Renuncia a la comisión de asesoría	5	(9.067)	(8.440)
Gastos totales		2.914.251	3.611.085
Costes financieros			
Gastos por intereses		–	27
Repartos de dividendos abonados	1	5.630.273	10.496.901
		5.630.273	10.496.928
Impuestos retenidos en origen		3.373	13.345
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		(6.342.305)	(61.891.559)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	927.728.289	1.034.294.592
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	(6.342.305)	(61.891.559)
Suscripciones	183.503.180	95.782.449
Reembolsos	(445.763.315)	(201.574.190)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	659.125.849	866.611.292

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund (cont.)

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 de empresa 89,52% (31 de diciembre de 2020: 84,67%)					
Dólar estadounidense					
1.070.000	1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**	4,25%	15/05/2024	1.082.439	0,16
2.875.000	1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**	5,75%	15/04/2025	3.052.445	0,46
2.630.000	Adient Global Holdings Ltd**	4,88%	15/08/2026	2.710.162	0,41
775.000	Adient US LLC**	9,00%	15/04/2025	855.584	0,13
2.690.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	6,75%	15/10/2027	2.830.499	0,43
4.920.000	Altice France SA*	7,38%	01/05/2026	5.122.606	0,78
3.050.000	Altice France SA**	8,13%	01/02/2027	3.326.787	0,50
795.000	American Airlines Group Inc**	3,75%	01/03/2025	733.519	0,11
1.660.000	American Airlines Group Inc**	5,00%	01/06/2022	1.664.183	0,25
5.515.000	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,50%	20/04/2026	5.845.900	0,89
285.000	American Axle & Manufacturing Inc*	6,50%	01/04/2027	302.670	0,05
868.000	Amkor Technology Inc**	6,63%	15/09/2027	938.091	0,14
1.365.000	AmWINS Group Inc**	7,75%	01/07/2026	1.450.517	0,22
3.745.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	7,88%	15/05/2026	4.197.770	0,64
4.170.000	Apex Tool Group LLC/BC Mountain Finance Inc**	9,00%	15/02/2023	4.207.676	0,64
4.570.000	APX Group Inc**	6,75%	15/02/2027	4.879.001	0,74
1.530.000	APX Group Inc**	7,63%	01/09/2023	1.573.987	0,24
1.496.000	APX Group Inc**	7,88%	01/12/2022	1.507.018	0,23
3.215.000	APX Group Inc**	8,50%	01/11/2024	3.365.703	0,51
7.180.000	Aramark Services Inc**	5,00%	01/04/2025	7.377.809	1,12
6.930.000	Aramark Services Inc**	6,38%	01/05/2025	7.371.787	1,12
1.308.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	9,00%	01/11/2027	1.812.711	0,28
1.132.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc**	5,25%	15/03/2025	1.148.272	0,17
3.405.000	Banjijay Entertainment SASU*	5,38%	01/03/2025	3.525.980	0,53
850.000	Bausch Health Cos Inc**	5,50%	01/11/2025	873.163	0,13
4.659.000	Bausch Health Cos Inc**	6,13%	15/04/2025	4.781.299	0,73
890.000	Bausch Health Cos Inc**	9,00%	15/12/2025	955.460	0,15
2.175.000	BCPE Empire Holdings Inc**	7,63%	01/05/2027	2.230.256	0,34
2.595.000	Beacon Roofing Supply Inc**	4,50%	15/11/2026	2.727.111	0,41
1.605.000	Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp**	7,63%	15/12/2025	1.741.425	0,26
1.720.000	Buckeye Partners LP**	4,13%	01/03/2025	1.787.966	0,27
9.420.000	Buckeye Partners LP**	4,35%	15/10/2024	9.885.112	1,50
3.385.000	Caesars Entertainment Inc**	6,25%	01/07/2025	3.592.331	0,55
1.585.000	Caesars Resort Collection LLC/CRC Finco Inc**	5,75%	01/07/2025	1.672.175	0,25
1.305.000	Callon Petroleum Co**	8,00%	01/08/2028	1.321.312	0,20
960.000	Carnival Corp**	5,75%	01/03/2027	1.006.800	0,15
5.055.000	Carnival Corp**	7,63%	01/03/2026	5.497.312	0,83
1.405.000	Carnival Corp**	10,50%	01/02/2026	1.637.591	0,25

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund (cont.)

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 89,52% (31 de diciembre de 2020: 84,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
1.610.000	Carvana Co**	5,50%	15/04/2027	1.667.074	0,25
5.725.000	Carvana Co**	5,63%	01/10/2025	5.966.910	0,91
6.160.000	CD&R Smokey Buyer Inc**	6,75%	15/07/2025	6.610.481	1,00
2.595.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp*	5,38%	01/06/2024	2.634.172	0,40
1.215.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op**	5,50%	01/05/2025	1.269.675	0,19
630.000	Cheniere Energy Partners LP**	5,63%	01/10/2026	655.200	0,10
1.660.000	CHS/Community Health Systems Inc**	5,63%	15/03/2027	1.774.233	0,27
3.385.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,63%	15/02/2025	3.583.835	0,54
3.035.000	CHS/Community Health Systems Inc**	8,00%	15/03/2026	3.274.052	0,50
1.590.000	Churchill Downs Inc**	5,50%	01/04/2027	1.660.551	0,25
1.530.000	Cinemark USA Inc**	5,88%	15/03/2026	1.605.926	0,24
2.105.000	Cinemark USA Inc**	8,75%	01/05/2025	2.309.185	0,35
1.826.000	Clarios Global LP/Clarios US Finance Co**	6,25%	15/05/2026	1.947.539	0,30
8.030.000	CommScope Inc**	5,50%	01/03/2024	8.284.952	1,26
1.600.000	CommScope Inc**	6,00%	01/03/2026	1.691.120	0,26
3.558.000	CommScope Technologies LLC**	6,00%	15/06/2025	3.638.055	0,55
677.000	Comstock Resources Inc**	7,50%	15/05/2025	704.249	0,11
3.875.000	CrownRock LP/CrownRock Finance Inc**	5,63%	15/10/2025	4.021.649	0,61
4.365.000	CSC Holdings LLC**	5,25%	01/06/2024	4.735.822	0,72
915.000	DCP Midstream Operating LP*	4,95%	01/04/2022	934.851	0,14
2.020.000	Delta Air Lines Inc**	7,00%	01/05/2025	2.358.700	0,36
1.725.000	Delta Air Lines Inc*	7,38%	15/01/2026	2.025.367	0,31
1.540.000	Delta Air Lines Inc/SkyMiles IP Ltd**	4,50%	20/10/2025	1.655.643	0,25
5.670.000	DISH DBS Corp**	5,88%	15/07/2022	5.922.031	0,90
1.590.000	DISH DBS Corp**	5,88%	15/11/2024	1.709.250	0,26
3.040.000	EnerSys**	5,00%	30/04/2023	3.184.202	0,48
655.000	EnLink Midstream LLC**	5,63%	15/01/2028	693.936	0,11
2.301.000	EPR Properties*	4,50%	01/04/2025	2.465.131	0,37
5.380.000	EPR Properties*	5,25%	15/07/2023	5.685.834	0,86
2.960.000	EQM Midstream Partners LP*	4,00%	01/08/2024	3.045.100	0,46
1.130.000	EQM Midstream Partners LP**	6,00%	01/07/2025	1.231.502	0,19
2.660.000	EQT Corp*	7,63%	01/02/2025	3.106.321	0,47
640.000	First Quantum Minerals Ltd**	6,88%	01/03/2026	670.310	0,10
1.110.000	First Quantum Minerals Ltd**	6,88%	15/10/2027	1.210.954	0,18
1.725.000	Ford Motor Co*	8,50%	21/04/2023	1.927.170	0,29
2.095.000	Ford Motor Co*	9,00%	22/04/2025	2.585.534	0,39
1.905.000	Ford Motor Credit Co LLC*	3,10%	04/05/2023	1.945.481	0,30
970.000	Ford Motor Credit Co LLC*	3,66%	08/09/2024	1.019.523	0,15

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund (cont.)

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 89,52% (31 de diciembre de 2020: 84,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
3.830.000	Ford Motor Credit Co LLC*	5,13%	16/06/2025	4.222.575	0,64
4.555.000	Ford Motor Credit Co LLC*	5,60%	07/01/2022	4.654.162	0,71
2.200.000	Forterra Finance LLC/FRTA Finance Corp**	6,50%	15/07/2025	2.377.848	0,36
3.240.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,88%	15/10/2027	3.474.900	0,53
2.980.000	Garda World Security Corp**	4,63%	15/02/2027	3.000.905	0,46
1.780.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	6,50%	01/10/2025	1.801.387	0,27
705.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	8,00%	15/01/2027	741.572	0,11
6.607.426	Global Aircraft Leasing Co Ltd**	6,50%	15/09/2024	6.648.888	1,01
5.120.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	9,50%	31/05/2025	5.729.280	0,87
65.000	Granite Merger Sub 2 Inc**	11,00%	15/07/2027	73.966	0,01
910.000	Granite US Holdings Corp**	11,00%	01/10/2027	1.018.167	0,15
1.540.000	GTCR AP Finance Inc**	8,00%	15/05/2027	1.645.482	0,25
3.090.000	Harsco Corp**	5,75%	31/07/2027	3.245.921	0,49
1.200.000	HCA Inc*	5,38%	01/02/2025	1.355.100	0,21
4.505.000	Howmet Aerospace Inc*	6,88%	01/05/2025	5.249.676	0,80
2.620.000	Hudbay Minerals Inc**	4,50%	01/04/2026	2.633.100	0,40
1.330.000	International Game Technology Plc**	4,13%	15/04/2026	1.386.525	0,21
4.300.000	Iron Mountain Inc**	4,88%	15/09/2027	4.463.400	0,68
3.405.000	Jaguar Holding Co II/PPD Development LP**	4,63%	15/06/2025	3.582.060	0,54
1.535.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc**	7,75%	15/10/2025	1.689.467	0,26
4.010.000	JELD-WEN Inc**	4,63%	15/12/2025	4.095.233	0,62
10.550.000	KAR Auction Services Inc**	5,13%	01/06/2025	10.839.598	1,64
3.220.000	L Brands Inc**	9,38%	01/07/2025	4.170.496	0,63
3.250.000	Legends Hospitality Holding Co LLC/Legends Hospitality Co-Issuer Inc**	5,00%	01/02/2026	3.392.188	0,51
3.275.000	Life Time Inc**	5,75%	15/01/2026	3.398.091	0,52
7.460.000	Live Nation Entertainment Inc**	4,88%	01/11/2024	7.594.280	1,15
1.540.000	Lumen Technologies Inc*	5,63%	01/04/2025	1.674.403	0,25
2.260.000	Masonite International Corp**	5,75%	15/09/2026	2.346.309	0,36
2.120.000	Matador Resources Co**	5,88%	15/09/2026	2.186.462	0,33
4.225.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP/MGP Finance Co-Issuer Inc**	4,63%	15/06/2025	4.522.313	0,69
3.385.000	Navient Corp**	6,50%	15/06/2022	3.533.771	0,54
3.430.000	NCL Corp Ltd**	3,63%	15/12/2024	3.316.896	0,50
3.000.000	NCL Corp Ltd**	12,25%	15/05/2024	3.626.955	0,55
6.790.000	New Fortress Energy Inc**	6,50%	30/09/2026	6.946.510	1,05
1.970.000	New Fortress Energy Inc**	6,75%	15/09/2025	2.019.250	0,31
3.160.000	NextEra Energy Operating Partners LP**	4,25%	15/07/2024	3.338.082	0,51
1.445.000	Nouryon Holding BV*	8,00%	01/10/2026	1.533.506	0,23
960.000	NOVA Chemicals Corp**	4,88%	01/06/2024	1.014.000	0,15

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund (cont.)

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 89,52% (31 de diciembre de 2020: 84,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
4.770.000	Novelis Corp**	5,88%	30/09/2026	4.967.977	0,75
1.025.000	NuStar Logistics LP*	4,75%	01/02/2022	1.038.310	0,16
1.300.000	NuStar Logistics LP*	5,75%	01/10/2025	1.417.676	0,22
2.215.000	OneMain Finance Corp*	3,50%	15/01/2027	2.234.381	0,34
2.100.000	OneMain Finance Corp**	6,13%	15/05/2022	2.187.150	0,33
2.980.000	OneMain Finance Corp*	6,13%	15/03/2024	3.210.950	0,49
1.190.000	OneMain Finance Corp*	8,88%	01/06/2025	1.322.875	0,20
3.618.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc/Ortho-Clinical Diagnostics SA**	7,38%	01/06/2025	3.899.535	0,59
4.040.000	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer**	7,50%	01/06/2025	4.392.066	0,67
3.260.000	PDC Energy Inc**	6,13%	15/09/2024	3.344.320	0,51
1.900.000	Penske Automotive Group Inc*	3,50%	01/09/2025	1.974.148	0,30
6.520.000	Performance Food Group Inc**	6,88%	01/05/2025	6.972.716	1,06
2.210.000	Presidio Holdings Inc**	4,88%	01/02/2027	2.277.980	0,35
3.110.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	5,75%	15/04/2026	3.443.703	0,52
3.060.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	6,25%	15/01/2028	3.258.961	0,49
6.660.000	Radiate Holdco LLC/Radiate Finance Inc**	4,50%	15/09/2026	6.910.250	1,05
1.970.000	Range Resources Corp*	5,00%	15/08/2022	2.013.813	0,31
905.000	Range Resources Corp*	5,00%	15/03/2023	939.014	0,14
747.000	Range Resources Corp*	5,88%	01/07/2022	768.469	0,12
1.615.000	Range Resources Corp**	9,25%	01/02/2026	1.783.364	0,27
3.375.000	RBS Global Inc/Rexnord LLC**	4,88%	15/12/2025	3.453.469	0,52
7.985.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	7,63%	15/06/2025	8.671.391	1,32
3.750.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	9,38%	01/04/2027	4.171.594	0,63
4.498.000	Resideo Funding Inc**	6,13%	01/11/2026	4.737.698	0,72
1.230.000	RLJ Lodging Trust LP**	3,75%	01/07/2026	1.243.838	0,19
1.820.000	Royal Caribbean Cruises Ltd*	5,25%	15/11/2022	1.875.710	0,28
1.500.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	9,13%	15/06/2023	1.648.163	0,25
2.530.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	11,50%	01/06/2025	2.919.139	0,44
3.255.000	Scientific Games International Inc**	5,00%	15/10/2025	3.369.430	0,51
2.070.000	Scientific Games International Inc**	8,25%	15/03/2026	2.222.621	0,34
2.560.000	Scientific Games International Inc**	8,63%	01/07/2025	2.806.400	0,43
2.075.000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc**	9,50%	01/08/2025	2.228.062	0,34
2.300.000	Sensata Technologies BV**	4,88%	15/10/2023	2.470.721	0,37
1.310.000	Sensata Technologies BV**	5,63%	01/11/2024	1.459.818	0,22
848.000	Service Properties Trust**	4,35%	01/10/2024	855.047	0,13
282.000	Service Properties Trust**	4,65%	15/03/2024	287.485	0,04
2.800.000	Sirius XM Radio Inc**	4,63%	15/07/2024	2.880.346	0,44
3.260.000	Sirius XM Radio Inc**	5,00%	01/08/2027	3.423.408	0,52

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund (cont.)

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 89,52% (31 de diciembre de 2020: 84,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
4.710.000	Six Flags Entertainment Corp**	4,88%	31/07/2024	4.762.988	0,72
430.000	Six Flags Theme Parks Inc**	7,00%	01/07/2025	463.981	0,07
2.680.000	Solaris Midstream Holdings LLC**	7,63%	01/04/2026	2.844.150	0,43
3.680.000	Spirit AeroSystems Inc**	5,50%	15/01/2025	3.921.224	0,59
2.135.000	Spirit AeroSystems Inc**	7,50%	15/04/2025	2.285.272	0,35
5.965.000	Sprint Corp**	7,13%	15/06/2024	6.889.575	1,05
1.420.000	Starwood Property Trust Inc**	3,63%	15/07/2026	1.432.425	0,22
5.075.000	Starwood Property Trust Inc*	5,00%	15/12/2021	5.106.719	0,77
605.000	Summer BC Bidco B LLC**	5,50%	31/10/2026	615.854	0,09
1.320.000	Talen Energy Supply LLC*	4,60%	15/12/2021	1.265.543	0,19
4.731.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	5,50%	15/09/2024	4.807.571	0,73
2.440.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	7,50%	01/10/2025	2.679.901	0,41
5.025.000	Taylor Morrison Communities Inc/Taylor Morrison Holdings II Inc**	5,63%	01/03/2024	5.461.522	0,83
2.090.000	Taylor Morrison Communities Inc/Taylor Morrison Holdings II Inc**	5,88%	15/04/2023	2.238.902	0,34
3.215.000	TechnipFMC Plc**	6,50%	01/02/2026	3.472.288	0,53
4.025.000	Tenet Healthcare Corp**	4,63%	01/09/2024	4.139.149	0,63
2.480.000	Tenet Healthcare Corp**	4,88%	01/01/2026	2.575.356	0,39
2.785.000	Tenet Healthcare Corp*	6,75%	15/06/2023	3.042.613	0,46
1.960.000	Tenet Healthcare Corp**	7,50%	01/04/2025	2.119.524	0,32
2.465.000	TK Elevator US Newco Inc**	5,25%	15/07/2027	2.600.575	0,39
4.610.000	TransDigm Inc**	6,25%	15/03/2026	4.869.313	0,74
1.270.000	TransDigm Inc*	7,50%	15/03/2027	1.352.677	0,21
5.500.000	TransDigm Inc**	8,00%	15/12/2025	5.958.095	0,90
2.100.000	TRI Pointe Group Inc/TRI Pointe Homes Inc*	5,88%	15/06/2024	2.341.248	0,36
3.010.000	Trident TPI Holdings Inc**	9,25%	01/08/2024	3.158.453	0,48
3.470.000	Trinseo Materials Operating SCA/Trinseo Materials Finance Inc**	5,38%	01/09/2025	3.563.100	0,54
1.965.263	United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust**	4,88%	15/01/2026	2.087.154	0,32
2.705.000	United Airlines Holdings Inc**	4,88%	15/01/2025	2.810.197	0,43
1.015.000	United Airlines Holdings Inc**	5,00%	01/02/2024	1.056.935	0,16
4.970.000	United Airlines Inc**	4,38%	15/04/2026	5.151.057	0,78
1.315.000	Uniti Group LP/Uniti Fiber Holdings Inc/CSL Capital LLC**	7,13%	15/12/2024	1.361.025	0,21
10.810.000	Uniti Group LP/Uniti Fiber Holdings Inc/CSL Capital LLC**	7,88%	15/02/2025	11.605.940	1,76
2.065.000	US Acute Care Solutions LLC**	6,38%	01/03/2026	2.140.951	0,32
4.080.000	US Foods Inc**	6,25%	15/04/2025	4.329.900	0,66
3.070.000	USA Compression Partners LP/USA Compression Finance Corp**	6,88%	01/04/2026	3.223.285	0,49
2.425.000	Vail Resorts Inc**	6,25%	15/05/2025	2.602.656	0,39
2.760.000	VICI Properties LP/VICI Note Co Inc**	3,50%	15/02/2025	2.823.466	0,43
2.920.000	VICI Properties LP/VICI Note Co Inc**	4,25%	01/12/2026	3.041.092	0,46

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund (cont.)

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 89,52% (31 de diciembre de 2020: 84,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
1.610.000	Watco Cos LLC/Watco Finance Corp**	6,50%	15/06/2027	1.727.401	0,26
2.785.000	Western Midstream Operating LP*	4,35%	01/02/2025	2.946.349	0,45
915.000	WR Grace & Co-Conn**	5,63%	01/10/2024	1.014.676	0,15
6.260.000	Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp**	4,25%	30/05/2023	6.502.575	0,99
1.882.000	Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp**	5,50%	01/03/2025	2.031.224	0,31
Total bonos de empresa				590.052.572	89,52
Préstamos a plazo^ 8,04% (31 de diciembre de 2020: 9,09%)					
Dólar estadounidense					
4.080.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/Aru Finance Corp	10,00%	01/11/2025	4.518.600	0,69
898.167	athenahealth Inc	4,41%	11/02/2026	901.818	0,14
581.708	Aveanna Healthcare LLC	7,25%	18/03/2024	587.162	0,09
1.801.388	Caesars Resort Collection LLC	4,60%	21/07/2025	1.809.269	0,27
1.237.500	Carnival Corp	0,00%	30/06/2025	1.269.731	0,19
259.350	CCRR Parent Inc	5,00%	06/03/2028	261.215	0,04
780.353	Constant Contact Inc	4,75%	10/02/2028	779.378	0,12
773.063	CPC Acquisition Corp	4,50%	29/12/2027	772.703	0,12
1.442.750	Curium BidCo Sarl	5,00%	02/12/2027	1.448.160	0,22
2.612.173	Dealer Tire LLC	4,35%	12/12/2025	2.618.050	0,40
857.927	Endurance International Group Holdings Inc	4,25%	10/02/2028	855.422	0,13
883.325	Epicor Software Corp	4,00%	30/07/2027	883.409	0,13
583.538	First Brands Group LLC	6,00%	30/03/2027	591.319	0,09
2.666.600	Gainwell Acquisition Corp	4,75%	01/10/2027	2.679.933	0,41
1.725.000	Golden Entertainment Inc	0,00%	21/10/2024	1.719.609	0,26
1.547.793	Granite US Holdings Corp	4,15%	30/09/2026	1.555.532	0,24
4.198.062	Great Outdoors Group LLC	5,00%	06/03/2028	4.218.401	0,64
2.279.288	Ivanti Software Inc	5,75%	01/12/2027	2.286.091	0,35
3.588.590	Lower Cadence Holdings LLC	0,00%	22/05/2026	3.570.970	0,54
3.063.387	Mauser Packaging Solutions Holding Co	3,35%	03/04/2024	2.995.180	0,45
1.664.644	MHI Holdings LLC	5,10%	21/09/2026	1.672.968	0,25
16.327	National Mentor Holdings Inc	0,00%	02/03/2028	16.373	0,00
488.571	National Mentor Holdings Inc	4,50%	02/03/2028	489.961	0,07
1.724.277	Nautilus Power LLC	5,25%	16/05/2024	1.629.873	0,25
2.727.503	Redstone Holdco 2 LP	5,50%	27/04/2028	2.726.371	0,41
1.874.858	Seaworld Parks & Entertainment Inc	3,75%	01/04/2024	1.864.312	0,28
1.401.209	Service Logic Acquisition Inc	4,75%	29/10/2027	1.409.091	0,21
1.845.069	Solenis Holdings LLC	4,14%	26/06/2025	1.847.043	0,28

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund (cont.)

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
Préstamos a plazo[^] 8,04% (31 de diciembre de 2020: 9,09%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
3.292.603	Team Health Holdings Inc	3,75%	06/02/2024	3.207.539	0,49
918.063	Tech Data Corp	5,60%	30/06/2025	924.181	0,14
888.168	Verscend Holding Corp	4,10%	27/08/2025	891.658	0,14
Total préstamos a plazo[†]				53.001.322	8,04

Número de acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Fondos de inversión 0,35% (31 de diciembre de 2020: 0,23%)			
Libra esterlina			
1.902.691	NB Global Monthly Income Fund Ltd	2.313.056	0,35
Total fondos de inversión[‡]		2.313.056	0,35
Total inversiones		645.366.950	97,91

Contratos de divisas a plazo 0,15% (31 de diciembre de 2020: 2,24%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
347.406 USD	245.305 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	8.512	0,00
Clases AUD con cobertura						
13.089 USD	17.024 AUD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	307	0,00
13.088 USD	17.024 AUD	19/07/2021	UBS AG	1	306	0,00
12.894 USD	16.770 AUD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	303	0,00
Clases CHF con cobertura						
296.372 USD	272.650 CHF	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	1.272	0,00
296.370 USD	272.650 CHF	19/07/2021	UBS AG	1	1.269	0,00
1.274.279 USD	1.165.895 CHF	19/07/2021	Westpac Banking Corp	10	12.382	0,00
Clases CNY con cobertura						
855.655 CNY	130.076 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	2.192	0,00
855.655 CNY	130.073 USD	19/07/2021	UBS AG	1	2.196	0,00
860.572 CNY	130.760 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	2.268	0,00
Clases EUR con cobertura						
137.232 €	162.793 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	8	0,00
20.586.174 USD	17.171.157 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	215.569	0,03
20.577.657 USD	17.171.157 €	19/07/2021	UBS AG	1	207.052	0,03
24.795.912 USD	20.673.322 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	44	270.596	0,04
Clases GBP con cobertura						
8.963.913 £	12.338.888 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	44.926	0,01
8.963.913 £	12.340.107 USD	19/07/2021	UBS AG	1	43.707	0,01
8.860.004 £	12.191.883 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	48.380	0,01
1.418.857 USD	1.017.594 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	17	13.033	0,00

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,15% (31 de diciembre de 2020: 2,24%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases JPY con cobertura						
16.770 USD	1.825.081 ¥	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	324	0,00
16.753 USD	1.825.080 ¥	19/07/2021	UBS AG	1	307	0,00
23.115.226 USD	2.552.797.839 ¥	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	111.770	0,02
Clases SGD con cobertura						
6.496 SGD	4.828 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	5	0,00
122.376 USD	163.616 SGD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	660	0,00
122.366 USD	163.616 SGD	19/07/2021	UBS AG	1	651	0,00
139.519 USD	186.502 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	7	780	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					988.775	0,15
					Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados					646.355.725	98,06

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,85%) (31 de diciembre de 2020: (0,35%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
2.711.355 USD	1.966.317 £	19/07/2021	UBS AG	1	(5.150)	(0,00)
Clases AUD con cobertura						
163.710 AUD	125.865 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(2.948)	(0,00)
163.710 AUD	125.857 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(2.941)	(0,00)
212.431 AUD	163.559 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	6	(4.063)	(0,00)
Clases CHF con cobertura						
987.261 CHF	1.073.498 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	4	(4.945)	(0,00)
961.533 CHF	1.045.183 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(4.476)	(0,00)
959.091 CHF	1.042.506 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	(4.442)	(0,00)
Clases CNY con cobertura						
27.037 USD	177.854 CNY	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(456)	(0,00)
27.037 USD	177.854 CNY	19/07/2021	UBS AG	1	(456)	(0,00)
26.622 USD	175.200 CNY	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(460)	(0,00)
Clases EUR con cobertura						
39.822.794 €	47.752.403 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(509.553)	(0,08)
39.778.097 €	47.666.797 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(476.972)	(0,07)
48.069.437 €	57.695.523 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	46	(669.461)	(0,10)

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (0,85%) (31 de diciembre de 2020: (0,35%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases GBP con cobertura						
251.421 £	352.894 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(5.551)	(0,00)
7.054.591 £	9.885.818 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	14	(139.768)	(0,02)
2.008.617 USD	1.459.213 £	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(7.313)	(0,00)
2.008.816 USD	1.459.213 £	19/07/2021	UBS AG	1	(7.115)	(0,00)
2.014.006 USD	1.463.673 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	(8.087)	(0,00)
Clases JPY con cobertura						
7.213.937.577 ¥	66.288.373 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(1.283.033)	(0,20)
7.210.763.027 ¥	66.184.960 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(1.208.226)	(0,19)
7.147.962.612 ¥	65.680.610 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	(1.269.775)	(0,19)
Clases SGD con cobertura						
271.955 SGD	203.407 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(1.098)	(0,00)
271.955 SGD	203.391 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(1.082)	(0,00)
337.604 SGD	252.815 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	15	(1.670)	(0,00)
4.990 USD	6.710 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	(1)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(5.619.042)	(0,85)
					Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados					(5.619.042)	(0,85)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados					640.736.683	97,21
Otro activo neto					18.389.166	2,79
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables					659.125.849	100,00

^ Puede que los préstamos a plazo con cupón del 0,00% no se hayan liquidado a 30 de junio de 2021, por lo que no tienen tipos de interés efectivos. Los tipos de interés no tienen efecto hasta la liquidación.

Análisis de la cartera		USD	% de los Activos totales
*	Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	90.408.616	13,00
**	Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	499.643.956	71,85
†	Otros valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario	53.001.322	7,62
μ	Fondos de inversión	2.313.056	0,33
∞	Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(4.630.267)	(0,67)
Total inversiones		640.736.683	92,13

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
6.790.000	New Fortress Energy Inc, 6.50%, 30/09/2026	6.822.680
6.050.000	Iron Mountain Inc, 4.88%, 15/09/2027	6.335.000
5.830.000	CD&R Smokey Buyer Inc, 6.75%, 15/07/2025	6.267.259
5.725.000	Carvana Co, 5.63%, 01/10/2025	5.952.163
5.515.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.50%, 20/04/2026	5.576.125
4.970.000	United Airlines Inc, 4.38%, 15/04/2026	5.080.825
4.520.000	Carnival Corp, 7.63%, 01/03/2026	4.972.000
4.805.000	Bausch Health Companies Inc, 6.13%, 15/04/2025	4.902.004
4.610.000	TransDigm Inc, 6.25%, 15/03/2026	4.892.085
4.260.000	Uniti Group LP/Uniti Fiber Holdings Inc/CSL Capital LLC, 7.88%, 15/02/2025	4.591.700
4.240.000	KAR Auction Services Inc, 5.13%, 01/06/2025	4.356.600
4.230.000	FirstEnergy Corp, 2.05%, 01/03/2025	4.242.013
4.219.157	Great American Outdoors Group LLC, 5.00%, 06/03/2028	4.198.062
3.750.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp, 9.38%, 01/04/2027	4.192.938
4.170.000	Apex Tool Group LLC / BC Mountain Finance Inc, 9.00%, 15/02/2023	4.182.260
3.660.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp, 7.63%, 15/06/2025	3.990.950
3.000.000	NCL Corp Ltd, 12.25%, 15/05/2024	3.632.475
3.110.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc, 5.75%, 15/04/2026	3.405.450
3.275.000	Life Time Inc, 5.75%, 15/01/2026	3.350.725
3.050.000	Altice France SA, 8.13%, 01/02/2027	3.349.288
3.260.000	Radiate Holdco LLC/Radiate Finance Inc, 4.50%, 15/09/2026	3.333.350
3.250.000	Legends Hospitality Holding Co. LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc, 5.00%, 01/02/2026	3.331.369
3.140.000	Resideo Funding Inc, 6.13%, 01/11/2026	3.328.400
3.215.000	TechnipFMC Plc, 6.50%, 01/02/2026	3.315.238
3.430.000	NCL Corp Ltd, 3.63%, 15/12/2024	3.306.100
3.035.000	CHS/Community Health Systems Inc, 8.00%, 15/03/2026	3.255.038
3.060.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc, 6.25%, 15/01/2028	3.239.350
2.800.000	Altice France Holding SA, 10.50%, 15/05/2027	3.160.500
2.660.000	EQT Corp, 7.63%, 01/02/2025	3.137.138
2.950.000	Banjay Entertainment SASU, 5.38%, 01/03/2025	3.049.150
2.920.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 4.25%, 01/12/2026	3.008.788
2.545.000	Carnival Corp, 10.50%, 01/02/2026	2.991.800
2.530.000	Royal Caribbean Cruises Ltd, 11.50%, 01/06/2025	2.941.125

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund (cont.)

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
12.590.000	EQM Midstream Partners LP, 4.75%, 15/07/2023	13.329.663
10.497.000	Colfax Corp, 6.00%, 15/02/2024	10.851.274
8.703.000	TransDigm Inc, 6.50%, 15/07/2024	8.859.654
8.115.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co, 5.50%, 15/04/2024	8.204.079
7.735.000	ADT Security Corp, 4.13%, 15/06/2023	8.150.756
7.020.376	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc, 2.75%, 23/09/2026	7.037.927
6.360.000	Occidental Petroleum Corp, 5.88%, 01/09/2025	7.028.880
6.240.000	Netflix Inc, 5.75%, 01/03/2024	7.004.400
6.431.000	INEOS Group Holdings SA, 5.63%, 01/08/2024	6.511.388
5.925.000	Mileage Plus Holdings LLC/Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 6.50%, 20/06/2027	6.510.084
6.030.000	Iron Mountain Inc, 4.88%, 15/09/2027	6.286.777
6.110.000	ESH Hospitality Inc, 5.25%, 01/05/2025	6.237.348
5.165.000	Carnival Corp, 11.50%, 01/04/2023	5.936.656
5.796.187	Rackspace Technology Global Inc, 4.00%, 03/11/2023	5.796.187
5.150.000	Park Aerospace Holdings Ltd, 5.50%, 15/02/2024	5.627.817
5.145.000	American Axle & Manufacturing Inc, 6.25%, 01/04/2025	5.318.644
5.115.000	Ford Motor Credit Co LLC, 3.81%, 12/10/2021	5.200.472
4.940.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp, 4.88%, 01/06/2023	5.137.600
4.310.000	Sprint Corp, 7.13%, 15/06/2024	4.975.734
4.560.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc, 5.25%, 15/04/2024	4.890.375
4.760.000	DCP Midstream Operating LP, 4.75%, 30/09/2021	4.827.830
4.624.382	Bass Pro Group LLC, 5.75%, 25/09/2024	4.624.382
4.430.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 4.75%, 15/05/2022	4.567.109
4.436.000	Calpine Corp, 5.25%, 01/06/2026	4.563.535
4.460.000	Beacon Roofing Supply Inc, 4.88%, 01/11/2025	4.538.050
4.115.000	AssuredPartners Inc, 7.00%, 15/08/2025	4.238.450
4.230.000	FirstEnergy Corp, 2.05%, 01/03/2025	4.230.000

Neuberger Berman Global Bond Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al -3,00%. En el mismo periodo, el índice de referencia, el Bloomberg Barclays Global Aggregate Index (Total Return, Unhedged, USD) (el "Índice"), rindió un -3,21%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Los mercados de renta fija sufrieron altibajos en el primer semestre del año. Los mercados se pusieron a prueba en el primer trimestre, con una pronunciada caída de las rentabilidades de los bonos de deuda pública provocada por el creciente optimismo con respecto al ritmo de la recuperación económica, el aumento de la inflación (tanto materializada como esperada) y la magnitud de los futuros estímulos fiscales. En el segundo trimestre asistimos a un cambio de tendencia en la deuda pública, con las rentabilidades de las economías del G4 entre estables y más bajas y un continuo estrechamiento de los diferenciales de crédito. Dicho esto, las rentabilidades de los bonos de deuda pública a plazo intermedio avanzaron durante el periodo analizado —lo que supuso un viento de cara para los títulos más sensibles a los tipos—, mientras que los diferenciales de crédito se contrajeron.

La asignación a valores del Tesoro de EE. UU. Protegidos contra la inflación fue lo que más contribuyó a la rentabilidad superior en comparación con el índice de referencia. La sobreponderación y la selección de valores en crédito global con grado de inversión fueron particularmente positivas. La exposición de la Cartera a deuda de mercados emergentes, la selección de valores en deuda soberana global de mercados desarrollados y las sobreponderaciones en valores estadounidenses con garantía hipotecaria, valores respaldados por hipotecas comerciales y valores respaldados por activos también favorecieron durante el periodo. La rentabilidad relativa del posicionamiento de la Cartera en tipos de interés fue moderada en términos generales. La infraponderación de tipos de EE. UU., de países centrales europeos y de RU, así como el posicionamiento en la curva de tipos de Canadá favorecieron; sin embargo, esto se vio compensado por la sobreponderación de tipos de Oceanía y la ausencia de exposición a tipos de China.

Creemos probable que la volatilidad del mercado aumente en el segundo semestre del año. Prevemos una retirada gradual de estímulos y un giro de política de la Reserva Federal (la "Fed") y del Banco Central Europeo ("BCE") en el segundo semestre de 2021, lo cual obligará a los mercados a adaptarse a una política monetaria menos acomodaticia incluso con una comunicación y previsión perfectas de los bancos centrales. En segundo lugar, es probable que los mercados se muestren más reactivos a los datos económicos reales. Un avance significativo, tanto al alza como a la baja, del crecimiento y la inflación probablemente afectaría a la trayectoria de la política de los bancos centrales.

Por otra parte, se ha reducido la probabilidad de unos resultados económicos de "cola derecha". De la reunión de la Fed celebrada en junio se desprende que no es deseable permanecer mucho tiempo con tasas de inflación del 3,5%. Por consiguiente, invertir durante periodos prolongados de inflación notablemente superior al 2% probablemente no tenga sentido, dado que la Fed ha definido su umbral de tolerancia de aumento de la inflación, incluso en el contexto de su nuevo marco del objetivo de inflación media. Cuando la Fed comience finalmente a subir los tipos, puede que el ritmo sea más fuerte de lo que se espera actualmente, dependiendo del nivel y de la evolución de la inflación.

Aunque el cambio de tono de la Fed fue el principal acontecimiento en los mercados de renta fija en el primer semestre del año, el segundo semestre debería representar una especie de punto de inflexión para la zona euro a medida que se normalice la actividad. Los sectores de servicios europeos han reabierto gradualmente a medida que se ha ido controlando la pandemia de la COVID-19. Desde julio, el Euro Recovery Fund comenzará a repartir "becas" a países específicos para financiar el gasto en activos fijos durante los próximos trimestres. Además, el BCE ha introducido un nuevo mecanismo de flexibilidad en su programa de compras de bonos, que debería permitirle iniciar sin contratiempos la retirada gradual del Programa de Compras de Emergencia frente a la Pandemia ("PEPP").

Prevemos un entorno constante en el que los tipos de interés se moverán de manera dentro de una banda, con un sesgo alcista en respuesta a una recuperación económica mundial duradera. Prevemos que las tasas de equilibrio de la inflación estadounidense se negocien en un rango más estrecho; una conclusión duradera probable que cabría extraer de la reunión de la Fed en junio es que la probabilidad de que la Fed tolere un movimiento alcista más estructural de las tasas de inflación es bastante baja. También es importante destacar que, en nuestra opinión, los detonantes subyacentes de los estrechos diferenciales de crédito, el fuerte crecimiento económico y las bajas tasas de impago probablemente no se vean demasiado afectados por la evolución del panorama de los bancos centrales.

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		224.172.753	266.609.208
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	28.763.590	5.133.709
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		1.592.398	1.251.014
Cuentas a percibir por acciones emitidas		–	33.565
Cuentas por cobrar de intermediarios		1.693.528	1.190.072
Ingresos a percibir y otros activos		1.143.219	1.543.131
Activos totales		257.365.488	275.760.699
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		2.624.956	3.861.522
Descubierto bancario	3	1.527	–
Adeudado a los intermediarios		430.000	810.000
Gastos devengados		49.424	40.881
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		9.720.250	20.871.272
Otras cuentas por pagar		40.978	28.900
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		12.867.135	25.612.575
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		244.498.353	250.148.124

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		2.683.404	2.487.158
Ingresos por préstamo de valores	15	97	–
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(9.611.027)	3.297.946
		(6.927.526)	5.785.104
Gastos			
Comisión de gestión	5	18.032	16.308
Comisión de distribución	5	11.666	5.062
Comisión de administración	5	126.283	133.923
Comisión de compromiso	16	17.765	10.933
Comisión de depósito	5	7.486	7.809
Comisión del Depositario	5	6.032	10.679
Honorarios profesionales	7	58.057	32.729
Honorarios de los Consejeros	6	1.932	2.380
Costes de transacciones	7	37.168	35.714
Honorarios de auditoría	7	8.482	8.201
Reembolso de IVA		(1.150)	(777)
Otros gastos	7	19	7.697
Gastos no asumidos	5	(174)	(12.467)
Gastos totales		291.598	258.191
Costes financieros			
Gastos por intereses		140	–
Repartos de dividendos abonados	1	1.127	977
		1.267	977
Impuestos retenidos en origen		1.065	15.792
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		(7.221.456)	5.510.144

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	250.148.124	203.117.688
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	(7.221.456)	5.510.144
Suscripciones	11.587.061	31.814.436
Reembolsos	(10.015.376)	(14.611.470)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	244.498.353	225.830.798

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

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 Tesoro 0,78% (31 de diciembre de 2020: 0,76%)					
Dólar estadounidense					
1.900.000	United States Treasury Bill	0,00%	02/12/2021	1.899.621	0,78
Total bonos del Tesoro **				1.899.621	0,78
Bonos de agencia 1,16% (31 de diciembre de 2020: 1,17%)					
Dólar estadounidense					
490.000	Federal Home Loan Banks*	5,50%	15/07/2036	721.564	0,30
265.000	Federal Home Loan Mortgage Corp**	0,38%	23/09/2025	260.961	0,11
300.000	Federal National Mortgage Association**	0,50%	07/11/2025	296.566	0,12
835.000	Federal National Mortgage Association**	0,75%	08/10/2027	814.831	0,33
640.000	Federal National Mortgage Association**	0,88%	05/08/2030	606.488	0,25
85.000	Tennessee Valley Authority*	5,88%	01/04/2036	126.479	0,05
Total bonos de agencia				2.826.889	1,16
Valores respaldados por activos 6,78% (31 de diciembre de 2020: 6,82%)					
Euro					
787.511	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC Class A	0,95%	24/02/2058	935.427	0,38
370.112	Gedesco Trade Receivables 2020-1 DAC Class A	0,64%	24/01/2026	439.402	0,18
400.000	Last Mile Securities - PE 2021 DAC Series 2021-1X Class A2	1,05%	17/08/2031	475.907	0,19
936.242	Miravet Sarl Series 20019-1 Class A	0,00%	26/05/2065	1.116.410	0,46
641.659	Pembroke Property Finance DAC	0,66%	01/06/2037	762.039	0,31
Total euro				3.729.185	1,52
Libra esterlina					
200.000	Gemgarto 2021-1 Plc Series 2021-1X Class B	1,15%	16/12/2067	277.503	0,11
120.000	Mortimer BTL 2021-1 Plc Series 2021-1 Class C	0,00%	23/06/2053	166.075	0,07
650.000	PCL Funding IV Plc Series 2020-1 Class A	1,10%	15/09/2024	902.969	0,37
932.000	Ripon Mortgages Plc Class D1	1,88%	20/08/2056	1.297.568	0,53
300.000	Sage AR Funding No 1 Plc Series 1X Class A	0,00%	17/11/2030	415.533	0,17
391.334	Together Asset Backed Securitisation Series 2021-CRE1 Class A	1,45%	20/01/2055	541.912	0,22
482.705	Towd Point Mortgage Funding 2018 - Auburn 12 Plc Class A	0,88%	20/02/2045	668.320	0,27
500.000	Towd Point Mortgage Funding 2020 - Auburn Series 2020-A14X Class B	1,25%	20/05/2045	697.704	0,29
500.000	Tower Bridge Funding 2021-1 Plc Series 2021-1 Class B	0,00%	21/07/2064	697.333	0,29
Total libra esterlina				5.664.917	2,32
Dólar estadounidense					
215.000	CD 2017-CD3 Mortgage Trust Class A4	3,63%	10/02/2050	237.953	0,10
1.105.000	CD 2017-CD6 Mortgage Trust Class ASB	3,33%	13/11/2050	1.192.270	0,49
340.000	CD 2018-CD7 Mortgage Trust Class A4	4,28%	15/08/2051	392.913	0,16

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

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
Valores respaldados por activos (ABS) 6,78% (31 de diciembre de 2020: 6,82%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
1.148.029	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 Class XA	1,48%	10/02/2048	46.047	0,02
215.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-C4 Class A4	3,47%	12/10/2050	236.819	0,10
575.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2018-C6 Class A4	4,41%	10/11/2051	671.526	0,27
305.000	COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust Class AM	4,43%	10/02/2047	329.786	0,13
620.000	COMM 2014-CCRE17 Mortgage Trust Class A5	3,98%	10/05/2047	671.361	0,27
1.901.329	COMM 2014-CCRE17 Mortgage Trust Class XA	1,12%	10/05/2047	42.321	0,02
590.000	COMM 2014-LC15 Mortgage Trust Class AM	4,20%	10/04/2047	635.970	0,26
2.074.600	COMM 2014-LC15 Mortgage Trust Class XA	1,23%	10/04/2047	48.130	0,02
160.567	COMM 2014-UBS2 Mortgage Trust Class ASB	3,47%	10/03/2047	166.768	0,07
1.670.694	COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust Class XA	1,23%	10/06/2047	43.451	0,02
2.584.700	Csail 2015-C2 Commercial Mortgage Trust Class XA	0,89%	15/06/2057	61.243	0,02
505.000	CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust Class A4	4,22%	15/08/2051	579.232	0,24
706.341	Fannie Mae REMICS Class HS	5,91%	25/07/2042	139.292	0,06
564.385	Fannie Mae REMICS Class PI	3,50%	25/12/2042	79.948	0,03
998.534	Fannie Mae REMICS Class SA	5,76%	25/07/2046	216.930	0,09
601.841	Freddie Mac REMICS Class HS	6,38%	15/03/2042	107.935	0,04
887.092	Freddie Mac REMICS Class SA	5,98%	15/04/2046	185.692	0,08
652.449	Freddie Mac Strips Class S1	5,88%	15/09/2043	115.419	0,05
733.820	Government National Mortgage Association Class IT	3,50%	20/02/2043	134.579	0,05
873.021	Government National Mortgage Association Class SC	6,08%	16/02/2047	173.351	0,07
1.361.558	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC18 Class XA	1,17%	10/01/2047	28.530	0,01
2.713.766	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC30 Class XA	0,88%	10/05/2050	66.973	0,03
260.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 Class A5	3,64%	15/10/2048	284.196	0,12
3.124	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-BNK1 Class A1	1,32%	15/08/2049	3.123	0,00
210.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C46 Class A4	4,15%	15/08/2051	241.371	0,10
2.012.926	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 Class XA	1,18%	15/08/2047	51.240	0,02
Total dólar estadounidense				7.184.369	2,94
Total valores respaldados por activos **				16.578.471	6,78
Bonos de empresa 29,06% (31 de diciembre de 2020: 28,55%)					
Dólar canadiense					
300.000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc [†]	4,32%	15/05/2047	259.016	0,11
500.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada [†]	2,20%	29/05/2028	404.299	0,17
500.000	General Motors Financial of Canada Ltd [†]	1,75%	15/04/2026	399.882	0,16
300.000	John Deere Financial Inc [†]	1,34%	08/09/2027	235.220	0,10
500.000	Verizon Communications Inc [†]	2,50%	16/05/2030	403.205	0,16
300.000	Walt Disney Co [†]	3,06%	30/03/2027	256.583	0,10

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

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 29,06% (31 de diciembre de 2020: 28,55%) (cont.)					
Dólar canadiense (cont.)					
500.000	Wells Fargo & Co [†]	2,98%	19/05/2026	424.392	0,17
Total dólar canadiense				2.382.597	0,97
Euro					
600.000	ABN AMRO Bank NV [*]	0,60%	15/01/2027	721.881	0,29
436.000	American Tower Corp [*]	0,50%	15/01/2028	512.309	0,21
300.000	Anglo American Capital Plc [*]	3,25%	03/04/2023	376.236	0,15
300.000	AT&T Inc [*]	0,25%	04/03/2026	357.607	0,15
300.000	BAT Netherlands Finance BV [*]	2,38%	07/10/2024	380.135	0,16
600.000	BP Capital Markets Plc [*]	3,63%	29/12/2049	773.657	0,32
506.000	Credit Suisse Group AG [*]	1,00%	24/06/2027	612.693	0,25
600.000	Digital Dutch Finco BV [*]	1,00%	15/01/2032	704.035	0,29
500.000	Digital Dutch Finco BV [*]	1,50%	15/03/2030	625.340	0,26
1.200.000	Digital Intrepid Holding BV [*]	0,63%	15/07/2031	1.371.441	0,56
800.000	EEW Energy from Waste GmbH [*]	0,36%	30/06/2026	950.874	0,39
1.700.000	EON SE [*]	0,63%	07/11/2031	2.015.503	0,82
735.000	European Union [*]	0,00%	04/07/2031	869.280	0,36
200.000	Fidelity National Information Services Inc [*]	1,00%	03/12/2028	243.834	0,10
553.000	General Motors Financial Co Inc [*]	0,85%	26/02/2026	667.228	0,27
560.000	General Motors Financial Co Inc [*]	0,96%	07/09/2023	676.730	0,28
600.000	Glencore Capital Finance DAC [*]	1,13%	10/03/2028	722.832	0,30
400.000	Infineon Technologies AG [*]	1,63%	24/06/2029	510.555	0,21
289.000	JPMorgan Chase & Co [*]	1,64%	18/05/2028	368.801	0,15
380.000	Morgan Stanley [*]	1,75%	30/01/2025	479.045	0,20
700.000	National Grid North America Inc [*]	1,00%	12/07/2024	854.871	0,35
905.000	Nationwide Building Society [*]	2,00%	25/07/2029	1.128.881	0,46
600.000	Royal Mail Plc [*]	1,25%	08/10/2026	745.663	0,30
500.000	Shell International Finance BV [*]	1,50%	07/04/2028	644.541	0,26
500.000	Vantage Towers AG [*]	0,75%	31/03/2030	591.136	0,24
792.000	Verizon Communications Inc [*]	0,75%	22/03/2032	926.584	0,38
600.000	Volkswagen Bank GmbH [*]	1,25%	10/06/2024	737.402	0,30
312.000	Volkswagen Bank GmbH [*]	1,25%	15/12/2025	387.491	0,16
695.000	Volkswagen Leasing GmbH [*]	1,38%	20/01/2025	861.648	0,35
Total euro				20.818.233	8,52
Libra esterlina					
360.000	Anglo American Capital Plc [*]	3,38%	11/03/2029	543.385	0,22
800.000	Discovery Communications LLC [*]	2,50%	20/09/2024	1.151.537	0,47

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

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 29,06% (31 de diciembre de 2020: 28,55%) (cont.)					
Libra esterlina (cont.)					
520.000	Enel Finance International NV*	5,63%	14/08/2024	824.753	0,34
251.000	EON International Finance BV*	6,38%	07/06/2032	490.051	0,20
765.000	National Grid Gas Plc*	1,38%	07/02/2031	1.005.465	0,41
300.000	Phoenix Group Holdings*	5,75%	07/07/2021	414.706	0,17
380.000	Principality Building Society*	2,38%	23/11/2023	541.136	0,22
280.000	SP Manweb Plc*	4,88%	20/09/2027	468.325	0,19
600.000	Volkswagen Financial Services NV*	4,25%	09/10/2025	936.880	0,39
Total libra esterlina				6.376.238	2,61
Dólar estadounidense					
225.000	7-Eleven Inc**	1,80%	10/02/2031	215.372	0,09
140.000	AbbVie Inc**	2,30%	21/11/2022	143.728	0,06
1.035.000	AbbVie Inc*	2,95%	21/11/2026	1.113.302	0,45
122.000	Altria Group Inc*	3,40%	04/02/2041	116.551	0,05
270.000	Amazon.com Inc**	3,10%	12/05/2051	283.987	0,12
220.000	American Express Co*	3,70%	05/11/2021	222.015	0,09
405.000	Anheuser-Busch Cos LLC/Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc*	4,90%	01/02/2046	513.527	0,21
320.000	Apple Inc**	2,38%	08/02/2041	310.857	0,13
140.000	Apple Inc**	2,55%	20/08/2060	130.991	0,05
165.000	Apple Inc**	3,35%	09/02/2027	183.396	0,07
325.000	AT&T Inc*	2,25%	01/02/2032	319.330	0,13
100.000	AT&T Inc*	3,50%	01/06/2041	104.062	0,04
714.000	AT&T Inc**	3,50%	15/09/2053	718.418	0,29
120.000	AT&T Inc**	3,65%	15/09/2059	121.874	0,05
400.000	Banco Santander SA*	2,75%	03/12/2030	396.605	0,16
285.000	Bank of America Corp**	2,59%	29/04/2031	294.023	0,12
690.000	Bank of America Corp**	2,69%	22/04/2032	710.333	0,29
210.000	Bank of America Corp**	3,71%	24/04/2028	232.343	0,09
510.000	Bank of America Corp*	4,45%	03/03/2026	579.514	0,24
280.000	BAT Capital Corp*	2,26%	25/03/2028	278.200	0,11
365.000	BNP Paribas SA**	3,50%	01/03/2023	383.000	0,16
328.000	Boeing Co*	2,20%	04/02/2026	331.187	0,14
730.000	Boeing Co*	3,63%	01/02/2031	785.916	0,32
80.000	Boeing Co*	5,71%	01/05/2040	103.182	0,04
175.000	Boeing Co*	5,81%	01/05/2050	236.047	0,10
95.000	Boeing Co*	5,93%	01/05/2060	131.430	0,05
47.000	Broadcom Inc**	3,15%	15/11/2025	50.405	0,02
293.000	Broadcom Inc**	3,42%	15/04/2033	308.035	0,13

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

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 29,06% (31 de diciembre de 2020: 28,55%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
430.000	Broadcom Inc**	5,00%	15/04/2030	507.822	0,21
150.000	Capital One Financial Corp*	3,20%	30/01/2023	156.218	0,06
320.000	Carrier Global Corp**	2,49%	15/02/2027	335.178	0,14
225.000	Carrier Global Corp**	2,72%	15/02/2030	233.467	0,10
190.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	2,80%	01/04/2031	194.461	0,08
175.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	3,70%	01/04/2051	173.500	0,07
175.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	4,46%	23/07/2022	181.199	0,07
110.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	4,80%	01/03/2050	126.576	0,05
475.000	Cigna Corp*	2,40%	15/03/2030	485.030	0,20
349.000	Cigna Corp*	3,75%	15/07/2023	371.777	0,15
335.000	Citigroup Inc**	3,35%	24/04/2025	357.142	0,15
150.000	Citigroup Inc**	3,89%	10/01/2028	167.075	0,07
515.000	Comcast Corp**	2,35%	15/01/2027	540.649	0,22
185.000	Comcast Corp**	3,30%	01/02/2027	203.528	0,08
240.000	Commonwealth Edison Co**	4,00%	01/03/2049	288.186	0,12
510.000	Constellation Brands Inc*	2,88%	01/05/2030	535.369	0,22
301.000	Constellation Brands Inc*	3,15%	01/08/2029	323.251	0,13
120.000	Crown Castle International Corp*	1,05%	15/07/2026	117.312	0,05
120.000	Crown Castle International Corp*	2,10%	01/04/2031	117.056	0,05
345.000	CVS Health Corp*	1,75%	21/08/2030	333.016	0,14
195.000	CVS Health Corp*	3,00%	15/08/2026	210.496	0,09
115.000	Dell International LLC/EMC Corp*	6,02%	15/06/2026	138.123	0,06
175.000	DTE Energy Co*	1,05%	01/06/2025	175.035	0,07
190.000	Duke Energy Corp*	3,50%	15/06/2051	197.415	0,08
155.000	Duke Energy Indiana LLC*	3,25%	01/10/2049	164.433	0,07
190.000	Energy Transfer LP*	2,90%	15/05/2025	200.056	0,08
570.000	Entergy Texas Inc*	1,75%	15/03/2031	547.265	0,22
330.000	Enterprise Products Operating LLC*	4,25%	15/02/2048	378.589	0,15
380.000	Essex Portfolio LP*	2,65%	15/03/2032	386.315	0,16
185.000	European Investment Bank*	0,63%	21/10/2027	177.784	0,07
1.770.000	European Investment Bank*	1,63%	14/03/2025	1.830.069	0,75
90.000	Evergy Inc*	2,45%	15/09/2024	94.317	0,04
245.000	Fortinet Inc**	1,00%	15/03/2026	242.876	0,10
235.000	General Motors Co*	6,80%	01/10/2027	296.183	0,12
175.000	Gilead Sciences Inc**	2,80%	01/10/2050	168.952	0,07
155.000	Glencore Funding LLC**	3,88%	27/04/2051	162.710	0,07
340.000	Goldman Sachs Group Inc**	1,99%	27/01/2032	330.506	0,13
760.000	Goldman Sachs Group Inc**	2,62%	22/04/2032	776.930	0,32

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

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 29,06% (31 de diciembre de 2020: 28,55%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
460.000	Goldman Sachs Group Inc**	3,27%	29/09/2025	492.261	0,20
265.000	HSBC Holdings Plc*	2,01%	22/09/2028	266.065	0,11
890.000	Inter-American Development Bank*	1,13%	13/01/2031	859.795	0,35
155.000	International Business Machines Corp*	3,30%	15/05/2026	170.614	0,07
130.000	Interstate Power & Light Co**	2,30%	01/06/2030	132.094	0,05
650.000	JPMorgan Chase & Co**	1,95%	04/02/2032	631.775	0,26
150.000	JPMorgan Chase & Co**	2,53%	19/11/2041	143.283	0,06
295.000	JPMorgan Chase & Co**	2,74%	15/10/2030	309.003	0,13
1.215.000	JPMorgan Chase & Co**	3,22%	01/03/2025	1.291.121	0,53
175.000	Kentucky Utilities Co*	3,30%	01/06/2050	185.430	0,08
130.000	Kinder Morgan Inc*	5,55%	01/06/2045	168.573	0,07
990.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*	2,38%	29/12/2022	1.021.786	0,42
155.000	Magellan Midstream Partners LP*	3,25%	01/06/2030	167.091	0,07
680.000	Marathon Petroleum Corp*	4,70%	01/05/2025	767.447	0,31
320.000	Marvell Technology Inc**	2,45%	15/04/2028	326.475	0,13
280.000	Marvell Technology Inc**	2,95%	15/04/2031	290.460	0,12
580.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc*	2,62%	18/07/2022	594.377	0,24
335.000	Morgan Stanley**	1,93%	28/04/2032	325.952	0,13
490.000	Morgan Stanley**	2,70%	22/01/2031	513.327	0,21
235.000	Morgan Stanley**	2,72%	22/07/2025	247.301	0,10
260.000	Morgan Stanley*	3,63%	20/01/2027	288.532	0,12
185.000	Morgan Stanley**	3,77%	24/01/2029	207.771	0,08
170.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc**	1,90%	15/06/2028	172.099	0,07
255.000	Oracle Corp*	3,60%	01/04/2050	262.272	0,11
200.000	Oracle Corp*	3,65%	25/03/2041	212.404	0,09
215.000	Oracle Corp*	3,85%	01/04/2060	228.863	0,09
155.000	Oracle Corp*	3,95%	25/03/2051	169.384	0,07
142.000	Oracle Corp*	4,00%	15/07/2046	154.247	0,06
424.000	Pacific Gas & Electric Co*	3,25%	01/06/2031	417.534	0,17
100.000	Pacific Gas & Electric Co*	3,30%	01/08/2040	90.522	0,04
165.000	Phillips 66*	1,30%	15/02/2026	165.031	0,07
330.000	Pioneer Natural Resources Co*	2,15%	15/01/2031	323.826	0,13
455.000	Societe Generale SA**	1,49%	14/12/2026	451.191	0,18
235.000	Southern Co Gas Capital Corp*	1,75%	15/01/2031	222.723	0,09
195.000	Southwestern Public Service Co**	3,15%	01/05/2050	204.312	0,08
570.000	Starbucks Corp**	2,55%	15/11/2030	591.132	0,24
800.000	State Street Corp**	2,35%	01/11/2025	841.220	0,34
160.000	Stryker Corp*	0,60%	01/12/2023	159.951	0,07

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

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 29,06% (31 de diciembre de 2020: 28,55%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
195.000	Suncor Energy Inc*	3,10%	15/05/2025	208.526	0,08
343.000	Sysco Corp*	6,60%	01/04/2050	533.752	0,22
185.000	T-Mobile USA Inc*	2,05%	15/02/2028	188.318	0,08
265.000	T-Mobile USA Inc*	2,55%	15/02/2031	268.710	0,11
340.000	T-Mobile USA Inc*	3,88%	15/04/2030	381.225	0,16
190.000	T-Mobile USA Inc*	4,38%	15/04/2040	223.331	0,09
405.000	Ventas Realty LP*	3,50%	15/04/2024	433.742	0,18
175.000	Verizon Communications Inc*	1,50%	18/09/2030	167.431	0,07
80.000	Verizon Communications Inc*	2,65%	20/11/2040	77.130	0,03
415.000	Verizon Communications Inc*	3,70%	22/03/2061	445.185	0,18
705.000	Viatris Inc**	4,00%	22/06/2050	746.853	0,31
200.000	Volkswagen Group of America Finance LLC**	3,13%	12/05/2023	208.962	0,09
205.000	Volkswagen Group of America Finance LLC**	3,35%	13/05/2025	221.319	0,09
310.000	Volkswagen Group of America Finance LLC**	3,75%	13/05/2030	348.214	0,14
390.000	Wells Fargo & Co**	2,19%	30/04/2026	405.059	0,17
615.000	Wells Fargo & Co**	2,88%	30/10/2030	651.792	0,27
340.000	Wells Fargo & Co**	3,07%	30/04/2041	349.399	0,14
Total dólar estadounidense				41.469.688	16,96
Total bonos de empresa				71.046.756	29,06
Bonos del Estado 41,78% (31 de diciembre de 2020: 52,23%)					
Dólar australiano					
1.320.000	Australia Government Bond*	3,00%	21/03/2047	1.135.897	0,46
Total dólar australiano				1.135.897	0,46
Dólar canadiense					
1.730.000	Canada Housing Trust No 1*	2,90%	15/06/2024	1.484.069	0,61
3.260.000	International Bank for Reconstruction & Development*	2,50%	03/08/2023	2.738.779	1,12
1.800.000	Province of Alberta Canada**	2,90%	20/09/2029	1.567.929	0,64
1.325.000	Province of British Columbia Canada**	2,95%	18/12/2028	1.166.937	0,48
3.170.000	Province of Ontario Canada**	1,35%	02/12/2030	2.423.121	0,99
2.285.000	Province of Ontario Canada**	2,70%	02/06/2029	1.970.909	0,81
1.800.000	Province of Ontario Canada**	2,90%	02/06/2028	1.574.928	0,64
1.865.000	Province of Quebec Canada*	2,30%	01/09/2029	1.569.094	0,64
6.615.000	Province of Quebec Canada*	3,00%	01/09/2023	5.619.016	2,30
Total dólar canadiense				20.114.782	8,23

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

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 del Estado 41,78% (31 de diciembre de 2020: 52,23%) (cont.)					
Euro					
5.480.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	0,25%	15/02/2027	6.791.389	2,78
4.645.000	French Republic Government Bond OAT*	0,75%	25/05/2028	5.880.697	2,40
1.280.000	French Republic Government Bond OAT*	2,00%	25/05/2048	1.953.879	0,80
1.090.000	Ireland Government Bond*	1,10%	15/05/2029	1.411.256	0,58
1.735.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	3,45%	01/03/2048	2.801.704	1,15
745.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*	0,90%	12/10/2035	905.281	0,37
2.150.000	Spain Government Bond*	0,35%	30/07/2023	2.594.310	1,06
1.210.000	Spain Government Bond*	0,50%	30/04/2030	1.460.617	0,60
710.000	Spain Government Bond**	1,95%	30/07/2030	965.424	0,39
490.000	Spain Government Bond*	2,70%	31/10/2048	761.506	0,31
Total euro				25.526.063	10,44
Yen japonés					
621.000.000	Japan Government Ten Year Bond*	0,10%	20/12/2028	5.658.108	2,31
788.000.000	Japan Government Thirty Year Bond*	0,70%	20/12/2048	7.206.698	2,95
Total yen japonés				12.864.806	5,26
Dólar de Nueva Zelanda					
1.565.000	International Bank for Reconstruction & Development*	3,38%	25/01/2022	1.111.738	0,45
Total dólar de Nueva Zelanda				1.111.738	0,45
Zloty polaco					
1.100.000	Republic of Poland Government Bond**	3,25%	25/07/2025	314.562	0,13
Total zloty polaco				314.562	0,13
Libra esterlina					
710.000	United Kingdom Gilt*	1,50%	22/07/2047	1.038.202	0,43
1.770.000	United Kingdom Gilt*	1,75%	07/09/2037	2.667.958	1,09
875.000	United Kingdom Gilt*	1,75%	22/01/2049	1.354.544	0,55
Total libra esterlina				5.060.704	2,07
Corona sueca					
14.620.000	Sweden Government Bond*	1,50%	13/11/2023	1.780.259	0,73
Total corona sueca				1.780.259	0,73
Dólar estadounidense					
350.000	Abu Dhabi Government International Bond*	4,13%	11/10/2047	418.128	0,17
390.000	Chile Government International Bond*	3,63%	30/10/2042	415.785	0,17

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

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 del Estado 41,78% (31 de diciembre de 2020: 52,23%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
450.000	Colombia Government International Bond*	3,00%	30/01/2030	441.682	0,18
370.000	Development Bank of Japan Inc*	0,50%	04/03/2024	369.603	0,15
290.000	Development Bank of Japan Inc*	1,00%	27/08/2030	274.818	0,11
500.000	Development Bank of Japan Inc*	1,25%	28/01/2031	481.540	0,20
510.000	Hungary Government International Bond*	7,63%	29/03/2041	837.682	0,34
1.270.000	Indonesia Government International Bond*	4,35%	08/01/2027	1.433.589	0,59
540.000	International Bank for Reconstruction & Development*	0,50%	28/10/2025	533.580	0,22
755.000	International Bank for Reconstruction & Development*	0,75%	24/11/2027	735.632	0,30
380.000	Israel Government International Bond*	4,50%	30/01/2043	475.272	0,19
700.000	Japan Bank for International Cooperation*	0,63%	15/07/2025	693.494	0,28
490.000	Kazakhstan Government International Bond*	5,13%	21/07/2025	570.316	0,23
315.000	Mexico Government International Bond*	4,35%	15/01/2047	329.811	0,14
630.000	Mexico Government International Bond*	4,75%	27/04/2032	722.925	0,30
395.000	Panama Government International Bond*	9,38%	01/04/2029	585.414	0,24
305.000	Peruvian Government International Bond*	2,78%	23/01/2031	311.484	0,13
470.000	Philippine Government International Bond*	3,95%	20/01/2040	523.248	0,21
505.000	Qatar Government International Bond*	3,25%	02/06/2026	553.516	0,23
1.075.000	Romanian Government International Bond*	3,00%	14/02/2031	1.116.163	0,46
600.000	Russian Foreign Bond - Eurobond*	5,10%	28/03/2035	714.780	0,29
725.000	Saudi Government International Bond*	4,50%	17/04/2030	854.837	0,35
3.446.060	United States Treasury Inflation Indexed Bonds*	0,13%	15/01/2030	3.785.778	1,55
4.956.443	United States Treasury Inflation Indexed Bonds*	0,63%	15/01/2026	5.506.337	2,25
250.000	United States Treasury Note/Bond*	0,25%	30/06/2025	245.615	0,10
150.000	United States Treasury Note/Bond*	0,25%	31/07/2025	147.196	0,06
315.000	United States Treasury Note/Bond*	0,38%	31/12/2025	309.082	0,13
620.000	United States Treasury Note/Bond*	0,75%	30/04/2026	616.924	0,25
325.000	United States Treasury Note/Bond*	1,13%	15/05/2040	280.668	0,11
140.000	United States Treasury Note/Bond*	1,25%	15/05/2050	114.357	0,05
300.000	United States Treasury Note/Bond*	1,38%	15/08/2050	252.996	0,10
870.000	United States Treasury Note/Bond*	1,63%	15/11/2050	781.641	0,32
115.000	United States Treasury Note/Bond*	1,88%	15/02/2051	109.789	0,05
300.000	United States Treasury Note/Bond*	2,00%	15/02/2050	294.820	0,12
80.000	United States Treasury Note/Bond*	2,25%	15/08/2046	82.744	0,03
3.125.000	United States Treasury Note/Bond*	2,75%	15/08/2042	3.522.583	1,44
575.000	United States Treasury Note/Bond*	3,00%	15/05/2045	678.275	0,28
2.385.000	United States Treasury Note/Bond*	3,88%	15/08/2040	3.136.648	1,28
760.000	Uruguay Government International Bond*	5,10%	18/06/2050	997.671	0,41
Total dólar estadounidense				34.256.423	14,01
Total bonos del Estado				102.165.234	41,78

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

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
Valores respaldados por hipotecas 11,52% (31 de diciembre de 2020: 15,54%)					
Dólar estadounidense					
930.000	Fannie Mae Pool	2,00%	01/07/2036	959.299	0,39
560.000	Fannie Mae Pool	2,00%	01/07/2050	565.469	0,23
395.772	Fannie Mae Pool (BR4029)	2,00%	01/02/2051	400.244	0,16
393.756	Fannie Mae Pool (CA8817)	2,00%	01/02/2051	397.961	0,16
445.203	Fannie Mae Pool	2,00%	01/04/2051	449.957	0,18
99.538	Fannie Mae Pool (FM7151)	2,00%	01/05/2051	100.601	0,04
496.598	Fannie Mae Pool (MA4325)	2,00%	01/05/2051	501.906	0,21
679.441	Fannie Mae Pool (BK2829)	2,50%	01/08/2050	703.795	0,29
355.258	Fannie Mae Pool (BP9581)	2,50%	01/08/2050	370.231	0,15
173.973	Fannie Mae Pool (BK3044)	2,50%	01/09/2050	180.216	0,07
349.746	Fannie Mae Pool (MA4120)	2,50%	01/09/2050	362.190	0,15
784.381	Fannie Mae Pool	2,50%	01/01/2051	813.070	0,33
822.577	Fannie Mae Pool	2,50%	01/05/2051	852.280	0,35
922.624	Fannie Mae Pool	2,50%	01/06/2051	955.452	0,39
4.220.000	Fannie Mae Pool	2,50%	01/07/2051	4.365.063	1,79
229.777	Fannie Mae Pool	3,00%	01/12/2047	240.796	0,10
251.201	Fannie Mae Pool	3,00%	01/11/2048	262.572	0,11
252.528	Fannie Mae Pool	3,00%	01/02/2049	265.668	0,11
358.969	Fannie Mae Pool (BP1372)	3,00%	01/03/2050	376.319	0,15
256.337	Fannie Mae Pool (BP3082)	3,00%	01/03/2050	269.186	0,11
244.784	Fannie Mae Pool	3,00%	01/04/2050	257.295	0,10
238.120	Fannie Mae Pool	3,00%	01/05/2050	248.847	0,10
130.412	Fannie Mae Pool	3,00%	01/09/2050	136.097	0,06
670.000	Fannie Mae Pool	3,00%	01/07/2051	698.436	0,29
260.388	Fannie Mae Pool	3,50%	01/03/2026	278.358	0,11
81.154	Fannie Mae Pool	3,50%	01/09/2028	86.605	0,04
76.423	Fannie Mae Pool	3,50%	01/12/2041	82.379	0,03
38.283	Fannie Mae Pool	3,50%	01/04/2042	41.257	0,02
47.587	Fannie Mae Pool	3,50%	01/05/2042	51.296	0,02
69.464	Fannie Mae Pool	3,50%	01/01/2043	75.089	0,03
103.383	Fannie Mae Pool	3,50%	01/12/2044	111.872	0,05
81.508	Fannie Mae Pool	3,50%	01/03/2045	87.309	0,04
133.200	Fannie Mae Pool	3,50%	01/12/2045	142.933	0,06
150.388	Fannie Mae Pool	3,50%	01/05/2046	160.378	0,07
43.042	Fannie Mae Pool	3,50%	01/06/2047	45.581	0,02
45.866	Fannie Mae Pool	3,50%	01/11/2047	48.533	0,02
220.114	Fannie Mae Pool	3,50%	01/12/2047	232.880	0,10
250.311	Fannie Mae Pool	3,50%	01/02/2048	265.027	0,11

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

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
Valores respaldados por hipotecas 11,52% (31 de diciembre de 2020: 15,54%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
48.984	Fannie Mae Pool	3,50%	01/08/2048	51.685	0,02
260.156	Fannie Mae Pool	3,50%	01/11/2049	274.018	0,11
173.998	Fannie Mae Pool	3,50%	01/07/2050	183.288	0,07
34.797	Fannie Mae Pool	4,00%	01/12/2040	38.286	0,02
36.287	Fannie Mae Pool (AB4051)	4,00%	01/12/2041	39.929	0,02
115.633	Fannie Mae Pool (AH0573)	4,00%	01/12/2041	128.378	0,05
89.030	Fannie Mae Pool (AS0657)	4,00%	01/10/2043	97.318	0,04
16.706	Fannie Mae Pool (AU4386)	4,00%	01/10/2043	18.206	0,01
335.393	Fannie Mae Pool	4,00%	01/09/2044	370.134	0,15
33.146	Fannie Mae Pool (AL6432)	4,00%	01/01/2045	36.278	0,01
54.316	Fannie Mae Pool (MA2145)	4,00%	01/01/2045	59.747	0,02
101.502	Fannie Mae Pool	4,00%	01/02/2045	111.545	0,05
275.630	Fannie Mae Pool	4,00%	01/02/2046	299.836	0,12
77.895	Fannie Mae Pool (AS7492)	4,00%	01/07/2046	84.058	0,03
37.909	Fannie Mae Pool (AS7558)	4,00%	01/07/2046	40.867	0,02
70.519	Fannie Mae Pool	4,00%	01/03/2047	75.719	0,03
74.766	Fannie Mae Pool (BE3619)	4,00%	01/05/2047	80.347	0,03
26.880	Fannie Mae Pool (BH2877)	4,00%	01/05/2047	28.912	0,01
86.356	Fannie Mae Pool	4,00%	01/06/2047	92.710	0,04
99.410	Fannie Mae Pool	4,00%	01/08/2047	107.173	0,04
98.857	Fannie Mae Pool	4,00%	01/09/2047	106.146	0,04
43.515	Fannie Mae Pool	4,00%	01/10/2047	46.624	0,02
72.794	Fannie Mae Pool	4,00%	01/11/2047	78.079	0,03
83.517	Fannie Mae Pool (BM2005)	4,00%	01/12/2047	89.528	0,04
26.948	Fannie Mae Pool (MA3211)	4,00%	01/12/2047	28.893	0,01
60.918	Fannie Mae Pool (BK2009)	4,00%	01/04/2048	65.124	0,03
270.473	Fannie Mae Pool (BK3960)	4,00%	01/04/2048	289.407	0,12
70.119	Fannie Mae Pool	4,00%	01/07/2048	74.777	0,03
150.289	Fannie Mae Pool	4,00%	01/09/2048	160.159	0,07
155.635	Fannie Mae Pool	4,00%	01/03/2049	166.419	0,07
136.220	Fannie Mae Pool	4,00%	01/07/2049	145.053	0,06
117.542	Fannie Mae Pool	4,00%	01/12/2049	125.361	0,05
14.910	Fannie Mae Pool	4,50%	01/03/2036	16.054	0,01
103.197	Fannie Mae Pool	4,50%	01/04/2041	114.644	0,05
22.785	Fannie Mae Pool	4,50%	01/09/2043	25.343	0,01
20.121	Fannie Mae Pool	4,50%	01/12/2043	22.444	0,01
62.858	Fannie Mae Pool	4,50%	01/05/2044	67.941	0,03
14.469	Fannie Mae Pool	4,50%	01/03/2047	15.741	0,01

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

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
Valores respaldados por hipotecas 11,52% (31 de diciembre de 2020: 15,54%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
138.396	Fannie Mae Pool	4,50%	01/07/2047	149.860	0,06
140.589	Fannie Mae Pool	4,50%	01/11/2048	151.870	0,06
17.246	Fannie Mae Pool	5,00%	01/10/2023	18.867	0,01
16.636	Fannie Mae Pool	5,00%	01/07/2035	19.047	0,01
28.814	Fannie Mae Pool	5,00%	01/06/2038	32.601	0,01
44.619	Fannie Mae Pool	5,00%	01/07/2039	51.042	0,02
47.147	Fannie Mae Pool	5,00%	01/09/2040	53.525	0,02
46.999	Fannie Mae Pool	5,00%	01/02/2041	53.818	0,02
37.911	Fannie Mae Pool	5,00%	01/01/2044	43.242	0,02
21.158	Fannie Mae Pool	5,00%	01/03/2044	23.476	0,01
28.376	Fannie Mae Pool	5,00%	01/06/2048	31.314	0,01
96.142	Fannie Mae Pool	5,00%	01/09/2048	105.550	0,04
38.369	Freddie Mac Gold Pool	3,50%	01/10/2042	41.376	0,02
39.649	Freddie Mac Gold Pool (C09042)	3,50%	01/05/2043	42.754	0,02
15.863	Freddie Mac Gold Pool (Q18306)	3,50%	01/05/2043	17.154	0,01
26.104	Freddie Mac Gold Pool	3,50%	01/06/2043	28.138	0,01
21.066	Freddie Mac Gold Pool	3,50%	01/04/2045	22.559	0,01
91.335	Freddie Mac Gold Pool	3,50%	01/08/2045	98.529	0,04
21.406	Freddie Mac Gold Pool	3,50%	01/12/2045	22.903	0,01
22.449	Freddie Mac Gold Pool	3,50%	01/04/2046	23.995	0,01
207.065	Freddie Mac Gold Pool	3,50%	01/04/2047	219.434	0,09
89.284	Freddie Mac Gold Pool	3,50%	01/07/2047	94.820	0,04
29.404	Freddie Mac Gold Pool	3,50%	01/09/2047	31.154	0,01
44.170	Freddie Mac Gold Pool	3,50%	01/10/2047	46.801	0,02
146.477	Freddie Mac Gold Pool	3,50%	01/11/2047	154.958	0,06
196.048	Freddie Mac Gold Pool	3,50%	01/12/2047	207.662	0,08
55.284	Freddie Mac Gold Pool	4,00%	01/02/2041	60.274	0,02
43.713	Freddie Mac Gold Pool	4,00%	01/11/2041	48.113	0,02
26.866	Freddie Mac Gold Pool	4,00%	01/11/2044	29.283	0,01
21.734	Freddie Mac Gold Pool	4,00%	01/03/2046	23.529	0,01
215.144	Freddie Mac Gold Pool	4,00%	01/04/2046	232.823	0,09
25.265	Freddie Mac Gold Pool	4,00%	01/09/2046	26.920	0,01
306.917	Freddie Mac Gold Pool	4,00%	01/12/2046	334.316	0,14
132.120	Freddie Mac Gold Pool	4,00%	01/01/2047	142.529	0,06
155.642	Freddie Mac Gold Pool	4,00%	01/04/2047	167.211	0,07
26.735	Freddie Mac Gold Pool	4,00%	01/05/2047	28.729	0,01
39.978	Freddie Mac Gold Pool	4,00%	01/08/2048	42.641	0,02
43.266	Freddie Mac Gold Pool	4,00%	01/10/2048	46.066	0,02

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

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
Valores respaldados por hipotecas 11,52% (31 de diciembre de 2020: 15,54%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
66.324	Freddie Mac Gold Pool	4,50%	01/08/2039	74.068	0,03
19.368	Freddie Mac Gold Pool	4,50%	01/12/2039	21.630	0,01
5.180	Freddie Mac Gold Pool	4,50%	01/03/2041	5.786	0,00
60.101	Freddie Mac Gold Pool	4,50%	01/11/2043	66.857	0,03
11.882	Freddie Mac Gold Pool	4,50%	01/10/2046	12.959	0,01
96.389	Freddie Mac Gold Pool	4,50%	01/09/2048	103.527	0,04
10.231	Freddie Mac Gold Pool	5,00%	01/11/2022	11.196	0,00
12.294	Freddie Mac Gold Pool	5,00%	01/10/2035	14.040	0,01
28.878	Freddie Mac Gold Pool	5,00%	01/09/2038	33.093	0,01
25.397	Freddie Mac Gold Pool	5,00%	01/03/2047	28.067	0,01
225.000	Freddie Mac Pool	2,00%	01/07/2051	227.708	0,09
495.685	Freddie Mac Pool	2,50%	01/09/2050	513.423	0,21
323.139	Freddie Mac Pool	2,50%	01/12/2050	334.637	0,14
230.888	Freddie Mac Pool	2,50%	01/02/2051	239.103	0,10
151.057	Freddie Mac Pool	3,00%	01/02/2050	158.466	0,06
108.569	Freddie Mac Pool	3,00%	01/07/2050	113.477	0,05
80.520	Freddie Mac Pool	3,50%	01/03/2048	85.117	0,03
76.183	Freddie Mac Pool	4,00%	01/01/2049	81.132	0,03
255.000	Ginnie Mae	2,00%	01/07/2051	259.721	0,11
875.000	Ginnie Mae	2,50%	01/07/2051	905.557	0,37
387.341	Ginnie Mae II Pool	2,00%	20/04/2051	394.969	0,16
581.497	Ginnie Mae II Pool	2,50%	20/03/2051	602.526	0,25
595.553	Ginnie Mae II Pool	2,50%	20/04/2051	617.294	0,25
Total valores respaldados por hipotecas **				28.171.854	11,52
Total inversiones				222.688.825	91,08

Contratos de divisas a plazo 0,54% (31 de diciembre de 2020: 1,40%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
1.369.181 BRL	238.870 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	33.506	0,01
1.574.613 CAD	1.253.759 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	17.821	0,01
872.992 CAD	698.354 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	6.631	0,00
498.751 CAD	402.245 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	2	521	0,00
109.055.552 CNY	16.552.004 USD	19/07/2021	Citibank NA	2	315.164	0,13
1.151.982 CNY	174.778 USD	19/07/2021	Société Générale	1	3.394	0,00
21.373 CNY	3.299 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	7	0,00
5.958.414 CZK	274.475 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	2.527	0,00
13.742.085 CZK	634.001 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	4.857	0,00

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,54% (31 de diciembre de 2020: 1,40%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
156.427 £	215.658 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	449	0,00
37.526.652 HUF	124.572 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	2.189	0,00
126.975.751 HUF	422.298 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	6.614	0,00
11.924.055.071 IDR	804.739 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	14.079	0,01
1.112.971 ILS	338.476 USD	19/07/2021	UBS AG	1	3.129	0,00
6.764.581 MXN	332.544 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	6.483	0,00
18.644.476 MXN	920.448 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	13.977	0,01
1.787.390 NOK	206.895 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	834	0,00
563.498 PLN	147.431 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	599	0,00
30.607.772 RUB	396.458 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	21.546	0,01
61.199.869 RUB	799.421 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	36.373	0,02
14.901.137 RUB	198.167 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	5.335	0,00
591.575 USD	830.070 NZD	19/07/2021	BNP Paribas	2	11.574	0,01
133.588 USD	110.992 €	19/07/2021	BNP Paribas	1	1.915	0,00
536.970 USD	11.506.174 CZK	19/07/2021	BNP Paribas	2	2.058	0,00
50 USD	425 TRY	19/07/2021	BNP Paribas	1	1	0,00
392.164 USD	278.533 £	19/07/2021	BNP Paribas	1	7.365	0,00
578.371 USD	4.883.053 SEK	19/07/2021	BNP Paribas	2	7.303	0,00
313.763 USD	33.843.134 ¥	19/07/2021	BNP Paribas	1	8.800	0,00
377.820 USD	467.682 CAD	19/07/2021	BNP Paribas	1	142	0,00
315.603 USD	2.607.340 NOK	19/07/2021	BNP Paribas	1	12.580	0,01
224.175 USD	289.716 AUD	19/07/2021	Citibank NA	1	6.652	0,00
625.972 USD	441.439 £	19/07/2021	Citibank NA	2	16.116	0,01
1.221.422 USD	1.000.190 €	19/07/2021	Citibank NA	3	34.870	0,01
453.921 USD	3.792.271 SEK	19/07/2021	Citibank NA	2	10.418	0,00
346.087 USD	37.723.967 ¥	19/07/2021	Citibank NA	1	6.153	0,00
145.075 USD	133.236 CHF	19/07/2021	Citibank NA	1	868	0,00
179.923 USD	200.184.397 KRW	19/07/2021	Citibank NA	1	2.774	0,00
1.841.367 USD	2.229.992 CAD	19/07/2021	Citibank NA	6	40.535	0,02
942.391 USD	860.116 CHF	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	11.452	0,01
1.238.623 USD	1.525.309 CAD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	6.859	0,00
430.146 USD	589.257 NZD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	18.411	0,01
1.075.130 USD	893.456 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	5	15.198	0,01
364.058 USD	3.063.103 SEK	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	5.831	0,00
573.747 USD	61.769.175 ¥	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	17.140	0,01
149.397 USD	564.648 PLN	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	1.064	0,00
1.471.690 USD	1.912.558 AUD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	35.715	0,02
738.102 USD	6.163.931 NOK	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	21.736	0,01

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,54% (31 de diciembre de 2020: 1,40%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
2.484.526 USD	3.000.000 CAD	19/07/2021	Royal Bank of Canada	1	61.873	0,03
955.767 USD	800.000 €	19/07/2021	Royal Bank of Canada	1	6.706	0,00
918.021 USD	1.293.984 NZD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	2	13.866	0,01
598.667 USD	543.217 CHF	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	10.721	0,01
226.463 USD	292.379 AUD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	6.941	0,00
1.142.697 USD	125.565.633 ¥	19/07/2021	Standard Chartered Bank	2	11.216	0,01
1.639.427 USD	1.368.069 €	19/07/2021	Standard Chartered Bank	2	16.450	0,01
964.374 USD	8.037.618 SEK	19/07/2021	Standard Chartered Bank	3	24.382	0,01
324.362 USD	451.063 NZD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	9.188	0,00
465.306 USD	50.841.727 ¥	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	7.168	0,00
522.754 USD	643.110 CAD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	3.411	0,00
290.175 USD	240.229 €	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	5.184	0,00
2.630 USD	22.267 TRY	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	90	0,00
141.596 USD	101.281 £	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	1.675	0,00
5.604.393 USD	5.148.462 CHF	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	32.000	0,01
25.553 USD	216.591 SEK	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	223	0,00
294.100 USD	379.447 AUD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	9.206	0,00
158.908 USD	1.319.222 NOK	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	5.589	0,00
6.725.049 USD	8.806.501 AUD	19/07/2021	UBS AG	1	113.006	0,05
4.007.566 USD	5.693.471 NZD	19/07/2021	UBS AG	1	29.325	0,01
646.487 USD	5.504.837 SEK	19/07/2021	UBS AG	1	2.702	0,00
8.030.956 USD	9.761.261 CAD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	148.241	0,06
588.432 ZAR	39.990 USD	19/07/2021	UBS AG	1	1.131	0,00
Clases AUD con cobertura						
159 USD	205 AUD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	5	0,00
181 USD	235 AUD	19/07/2021	UBS AG	1	5	0,00
Clases ZAR con cobertura						
166 USD	2.275 ZAR	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	7	0,00
227 USD	3.239 ZAR	19/07/2021	UBS AG	1	1	0,00
4.479 ZAR	304 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	9	0,00
431.477 ZAR	29.227 USD	19/07/2021	UBS AG	1	925	0,00
2.815 ZAR	195 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	2	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					1.320.813	0,54

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de futuros 0,06% (31 de diciembre de 2020: 0,11%)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
87	10-Year Mini Japanese Government Bond Future September 2021	23.597	0,01
39	Euro-BOBL Future September 2021	3.238	0,00
14	Euro-BTP Future September 2021	16.437	0,00
64	Euro-Bund Future September 2021	67.074	0,03
17	US Treasury 10-Year Ultra Future September 2021	43.832	0,02
Plusvalía latente total sobre contratos de futuros *		154.178	0,06

Contratos de swap de tipos de interés 0,01% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)

Importe nominal	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar)#	Tipo fijo	Tipo variable	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto	
JPY	314.560.000	30/07/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	0,12%	6 Month JPY LIBOR	8.937	0,01
Plusvalía latente total sobre contratos de swap de tipos de interés**						8.937	0,01	

Recibir – El Fondo recibe un tipo variable y paga un tipo fijo.

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

¹Swap liquidada centralmente.

Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
	224.172.753	91,69

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,67%) (31 de diciembre de 2020: (1,40%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
878.349 AUD	679.500 USD	19/07/2021	BNP Paribas	3	(20.023)	(0,01)
2.337.549 AUD	1.812.771 USD	19/07/2021	Citibank NA	2	(57.707)	(0,02)
2.189.078 AUD	1.685.798 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	4	(42.208)	(0,02)
10.493.585 AUD	8.086.063 USD	19/07/2021	Royal Bank of Canada	1	(207.333)	(0,09)
260.076 AUD	202.936 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(7.667)	(0,00)
836.085 AUD	647.166 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(19.422)	(0,01)
1.437.861 CHF	1.567.194 USD	19/07/2021	BNP Paribas	2	(10.937)	(0,01)
733.527 CHF	797.046 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	2	(3.120)	(0,00)
268.393 CHF	293.903 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(3.410)	(0,00)
81.642.976 CLP	115.115 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(3.039)	(0,00)
866.424.675 COP	235.261 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(3.423)	(0,00)
3.294.343 DKK	529.799 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(4.262)	(0,00)
935.717 €	1.124.887 USD	19/07/2021	BNP Paribas	3	(14.821)	(0,01)

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (0,67%) (31 de diciembre de 2020: (1,40%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
5.722.799 €	6.951.645 USD	19/07/2021	Citibank NA	5	(162.535)	(0,07)
574.751 €	699.749 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(17.906)	(0,01)
2.133.152 €	2.585.453 USD	19/07/2021	Royal Bank of Canada	1	(54.837)	(0,02)
2.526.266 €	3.053.920 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	2	(56.943)	(0,02)
578.408 €	698.509 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(12.328)	(0,01)
639.565 £	889.242 USD	19/07/2021	BNP Paribas	2	(5.671)	(0,00)
388.984 £	546.071 USD	19/07/2021	Citibank NA	2	(8.682)	(0,00)
142.486 £	197.787 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(940)	(0,00)
1.070.866 £	1.488.577 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	4	(9.155)	(0,01)
1.820.363.765 ¥	16.691.834 USD	19/07/2021	Citibank NA	4	(288.398)	(0,12)
89.327.468 ¥	825.206 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(20.270)	(0,01)
850.381.551 ¥	7.818.458 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	6	(155.606)	(0,06)
19.494.668 ¥	178.559 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(2.891)	(0,00)
3.316.893.041 KRW	2.954.321 USD	19/07/2021	Citibank NA	3	(19.101)	(0,01)
2.617.574 MYR	634.948 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(5.314)	(0,00)
3.921.932 NOK	461.007 USD	19/07/2021	BNP Paribas	2	(5.204)	(0,00)
8.491.077 NOK	1.023.731 USD	19/07/2021	Citibank NA	3	(36.906)	(0,02)
17.171.189 NOK	2.035.736 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(40.116)	(0,02)
179.454 NZD	129.327 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(3.936)	(0,00)
1.260.438 NZD	906.591 USD	19/07/2021	Citibank NA	2	(25.876)	(0,01)
532.736 NZD	380.234 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(7.991)	(0,00)
4.449.104 NZD	3.216.960 USD	19/07/2021	Royal Bank of Canada	1	(108.205)	(0,05)
480.580 PEN	132.566 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(6.984)	(0,00)
472.129 PLN	126.308 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(2.280)	(0,00)
2.630.429 SEK	314.885 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(7.259)	(0,00)
2.724.437 SEK	327.572 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(8.951)	(0,00)
7.978.205 SEK	944.615 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	(11.571)	(0,01)
471.740 SGD	351.361 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(431)	(0,00)
21.212.324 THB	670.116 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(8.304)	(0,00)
127.192 USD	690.946 BRL	19/07/2021	BNP Paribas	1	(10.261)	(0,01)
273.816 USD	3.921.503 ZAR	19/07/2021	BNP Paribas	1	(228)	(0,00)
145.651 USD	942.741 CNY	19/07/2021	Citibank NA	1	(159)	(0,00)
287.609 USD	5.745.702 MXN	19/07/2021	Citibank NA	1	(355)	(0,00)
6.224.506 USD	7.804.910 CAD	19/07/2021	Citibank NA	1	(78.356)	(0,03)
163.175 USD	3.510.707 CZK	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(34)	(0,00)
5.991.032 USD	4.358.534 £	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(30.365)	(0,01)
342.307 USD	2.932.464 SEK	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(641)	(0,00)
339.715 USD	25.323.688 RUB	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(6.126)	(0,00)

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (0,67%) (31 de diciembre de 2020: (1,40%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
3.247 USD	21.373 CNY	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(59)	(0,00)
524.432 USD	380.672 £	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(1.474)	(0,00)
8.003 USD	117.565 ZAR	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(213)	(0,00)
184.469 USD	1.205.457 CNY	19/07/2021	UBS AG	1	(1.974)	(0,00)
1.741.542 ZAR	126.088 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(4.384)	(0,00)
Clases AUD con cobertura						
214 AUD	166 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(5)	(0,00)
38.113 AUD	29.097 USD	19/07/2021	UBS AG	3	(481)	(0,00)
235 AUD	182 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(6)	(0,00)
296 USD	394 AUD	19/07/2021	UBS AG	1	(0)	(0,00)
Clases ZAR con cobertura						
154 USD	2.237 ZAR	19/07/2021	UBS AG	1	(3)	(0,00)
258 USD	3.700 ZAR	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(1)	(0,00)
5.194 ZAR	370 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	(7)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(1.627.095)	(0,67)

Contratos de futuros (0,40%) (31 de diciembre de 2020: (0,12%))

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
82	Australian Government Bond 10-Year Future September 2021	(16.985)	(0,01)
(131)	Canadian 10-Year Bond Future September 2021	(87.160)	(0,04)
142	Canadian 5-Year Bond Future September 2021	(22.006)	(0,01)
(40)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2021	(153.693)	(0,06)
(18)	Euro-OAT Future September 2021	(13.021)	(0,01)
55	Euro-Schatz Future September 2021	(1.304)	(0,00)
(30)	United Kingdom Long Gilt Future September 2021	(39.496)	(0,02)
(20)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2021	(17.812)	(0,01)
(125)	US Treasury 10-Year Ultra Future September 2021	(322.266)	(0,13)
40	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future September 2021	(15.311)	(0,00)
68	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2021	(25.389)	(0,01)
(7)	US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2021	(25.421)	(0,01)
(27)	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2021	(224.603)	(0,09)
Minusvalía latente total sobre contratos de futuros [*]		(964.467)	(0,40)

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de swap de tipos de interés (0,01%) (31 de diciembre de 2020: (0,02%))

	Importe nominal	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar) [#]	Tipo fijo	Tipo variable	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
JPY	158.790.000	30/07/2028	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	0,35%	6 Month JPY LIBOR	(33.394)	(0,01)
Minusvalía latente total sobre contratos de swap de tipos de interés[∞]							(33.394)	(0,01)

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

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

¹ Swap liquidada centralmente.

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(2.624.956)	(1,08)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	221.547.797	90,61
Otro activo neto	22.950.556	9,39
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	244.498.353	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	139.968.611	54,38
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	80.594.200	31,31
† Otros valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario	2.126.014	0,83
± Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	(810.289)	(0,31)
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(330.739)	(0,13)
Total inversiones	221.547.797	86,08

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
31.940.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/02/2051	33.607.378
27.043.850	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0.63%, 15/01/2026	30.386.301
28.740.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/03/2051	30.231.622
28.740.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/04/2051	29.775.420
18.920.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.25%, 15/02/2027	24.327.985
23.580.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/05/2051	24.214.894
20.540.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/06/2051	21.303.922
19.060.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/07/2051	19.677.834
18.700.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/02/2051	19.346.826
15.500.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/03/2051	15.980.882
15.500.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/04/2051	15.645.459
13.320.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/02/2051	14.055.305
13.320.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/03/2051	13.979.773
13.040.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/04/2051	13.465.734
11.300.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/05/2051	11.680.382
9.460.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/05/2051	9.473.303
9.140.000	Province of Ontario Canada, 2.70%, 02/06/2029	8.068.704
7.600.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 02/12/2021	7.599.605
6.332.000	Verizon Communications Inc, 0.75%, 22/03/2032	7.494.143
6.540.000	Ginnie Mae II Pool, 2.50%, 01/06/2051	6.787.441
3.640.000	French Republic Government Bond OAT, 2.00%, 25/05/2048	6.515.196

Neuberger Berman Global Bond Fund (cont.)

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
31.940.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/01/2051	33.665.580
31.940.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/02/2051	33.651.935
28.740.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/03/2051	29.836.044
28.740.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/04/2051	29.579.910
23.580.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/05/2051	24.492.962
20.540.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/06/2051	21.251.712
18.480.942	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0.63%, 15/01/2026	20.618.723
22.800.000	Treasury Corp Victoria, 3.00%, 20/10/2028	19.719.930
18.700.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/01/2051	19.373.153
18.700.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/02/2051	19.304.494
18.760.000	United States Treasury Note/Bond, 0.25%, 30/09/2025	18.552.912
12.140.000	French Republic Government Bond OAT, 2.00%, 25/05/2048	18.531.010
15.500.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/03/2051	15.678.154
15.500.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/04/2051	15.523.987
13.320.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/01/2052	14.082.045
13.320.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/02/2051	14.003.708
13.320.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/03/2051	13.784.448
13.040.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/04/2051	13.494.834
9.000.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 5.65%, 15/02/2024	13.039.262
14.540.000	Australian Government Bond, 2.75%, 24/07/2029	12.402.995
9.100.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.90%, 12/10/2035	11.959.622
11.300.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/05/2051	11.740.458
11.440.000	United States Treasury Note/Bond, 0.63%, 15/08/2030	10.889.228
7.140.000	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.60%, 22/06/2047	10.036.438
9.460.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/05/2051	9.528.556
8.280.000	United States Treasury Note/Bond, 0.88%, 15/11/2030	8.085.030
7.600.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 20/05/2021	7.600.000
8.840.000	New Zealand Government Bond, 3.50%, 14/04/2033	7.355.531

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund

Informe del Gestor de inversiones

Durante el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 (el "periodo analizado"), la rentabilidad total de la Clase de Acumulación USD I se situó en el -3,68%. En el mismo periodo, el índice JPMorgan GBI Emerging Markets Global Diversified (USD Total Return, Unhedged) rindió un -3,38%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Los bonos de mercados emergentes ("ME") en monedas locales se enfrentaron a un contexto volátil en la primera mitad del año al verse favorecidos los activos de riesgo por la sólida recuperación económica y las continuas campañas de vacunación mundial, a pesar de la presión que ejerció el "reflation trade" en los mercados de renta fija. Los valores del Tesoro fueron objeto de bruscas ventas masivas que llevaron las rentabilidades a 10 años a un máximo del 1,74% al final de marzo; esto quedó parcialmente contrarrestado a finales del segundo trimestre, a pesar del giro "hawkish" que adoptó la Reserva Federal estadounidense (la "Fed") a mediados de junio. Los precios del petróleo tuvieron un buen comportamiento durante todo el periodo, mientras que los metales preciosos atravesaron dificultades, en ambos casos como consecuencia del sentimiento económico positivo. El dólar estadounidense avanzó en gran medida en consonancia con las rentabilidades de los bonos del Tesoro, aunque experimentó un gran salto tras la reunión de la Fed del mes de junio. La rentabilidad negativa de esta clase de activos durante el periodo analizado se debió tanto a la depreciación de las monedas de ME frente al dólar estadounidense como al aumento de las rentabilidades de los bonos en moneda local. La rentabilidad media del índice de referencia subió del 4,22% al 4,98% durante el periodo analizado.

Sudáfrica y República Dominicana fueron los mercados locales del índice de referencia que mejor se comportaron durante el primer semestre del año. Por el extremo contrario destacó Turquía, seguida de Perú, Colombia y Chile.

Por lo que respecta a las divisas, las principales contribuciones a la rentabilidad relativa procedieron de sobreponderaciones del rublo ruso, la corona checa, la grivna ucraniana y la libra egipcia, así como de la infraponderación del baht tailandés. Por otra parte, la infraponderación del rand sudafricano lastró los resultados, al igual que el posicionamiento en la lira turca. Por lo que respecta a los tipos locales, las infraponderaciones de países con bajos niveles de rentabilidad como la República Checa, Polonia y Corea del Sur contribuyeron a la rentabilidad, al igual que la infraponderación de Turquía y la sobreponderación de Sudáfrica. Sin embargo, el posicionamiento en tipos en América Latina perjudicó, como consecuencia de las sobreponderaciones de Argentina y Brasil.

Las expectativas de crecimiento mundial para el resto de 2021 siguen siendo alentadoras, siendo probable que los ME se beneficien de la incesante recuperación cíclica, tal como reflejan tanto los datos de manufacturas como los precios de las materias primas. La aceleración de la vacunación prevista para el segundo semestre del año en el mundo emergente probablemente también favorecerá a la dinámica del crecimiento doméstico. Ante esta coyuntura, seguimos siendo optimistas sobre las perspectivas a medio plazo de las monedas de ME, ya que deberían salir bien paradas en nuestro escenario base de recuperación del crecimiento de los ME, y la mejora de los términos de intercambio favorecen especialmente a las monedas de países exportadores de materias primas. Por lo que respecta a los tipos locales, nuestras perspectivas son positivas para los países en los que ya se han descontado unas subidas de tipos significativas o para aquellos que están experimentando una recuperación menos profunda, mientras que mantenemos posiciones infraponderadas en varios países con bajos niveles de rentabilidad.

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		2.469.490.059	2.829.499.402
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	213.101.177	116.856.444
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		73.707.892	1.100
Cuentas a percibir por acciones emitidas		3.380.689	4.222.773
Cuentas por cobrar de intermediarios		28.770.209	3.900.386
Ingresos a percibir y otros activos		42.533.716	47.494.551
Activos totales		2.830.983.742	3.001.974.656
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		61.019.164	45.292.445
Descubierto bancario	3	46.816	-
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		2.637.100	3.029.558
Adeudado a los intermediarios		30.712.404	43.368.000
Gastos devengados		2.721.478	2.625.917
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		132.656.617	26.893.167
Otras cuentas por pagar		5.571.441	9.448.552
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		235.365.020	130.657.639
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		2.595.618.722	2.871.317.017

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		67.487.064	87.017.904
Ingresos varios		106.770	–
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(157.236.903)	(403.457.907)
		(89.643.069)	(316.440.003)
Gastos			
Comisión de gestión	5	10.138.958	11.809.861
Comisión de distribución	5	1.078.972	1.631.559
Comisión de administración	5	1.367.912	1.928.369
Comisión de compromiso	16	197.523	164.894
Comisión de depósito	5	989.218	1.234.716
Comisión del Depositario	5	65.656	141.561
Honorarios profesionales	7	140.559	112.103
Honorarios de los Consejeros	6	2.410	2.380
Costes de transacciones	7	733.599	970.087
Honorarios de auditoría	7	18.995	19.879
Reembolso de IVA		(12.807)	(9.742)
Otros gastos	7	15.998	125.905
Gastos no asumidos	5	(252.032)	(904.381)
Gastos totales		14.484.961	17.227.191
Costes financieros			
Gastos por intereses		–	20.936
Repartos de dividendos abonados	1	25.322.353	32.105.550
		25.322.353	32.126.486
Impuestos retenidos en origen		4.301.394	4.761.275
Impuesto sobre las plusvalías		(2.196.077)	(600.032)
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		(131.555.700)	(369.954.923)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	2.871.317.017	3.203.701.800
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	(131.555.700)	(369.954.923)
Suscripciones	770.124.657	582.353.856
Reembolsos	(914.267.252)	(766.504.912)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	2.595.618.722	2.649.595.821

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

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
Certificado de depósito 0,06% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)					
Yuan renminbi chino					
10.000.000	China Construction Bank**	0,00%	07/04/2022	1.503.938	0,06
Total certificado de depósito				1.503.938	0,06
Bonos del Tesoro 2,27% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)					
Shekel israelí					
172.025.365	Bank of Israel Bill - Makam	0,00%	02/09/2021	52.819.205	2,04
19.830.904	Israel Treasury Bill	0,00%	31/08/2021	6.085.595	0,23
Total bonos del Tesoro **				58.904.800	2,27
Bonos de empresa 2,14% (31 de diciembre de 2020: 3,66%)					
Yuan renminbi chino					
20.000.000	Central Huijin Investment**	3,50%	03/11/2023	3.116.592	0,12
20.000.000	Central Huijin Investment Ltd**	2,75%	13/03/2023	3.080.524	0,12
10.000.000	China Southern Power Grid Co Ltd**	3,64%	21/06/2022	1.559.905	0,06
20.000.000	China Southern Power Grid Co Ltd**	3,66%	25/02/2024	3.129.142	0,12
Total yuan renminbi chino				10.886.163	0,42
Peso colombiano					
6.865.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP*	7,63%	10/09/2024	1.857.924	0,07
52.240.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP*	8,38%	08/11/2027	13.346.390	0,52
Total peso colombiano				15.204.314	0,59
Rupia indonesia					
308.200.000.000	JPMorgan Chase Bank NA†	7,00%	18/09/2030	22.446.229	0,86
Total rupia indonesia				22.446.229	0,86
Peso mexicano					
77.298.300	Comision Federal de Electricidad*	7,35%	25/11/2025	3.750.749	0,15
66.722.200	Comision Federal de Electricidad*	8,18%	23/12/2027	3.223.479	0,12
Total peso mexicano				6.974.228	0,27
Total bonos de empresa				55.510.934	2,14
Bonos del Estado 87,63% (31 de diciembre de 2020: 90,55%)					
Peso chileno					
9.345.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	2,80%	01/10/2033	10.434.134	0,40
470.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	5,10%	15/07/2050	636.167	0,03
Total peso chileno				11.070.301	0,43

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

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 del Estado 87,63% (31 de diciembre de 2020: 90,55%) (cont.)					
Yuan renminbi chino					
316.070.000	China Government Bond**	1,99%	09/04/2025	47.332.031	1,82
4.000.000	China Government Bond**	2,24%	05/03/2023	615.426	0,02
50.660.000	China Government Bond**	2,36%	02/07/2023	7.791.102	0,30
2.950.000	China Government Bond**	2,68%	21/05/2030	439.791	0,02
209.750.000	China Government Bond**	2,85%	04/06/2027	32.125.398	1,24
10.000.000	China Development Bank**	2,89%	22/06/2025	1.531.552	0,06
140.300.000	China Government Bond**	3,02%	22/10/2025	21.813.313	0,84
14.000.000	China Government Bond**	3,02%	27/05/2031	2.157.461	0,08
50.000.000	China Government Bond**	3,03%	11/03/2026	7.776.086	0,30
70.800.000	China Government Bond**	3,12%	05/12/2026	11.040.437	0,43
94.880.000	China Government Bond**	3,13%	21/11/2029	14.689.134	0,57
20.000.000	China Government Bond**	3,19%	11/04/2024	3.133.794	0,12
10.000.000	China Government Bond**	3,25%	22/11/2028	1.566.521	0,06
105.650.000	China Government Bond**	3,27%	19/11/2030	16.583.993	0,64
80.000.000	China Government Bond**	3,28%	03/12/2027	12.559.580	0,48
10.000.000	China Development Bank**	3,30%	01/02/2024	1.560.161	0,06
4.000.000	China Development Bank**	3,66%	01/03/2031	627.529	0,02
10.000.000	China Development Bank**	3,76%	14/08/2023	1.575.628	0,06
10.250.000	China Government Bond**	3,39%	16/03/2050	1.500.831	0,06
23.000.000	China Government Bond**	3,72%	12/04/2051	3.598.937	0,14
72.000.000	China Government Bond**	3,81%	14/09/2050	11.395.315	0,44
Total yuan renminbi chino				201.414.020	7,76
Peso colombiano					
2.037.000.000	Colombia Government International Bond*	4,38%	21/03/2023	558.695	0,02
252.000.000	Colombia Government International Bond*	9,85%	28/06/2027	80.652	0,00
44.210.041.121	Colombian TES*	3,00%	25/03/2033	11.404.628	0,44
165.978.000.000	Colombian TES*	5,75%	03/11/2027	42.588.510	1,64
26.599.000.000	Colombian TES*	6,00%	28/04/2028	6.845.970	0,26
42.967.400.000	Colombian TES*	6,25%	26/11/2025	11.674.135	0,45
125.153.500.000	Colombian TES*	7,00%	30/06/2032	32.713.496	1,26
28.002.900.000	Colombian TES*	7,25%	18/10/2034	7.356.005	0,28
60.003.300.000	Colombian TES*	7,50%	26/08/2026	17.027.842	0,66
68.424.200.000	Colombian TES*	7,75%	18/09/2030	19.120.450	0,74
1.387.000.000	Financiera de Desarrollo Territorial SA Findeter*	7,88%	12/08/2024	380.884	0,02
Total peso colombiano				149.751.267	5,77

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

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 del Estado 87,63% (31 de diciembre de 2020: 90,55%) (cont.)					
Corona checa					
118.080.000	Czech Republic Government Bond*	0,05%	29/11/2029	4.737.987	0,18
449.520.000	Czech Republic Government Bond*	0,95%	15/05/2030	19.423.795	0,75
646.730.000	Czech Republic Government Bond*	1,00%	26/06/2026	29.079.405	1,12
229.800.000	Czech Republic Government Bond*	1,20%	13/03/2031	10.088.518	0,39
165.510.000	Czech Republic Government Bond*	2,00%	13/10/2033	7.809.432	0,30
660.720.000	Czech Republic Government Bond*	2,40%	17/09/2025	31.655.780	1,22
Total corona checa				102.794.917	3,96
Peso de la República Dominicana					
117.100.000	Dominican Republic Bond*	11,25%	05/02/2027	2.472.769	0,10
412.000.000	Dominican Republic International Bond**	8,63%	11/06/2031	7.504.928	0,29
71.400.000	Dominican Republic International Bond*	8,90%	15/02/2023	1.319.974	0,05
Total peso de la República Dominicana				11.297.671	0,44
Libra egipcia					
171.787.000	Egypt Government Bond*	14,20%	07/07/2023	11.011.685	0,42
189.064.000	Egypt Government Bond*	14,41%	07/07/2027	12.017.127	0,46
193.899.000	Egypt Government Bond*	14,48%	06/04/2026	12.372.553	0,48
210.241.000	Egypt Government Bond*	15,90%	02/07/2024	14.020.890	0,54
Total libra egipcia				49.422.255	1,90
Cedi ghanés					
55.810.000	Republic of Ghana Government Bonds*	19,25%	18/12/2023	10.030.293	0,38
19.710.000	Republic of Ghana Government Bonds*	20,75%	06/03/2023	3.572.168	0,14
418	Republic of Ghana Government Bonds*	24,75%	19/07/2021	72	0,00
Total cedi ghanés				13.602.533	0,52
Forint húngaro					
1.107.700.000	Hungary Government Bond*	1,50%	22/04/2026	3.650.256	0,14
1.200.610.000	Hungary Government Bond*	2,25%	20/04/2033	3.802.577	0,15
2.849.920.000	Hungary Government Bond*	3,00%	26/06/2024	10.004.051	0,39
10.146.310.000	Hungary Government Bond*	3,00%	27/10/2027	35.896.398	1,38
2.054.260.000	Hungary Government Bond*	3,00%	21/08/2030	7.231.442	0,28
555.720.000	Hungary Government Bond*	3,00%	27/10/2038	1.840.803	0,07
1.659.890.000	Hungary Government Bond*	3,25%	22/10/2031	5.932.130	0,23
3.600.000.000	Hungary Government Bond*	5,50%	24/06/2025	13.833.393	0,53
1.545.300.000	Hungary Government Bond*	6,75%	22/10/2028	6.737.126	0,26
Total forint húngaro				88.928.176	3,43

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

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 del Estado 87,63% (31 de diciembre de 2020: 90,55%) (cont.)					
Rupia india					
3.200.000.000	India Government Bond*	7,32%	28/01/2024	45.474.865	1,75
Total rupia india				45.474.865	1,75
Rupia indonesia					
828.200.000.000	Indonesia Treasury Bond*	5,50%	15/04/2026	57.181.645	2,20
110.288.000.000	Indonesia Treasury Bond*	5,63%	15/05/2023	7.771.689	0,30
77.134.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,13%	15/05/2028	5.313.590	0,20
196.350.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,50%	15/06/2025	14.195.732	0,55
40.796.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,50%	15/02/2031	2.781.497	0,11
205.944.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,63%	15/05/2033	14.125.526	0,54
120.881.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00%	15/05/2022	8.598.141	0,33
121.650.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00%	15/05/2027	8.884.741	0,34
104.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50%	15/08/2032	7.554.732	0,29
137.280.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50%	15/06/2035	9.798.952	0,38
86.128.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50%	15/05/2038	6.079.654	0,23
9.680.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50%	15/04/2040	684.576	0,03
546.370.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,13%	15/05/2024	41.163.139	1,59
161.965.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,25%	15/05/2029	12.471.528	0,48
204.753.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,25%	15/05/2036	15.470.414	0,60
137.328.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38%	15/03/2024	10.339.768	0,40
222.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38%	15/09/2026	17.189.251	0,66
85.767.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38%	15/03/2034	6.560.998	0,25
57.535.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38%	15/04/2039	4.406.388	0,17
220.679.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,75%	15/05/2031	17.526.241	0,67
99.265.000.000	Indonesia Treasury Bond*	9,00%	15/03/2029	7.922.895	0,31
Total rupia indonesia				276.021.097	10,63
Yen japonés					
11.253.000	Argentine Republic Government International Bond**	0,67%	31/12/2038	22.855	0,00
7.424.445	Argentine Republic Government International Bond**	4,33%	31/12/2033	18.150	0,00
Total yen japonés				41.005	0,00
Ringgit malayo					
23.000.000	Malaysia Government Bond**	2,63%	15/04/2031	5.234.106	0,20
28.980.000	Malaysia Government Bond**	3,50%	31/05/2027	7.215.170	0,28
41.075.000	Malaysia Government Bond**	3,62%	30/11/2021	9.967.937	0,38
35.000.000	Malaysia Government Bond**	3,73%	15/06/2028	8.803.482	0,34
25.000.000	Malaysia Government Bond**	3,76%	20/04/2023	6.213.972	0,24

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

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 del Estado 87,63% (31 de diciembre de 2020: 90,55%) (cont.)					
Ringgit malayo (cont.)					
8.440.000	Malaysia Government Bond**	3,76%	22/05/2040	1.913.753	0,07
39.000.000	Malaysia Government Bond**	3,80%	17/08/2023	9.742.499	0,37
54.830.000	Malaysia Government Bond**	3,83%	05/07/2034	13.164.331	0,51
6.000.000	Malaysia Government Bond**	3,84%	15/04/2033	1.469.141	0,06
22.500.000	Malaysia Government Bond**	3,90%	30/11/2026	5.717.269	0,22
49.000.000	Malaysia Government Bond**	3,90%	16/11/2027	12.448.973	0,48
27.345.000	Malaysia Government Bond**	3,91%	15/07/2026	6.955.626	0,27
12.734.000	Malaysia Government Bond**	3,96%	15/09/2025	3.237.583	0,12
42.800.000	Malaysia Government Bond**	4,06%	30/09/2024	10.853.239	0,42
23.610.000	Malaysia Government Bond**	4,07%	15/06/2050	5.458.777	0,21
9.700.000	Malaysia Government Bond**	4,23%	30/06/2031	2.506.940	0,10
14.650.000	Malaysia Government Bond**	4,25%	31/05/2035	3.681.209	0,14
15.125.000	Malaysia Government Bond**	4,64%	07/11/2033	3.959.110	0,15
12.619.000	Malaysia Government Bond**	4,89%	08/06/2038	3.300.693	0,13
5.100.000	Malaysia Government Bond**	4,94%	30/09/2043	1.341.896	0,05
28.000.000	Malaysia Government Investment Issue**	4,07%	30/09/2026	7.165.303	0,28
28.500.000	Malaysia Government Investment Issue**	4,37%	31/10/2028	7.422.666	0,29
Total ringgit malayo				137.773.675	5,31
Peso mexicano					
448.049.800	Mexican Bonos*	7,50%	03/06/2027	23.474.951	0,90
675.490.000	Mexican Bonos*	7,75%	23/11/2034	35.829.587	1,38
280.722.800	Mexican Bonos*	7,75%	13/11/2042	14.506.179	0,56
96.513.600	Mexican Bonos*	8,00%	07/11/2047	5.117.610	0,20
344.723.000	Mexican Bonos*	8,50%	18/11/2038	19.147.680	0,74
597.410.000	Mexican Bonos*	10,00%	05/12/2024	33.529.168	1,29
95.092.700	Mexican Bonos*	10,00%	20/11/2036	6.024.973	0,23
3.650.843.000	Mexico Cetes*	0,00%	01/07/2021	18.335.927	0,71
8.004.890.500	Mexico Cetes*	0,00%	29/07/2021	40.068.589	1,54
7.610.580.900	Mexico Cetes*	0,00%	04/11/2021	37.623.825	1,45
Total peso mexicano				233.658.489	9,00
Sol peruano					
26.015.000	Fondo MIVIVIENDA SA*	7,00%	14/02/2024	7.336.468	0,28
8.021.000	Peru Government Bond*	5,35%	12/08/2040	1.857.656	0,07
23.775.000	Peru Government Bond*	5,40%	12/08/2034	5.879.291	0,23
3.681.000	Peru Government Bond*	5,94%	12/02/2029	1.052.282	0,04
29.591.000	Peru Government Bond*	6,15%	12/08/2032	8.107.427	0,31

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

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 del Estado 87,63% (31 de diciembre de 2020: 90,55%) (cont.)					
Sol peruano (cont.)					
7.783.000	Peruvian Government International Bond**	5,20%	12/09/2023	2.222.418	0,09
8.714.000	Peruvian Government International Bond*	5,40%	12/08/2034	2.154.874	0,08
19.115.000	Peruvian Government International Bond**	6,90%	12/08/2037	5.300.330	0,21
76.231.000	Peruvian Government International Bond*	6,95%	12/08/2031	22.374.562	0,86
166.000	Peruvian Government International Bond**	8,20%	12/08/2026	53.911	0,00
Total sol peruano				56.339.219	2,17
Zloty polaco					
45.043.000	Republic of Poland Government Bond**	1,25%	25/10/2030	11.453.014	0,44
51.312.000	Republic of Poland Government Bond*	2,50%	25/04/2024	14.196.599	0,55
108.541.000	Republic of Poland Government Bond*	2,50%	25/07/2027	30.338.557	1,17
96.650.000	Republic of Poland Government Bond**	2,75%	25/04/2028	27.520.150	1,06
25.179.000	Republic of Poland Government Bond**	5,75%	25/04/2029	8.638.419	0,33
Total zloty polaco				92.146.739	3,55
Nuevo leu rumano					
24.975.000	Romania Government Bond*	3,25%	24/06/2026	6.135.143	0,24
20.395.000	Romania Government Bond*	3,65%	28/07/2025	5.098.120	0,20
25.925.000	Romania Government Bond*	3,65%	24/09/2031	6.337.985	0,24
36.620.000	Romania Government Bond*	4,00%	25/10/2023	9.141.631	0,35
57.530.000	Romania Government Bond*	4,15%	26/01/2028	14.737.302	0,57
73.040.000	Romania Government Bond*	4,40%	25/09/2023	18.423.704	0,71
7.695.000	Romania Government Bond*	4,75%	11/10/2034	1.989.298	0,08
20.000.000	Romania Government Bond*	4,85%	22/04/2026	5.255.856	0,20
Total nuevo leu rumano				67.119.039	2,59
Rublo ruso					
5.613.118.000	Russian Federal Bond - OFZ*	4,50%	16/07/2025	70.592.392	2,72
2.376.993.000	Russian Federal Bond - OFZ*	6,90%	23/05/2029	32.439.652	1,25
4.393.945.000	Russian Federal Bond - OFZ*	7,25%	10/05/2034	61.004.434	2,35
109.680.000	Russian Federal Bond - OFZ*	7,70%	16/03/2039	1.589.926	0,06
288.114.000	Russian Federal Bond - OFZ*	8,50%	17/09/2031	4.352.250	0,17
2.441.651.090	Russian Federal Inflation Linked Bond*	2,50%	17/07/2030	32.770.924	1,26
Total rublo ruso				202.749.578	7,81
Dinar serbio					
208.700.000	Serbia Treasury Bonds*	4,50%	11/01/2026	2.309.536	0,09
438.780.000	Serbia Treasury Bonds*	5,88%	08/02/2028	5.320.018	0,20
Total dinar serbio				7.629.554	0,29

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

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 del Estado 87,63% (31 de diciembre de 2020: 90,55%) (cont.)					
Rand sudafricano					
132.109.601	Republic of South Africa Government Bond*	6,25%	31/03/2036	6.554.186	0,25
370.495.192	Republic of South Africa Government Bond*	8,00%	31/01/2030	24.582.307	0,95
308.720.587	Republic of South Africa Government Bond*	8,25%	31/03/2032	19.726.075	0,76
959.093.235	Republic of South Africa Government Bond*	8,50%	31/01/2037	57.661.263	2,22
396.498.342	Republic of South Africa Government Bond*	8,75%	31/01/2044	23.492.643	0,91
189.916.390	Republic of South Africa Government Bond*	8,75%	28/02/2048	11.197.673	0,43
644.463.481	Republic of South Africa Government Bond*	8,88%	28/02/2035	40.924.342	1,58
340.170.775	Republic of South Africa Government Bond*	9,00%	31/01/2040	20.884.310	0,80
256.134.274	Republic of South Africa Government Bond*	10,50%	21/12/2026	20.325.573	0,78
Total rand sudafricano				225.348.372	8,68
Baht tailandés					
100.000.000	Thailand Government Bond**	0,95%	17/06/2025	3.151.890	0,12
625.870.000	Thailand Government Bond**	1,45%	17/12/2024	20.073.583	0,77
186.041.000	Thailand Government Bond*	1,59%	17/12/2035	5.371.536	0,21
67.216.000	Thailand Government Bond**	1,60%	17/12/2029	2.098.793	0,08
119.850.000	Thailand Government Bond**	1,60%	17/06/2035	3.494.028	0,14
645.070.000	Thailand Government Bond*	2,00%	17/12/2031	20.542.372	0,79
742.000.000	Thailand Government Bond**	2,13%	17/12/2026	24.603.425	0,95
542.500.000	Thailand Government Bond**	2,40%	17/12/2023	17.690.340	0,68
335.550.000	Thailand Government Bond**	2,88%	17/12/2028	11.570.048	0,45
29.629.000	Thailand Government Bond**	2,88%	17/06/2046	970.691	0,04
765.830.000	Thailand Government Bond**	3,30%	17/06/2038	26.921.436	1,04
500.700.000	Thailand Government Bond**	3,40%	17/06/2036	17.768.294	0,68
80.000.000	Thailand Government Bond**	3,63%	16/06/2023	2.645.818	0,10
2.000	Thailand Government Bond**	3,65%	17/12/2021	63	0,00
672.000.000	Thailand Government Bond**	3,65%	20/06/2031	24.505.136	0,94
290.000.000	Thailand Government Bond**	3,78%	25/06/2032	10.732.988	0,41
224.699.000	Thailand Government Bond**	3,85%	12/12/2025	7.952.736	0,31
145.000.000	Thailand Government Bond**	4,88%	22/06/2029	5.671.079	0,22
Total baht tailandés				205.764.256	7,93
Lira turca					
3.801.000	Turkey Government Bond*	8,80%	27/09/2023	368.294	0,01
49.113.054	Turkey Government Bond*	10,60%	11/02/2026	4.440.668	0,17
52.522.146	Turkey Government Bond*	11,00%	24/02/2027	4.688.452	0,18
48.106.538	Turkey Government Bond*	11,70%	13/11/2030	4.274.906	0,17
255.169.000	Turkey Government Bond*	12,60%	01/10/2025	25.113.035	0,97
Total lira turca				38.885.355	1,50

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

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 del Estado 87,63% (31 de diciembre de 2020: 90,55%) (cont.)					
Chelín ugandés					
48.689.400.000	Republic of Uganda Government Bonds*	14,25%	22/06/2034	13.759.942	0,53
Total chelín ugandés				13.759.942	0,53
Dólar estadounidense					
37.546.527	Argentine Republic Government International Bond*	0,13%	09/07/2030	13.543.408	0,52
17.314.571	Argentine Republic Government International Bond*	0,13%	09/07/2035	5.523.521	0,22
1.535.072	Argentine Republic Government International Bond*	1,00%	09/07/2029	585.139	0,02
Total dólar estadounidense				19.652.068	0,76
Peso uruguayo					
98.622.559	Uruguay Government International Bond*	4,38%	15/12/2028	2.692.592	0,10
653.643.000	Uruguay Government International Bond*	9,88%	20/06/2022	15.478.092	0,60
Total peso uruguayo				18.170.684	0,70
Kwacha zambiano					
299.379.000	Zambia Government Bond*	13,00%	25/01/2031	5.818.433	0,22
Total kwacha zambiano				5.818.433	0,22
Total bonos del Estado				2.274.633.510	87,63
Número de acciones	Descripción de los valores			Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Fondos de inversión 0,74% (31 de diciembre de 2020: 0,67%)					
Dólar estadounidense					
1.845.000	Neuberger Berman China Bond Fund			19.317.150	0,74
Total fondos de inversión #				19.317.150	0,74
Total inversiones				2.409.870.332	92,84

Contratos de divisas a plazo 1,72% (31 de diciembre de 2020: 1,47%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
65.991.880 BRL	12.998.204 USD	02/07/2021	Citibank NA	1	153.222	0,01
25.757.915 BRL	4.947.071 USD	02/09/2021	Goldman Sachs International	1	147.712	0,01
777.763.762 BRL	142.343.295 USD	02/07/2021	HSBC Bank Plc	1	12.656.110	0,49
23.738.394 BRL	4.539.723 USD	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	191.067	0,01
511.504.814 BRL	95.505.017 USD	02/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	5.668.008	0,22
33.665.190 BRL	6.159.018 USD	02/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	550.069	0,02
29.169.710 BRL	5.564.655 USD	02/07/2021	UBS AG	1	248.534	0,01
17.041.467 CNY	2.618.634 USD	08/10/2021	Barclays Bank Plc	1	289	0,00

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 1,72% (31 de diciembre de 2020: 1,47%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
256.283.116 CNY	38.918.252 USD	09/07/2021	Citibank NA	2	727.361	0,03
24.655.172 CNY	3.795.190 USD	09/07/2021	HSBC Bank Plc	1	18.832	0,00
82.515.774 CNY	12.750.659 USD	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	21.000	0,00
11.456 CNY	1.772 USD	02/07/2021	Morgan Stanley	1	1	0,00
558.163.872 CZK	21.804.590 €	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	37.190	0,00
21.424.293 €	96.716.554 PLN	07/07/2021	Goldman Sachs International	1	3.973	0,00
10.745.374 €	3.768.220.739 HUF	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	49.194	0,00
11.509 USD	51.904 PLN	30/09/2021	HSBC Bank Plc	1	37	0,00
24.154.637 €	108.791.086 PLN	07/07/2021	HSBC Bank Plc	1	70.458	0,00
10.789.940 €	3.768.224.791 HUF	15/09/2021	HSBC Bank Plc	1	102.115	0,00
2.527.169 €	877.967.794 HUF	15/09/2021	Morgan Stanley	1	39.465	0,00
19.580.143 €	498.374.753 CZK	15/09/2021	Morgan Stanley	2	98.882	0,00
3.332.647 €	84.974.491 CZK	15/09/2021	UBS AG	1	9.935	0,00
3.789.340.532 HUF	10.630.998 €	15/09/2021	Citibank NA	1	157.917	0,01
3.816.905.562 HUF	10.726.288 €	15/09/2021	HSBC Bank Plc	1	137.737	0,01
896.329.626 INR	11.898.234 USD	09/07/2021	HSBC Bank Plc	1	150.017	0,01
3.193.485.797 KZT	7.405.184 USD	14/07/2021	Goldman Sachs International	1	56.000	0,00
4.371.218.839 KZT	10.045.315 USD	24/09/2021	Goldman Sachs International	1	13.870	0,00
3.024.643.509 KZT	7.025.069 USD	14/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	41.636	0,00
263.054.860 MXN	13.006.219 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	78.809	0,00
348.288.768 MXN	17.175.373 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	149.410	0,01
40.264.121 PEN	10.365.596 USD	16/07/2021	Goldman Sachs International	1	152.722	0,01
266.311.474 PHP	5.400.431 USD	10/09/2021	Morgan Stanley	1	22.452	0,00
61.540.500 PLN	13.610.090 €	07/07/2021	Citibank NA	1	23.723	0,00
110.079.528 PLN	23.967.774 €	06/07/2021	Citibank NA	3	490.001	0,02
391.991.228 PLN	86.102.461 €	06/07/2021	Goldman Sachs International	3	851.059	0,03
321.548.008 PLN	71.068.380 €	15/09/2021	Goldman Sachs International	2	68.717	0,00
98.157.430 PLN	21.588.577 €	07/07/2021	HSBC Bank Plc	1	179.675	0,01
98.157.457 PLN	21.545.721 €	06/07/2021	HSBC Bank Plc	1	230.856	0,01
15.134.691 PLN	3.329.842 €	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	26.400	0,00
55.865.146 PLN	12.357.305 €	02/07/2021	Morgan Stanley	1	19.788	0,00
11.297.577 PLN	2.480.220 €	06/07/2021	UBS AG	1	26.116	0,00
45.050.803 RON	9.044.872 €	06/10/2021	Citibank NA	2	57.485	0,00
113.444.063 RON	22.770.787 €	06/10/2021	Goldman Sachs International	1	151.211	0,01
59.830.679 RON	12.005.719 €	06/10/2021	JPMorgan Chase Bank	2	84.087	0,00
1.025.978.321 RUB	13.441.351 USD	16/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	576.029	0,02
5.043.278.733 RUB	65.274.026 USD	16/07/2021	Morgan Stanley	2	3.629.532	0,14
397.848.439 RUB	5.314.447 USD	16/07/2021	UBS AG	1	121.138	0,01

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 1,72% (31 de diciembre de 2020: 1,47%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
68.541.279 THB	2.130.398 USD	29/09/2021	Goldman Sachs International	1	7.384	0,00
62.198.864 TRY	6.782.147 USD	22/09/2021	Barclays Bank Plc	1	80.975	0,00
404.032.997 UAH	13.808.570 USD	22/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	907.504	0,04
20.472.828 USD	651.078.918 THB	01/07/2021	Barclays Bank Plc	1	158.353	0,01
78.992.308 USD	66.357.507 €	06/07/2021	BNP Paribas	1	292.275	0,01
4.492.606 USD	28.709.455 CNY	09/07/2021	BNP Paribas	1	51.409	0,00
178.329.773 USD	876.699.948 BRL	02/07/2021	Citibank NA	2	3.613.521	0,14
32.199.595 USD	26.813.566 €	06/07/2021	Citibank NA	2	398.694	0,02
26.810.350 USD	840.358.618 THB	01/07/2021	Citibank NA	1	590.112	0,02
10.884.874 USD	54.222.565 BRL	02/09/2021	Citibank NA	1	159.929	0,01
2.673.919 USD	17.248.712 CNY	09/07/2021	Citibank NA	1	5.637	0,00
12.942.269 USD	82.527.230 CNY	02/07/2021	Citibank NA	1	168.836	0,01
40.737.071 USD	2.978.002.109 RUB	16/07/2021	Citibank NA	1	50.258	0,00
22.369.853 USD	1.655.266.197 INR	16/09/2021	Citibank NA	1	311.822	0,01
17.501.139 USD	247.270.509 ZAR	06/07/2021	Citibank NA	1	192.454	0,01
275.045 USD	307.712.168 KRW	19/07/2021	Citibank NA	1	2.741	0,00
6.853.902 USD	5.757.579 €	06/07/2021	Goldman Sachs International	2	25.411	0,00
12.934.414 USD	358.438.468 TWD	21/07/2021	Goldman Sachs International	1	74.391	0,00
5.608.362 USD	18.216.903 ILS	10/09/2021	Goldman Sachs International	1	13.279	0,00
13.950.677 USD	388.372.900 TWD	26/07/2021	Goldman Sachs International	1	10.690	0,00
18.980.548 USD	95.324.109 BRL	03/08/2021	Goldman Sachs International	1	48.215	0,00
12.936.333 USD	182.148.018 ZAR	06/07/2021	Goldman Sachs International	1	186.156	0,01
13.727 USD	11.526 €	06/07/2021	HSBC Bank Plc	1	58	0,00
12.679.594 USD	351.769.963 TWD	09/07/2021	HSBC Bank Plc	1	71.803	0,00
3.705.545 USD	51.079.732 ZAR	06/07/2021	HSBC Bank Plc	1	130.015	0,01
62.171.568 USD	897.477.193.275 IDR	19/08/2021	HSBC Bank Plc	2	801.578	0,03
155.484.339 USD	777.763.762 BRL	02/07/2021	HSBC Bank Plc	1	484.935	0,02
26.452.118 USD	35.406.636 SGD	12/07/2021	HSBC Bank Plc	1	112.402	0,00
15.905.050 USD	225.046.531 ZAR	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	152.021	0,01
4.745.591 USD	23.738.394 BRL	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	14.801	0,00
26.692.752 USD	96.215.627.372 COP	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.034.670	0,04
14.090.892 USD	279.686.601 MXN	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	43.701	0,00
2.548.244 USD	2.132.058 €	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	19.622	0,00
10.336.501 USD	42.813.787 MYR	03/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	56.340	0,00
5.304.607 USD	4.440.180 €	06/07/2021	Morgan Stanley	1	38.551	0,00
3.743.570 USD	54.742.228.027 IDR	19/08/2021	Standard Chartered Bank	1	266	0,00
1.690.534 USD	81.580.116 PHP	10/09/2021	Standard Chartered Bank	1	29.324	0,00
6.730.077 USD	33.665.190 BRL	02/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	20.990	0,00

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 1,72% (31 de diciembre de 2020: 1,47%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
27.331.132 USD	22.871.277 €	06/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	205.787	0,01
5.831.376 USD	29.169.710 BRL	02/07/2021	UBS AG	1	18.187	0,00
11.452.716 USD	9.586.181 €	06/07/2021	UBS AG	1	83.501	0,00
300.409.568.594 VND	13.013.193 USD	24/08/2021	Citibank NA	1	17.058	0,00
399.713.521 ZAR	27.884.835 USD	06/07/2021	Goldman Sachs International	1	94.707	0,00
200.020.759 ZAR	13.699.866 USD	06/07/2021	Morgan Stanley	1	301.384	0,01
Clases AUD con cobertura						
1.507 AUD	1.128 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	4	0,00
500.785 USD	664.684 AUD	15/09/2021	Citibank NA	1	1.612	0,00
1.104.505 USD	1.426.383 AUD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	33.557	0,00
435.504 USD	563.522 AUD	19/07/2021	UBS AG	1	12.404	0,00
581.031 USD	754.009 AUD	15/09/2021	UBS AG	1	14.776	0,00
4.897.788 USD	6.336.373 AUD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	65	140.349	0,01
852.954 USD	1.118.091 AUD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	16	13.276	0,00
Clases EUR con cobertura						
227 €	270 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	2	0	0,00
571.557 USD	479.089 €	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	2.507	0,00
620.087 USD	516.330 €	19/07/2021	UBS AG	1	7.550	0,00
741.975 USD	611.454 €	15/09/2021	UBS AG	1	15.705	0,00
5.747.237 USD	4.768.143 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	14	90.663	0,01
1.709.144 USD	1.422.294 €	15/09/2021	Westpac Banking Corp	17	19.778	0,00
Clases GBP con cobertura						
767 £	1.054 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	5	0,00
465 £	639 USD	19/07/2021	UBS AG	1	3	0,00
931 USD	669 £	15/09/2021	UBS AG	1	7	0,00
983 USD	697 £	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	20	0,00
1.681 USD	1.204 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	18	0,00
Clases SEK con cobertura						
115.186 SEK	13.391 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	79	0,00
4.225 SEK	493 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	1	0,00
3.660 SEK	425 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	2	3	0,00
9.727 USD	81.762 SEK	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	165	0,00
133.860.726 USD	1.105.941.787 SEK	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	4.451.250	0,17
12.353 USD	104.937 SEK	19/07/2021	UBS AG	1	81	0,00
27.547 USD	231.449 SEK	19/07/2021	Westpac Banking Corp	7	479	0,00
26.125 USD	220.434 SEK	15/09/2021	Westpac Banking Corp	2	331	0,00

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 1,72% (31 de diciembre de 2020: 1,47%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases SGD con cobertura						
9.323 USD	12.463 SGD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	52	0,00
19.750 USD	26.271 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	9	205	0,00
83.188 USD	110.230 SGD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	3	1.199	0,00
Clases ZAR con cobertura						
846.089 USD	12.061.831 ZAR	19/07/2021	UBS AG	1	3.178	0,00
1.584.890 USD	22.104.057 ZAR	15/09/2021	UBS AG	2	51.953	0,00
6.900.340 USD	96.203.382 ZAR	19/07/2021	Westpac Banking Corp	32	177.408	0,01
3.238.922 USD	45.683.619 ZAR	15/09/2021	Westpac Banking Corp	13	70.721	0,00
22.717.189 ZAR	1.553.181 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	34.352	0,00
23.154.422 ZAR	1.602.159 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	10	15.931	0,00
151.191 ZAR	10.457 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	2	28	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					44.531.238	1,72

Contratos de futuros 0,01% (31 de diciembre de 2020: 0,01%)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(526)	90-Day Eurodollar Future December 2023	131.500	0,01
(294)	South Korea 10-Year Bond Future September 2021	15.664	0,00
(234)	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2021	106.280	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de futuros *		253.444	0,01

Contratos de swap de tipos de interés 0,57% (31 de diciembre de 2020: 2,17%)

Importe notional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar) [#]	Tipo fijo	Tipo variable	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto	
BRL	227.468.792	03/01/2022	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,89%	1D BROIS	2.389.197	0,09
BRL	125.737.792	03/01/2022	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	6,07%	1D BROIS	1.425.314	0,06
BRL	127.702.115	03/01/2022	Morgan Stanley	(Pagar)	5,79%	1D BROIS	1.281.820	0,05
BRL	23.266.207	02/01/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	9,26%	1D BROIS	993.434	0,04
CZK	657.825.161	10/02/2026	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,32%	6M PRIBOR	804.517	0,03
BRL	149.442.185	02/01/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,72%	1D BROIS	760.610	0,03
BRL	139.508.229	02/01/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	4,43%	1D BROIS	760.422	0,03
BRL	70.666.599	02/01/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	6,77%	1D BROIS	721.831	0,03
BRL	6.697.271	02/01/2023	Goldman Sachs International	(Pagar)	10,84%	1D BROIS	531.058	0,02
BRL	52.135.595	02/01/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	6,61%	1D BROIS	488.369	0,02
BRL	42.352.484	03/01/2022	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,89%	1D BROIS	444.845	0,02
COP	22.885.384.032	16/03/2031	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	4,88%	1D COOVIBR	433.395	0,02
MXN	533.204.488	21/03/2030	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	7,11%	28D MXIBTIIIE	356.397	0,01

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de swap de tipos de interés 0,57% (31 de diciembre de 2020: 2,17%) (cont.)

	Importe nocional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar) [#]	Tipo fijo	Tipo variable	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
MXN	150.000.000	20/02/2025	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	7,82%	28D MXIBTIE	352.083	0,01
MXN	95.000.000	28/12/2026	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	8,16%	28D MXIBTIE	340.575	0,01
BRL	3.000.000	02/01/2023	Goldman Sachs International	(Pagar)	11,99%	1D BROIS	322.155	0,01
MXN	496.707.800	07/07/2022	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	6,71%	28D MXIBTIE	290.965	0,01
MXN	123.677.961	20/04/2027	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	7,51%	28D MXIBTIE	255.604	0,01
BRL	407.389.722	02/01/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	6,23%	1D BROIS	247.797	0,01
BRL	53.719.957	02/01/2024	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	6,50%	1D BROIS	246.970	0,01
COP	6.940.054.447	08/07/2030	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	4,21%	1D COOVIBR	204.938	0,01
BRL	47.654.667	02/01/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,58%	1D BROIS	196.220	0,01
BRL	48.420.200	02/01/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,36%	1D BROIS	129.872	0,01
CZK	575.937.395	13/05/2026	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,81%	6M PRIBOR	115.829	0,01
BRL	40.209.304	02/01/2025	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	6,82%	1D BROIS	112.106	0,01
MXN	424.177.706	10/09/2029	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	6,82%	28D MXIBTIE	84.297	0,00
COP	17.004.237.000	11/03/2030	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	5,47%	1D COOVIBR	78.075	0,00
MXN	100.000.000	21/01/2022	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	7,71%	28D MXIBTIE	75.190	0,00
PLN	59.808.739	26/02/2030	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	1,75%	6M WIBOR	73.124	0,00
MXN	116.684.677	23/06/2022	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	6,75%	28D MXIBTIE	70.382	0,00
CLP	3.236.620.707	10/05/2022	JPMorgan Chase Bank	(Pagar)	3,43%	1D CLICP	69.245	0,00
CZK	302.286.156	13/05/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	1,88%	6M PRIBOR	57.853	0,00
CZK	1.035.557.159	18/06/2024	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,70%	6M PRIBOR	52.026	0,00
BRL	85.929.932	02/01/2025	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	7,73%	1D BROIS	22.193	0,00
COP	3.052.820.394	12/03/2030	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	5,45%	1D COOVIBR	15.177	0,00
MXN	111.287.626	12/09/2022	Goldman Sachs International	(Pagar)	5,90%	28D MXIBTIE	14.002	0,00
PLN	488.754.601	02/07/2023	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	1,17%	6M WIBOR	9.505	0,00
ZAR	1.516.583	26/06/2023	UBS AG	(Pagar)	8,16%	3M JIBAR	6.892	0,00
KRW	16.702.000.000	05/02/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,40%	3M KORIBOR	448	0,00
KRW	15.847.000.000	19/02/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,50%	3M KORIBOR	313	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de swap de tipos de interés^{oo}							14.835.045	0,57

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

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

¹Swap liquidada centralmente.

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	2.469.490.059	95,14

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (1,45%) (31 de diciembre de 2020: (0,85%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
810.708.068 BRL	162.070.303 USD	02/07/2021	Citibank NA	1	(505.475)	(0,02)
810.708.068 BRL	164.631.835 USD	03/08/2021	Citibank NA	1	(3.617.003)	(0,14)
78.824.800 BRL	15.758.026 USD	02/07/2021	Goldman Sachs International	1	(49.147)	(0,00)
40.796.068 BRL	8.155.625 USD	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(25.436)	(0,00)
48.573.282.172 CLP	67.660.003 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(1.084.553)	(0,04)
8.719.138.235 CLP	12.181.821 USD	15/09/2021	HSBC Bank Plc	1	(231.207)	(0,01)
43.065.849 CNY	6.690.275 USD	09/07/2021	HSBC Bank Plc	1	(28.221)	(0,00)
16.869.540 CNY	2.616.033 USD	09/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(6.406)	(0,00)
136.662.340 CZK	5.367.863 €	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(25.540)	(0,00)
4.140.575 €	18.980.357 PLN	06/07/2021	BNP Paribas	1	(75.054)	(0,00)
66.357.507 €	79.038.287 USD	04/08/2021	BNP Paribas	1	(290.062)	(0,01)
25.895.431 €	31.275.608 USD	06/07/2021	Brown Brothers Harriman	2	(563.615)	(0,02)
2.230.552 €	10.378.531 PLN	06/07/2021	Citibank NA	1	(80.806)	(0,00)
21.350.565 €	25.984.748 USD	06/07/2021	Citibank NA	1	(662.968)	(0,03)
3.862.358 €	98.737.658 CZK	15/09/2021	Citibank NA	1	(419)	(0,00)
33.253.164 €	150.172.348 PLN	07/07/2021	Goldman Sachs International	1	(8.607)	(0,00)
58.467.764 €	265.524.959 PLN	06/07/2021	Goldman Sachs International	2	(405.547)	(0,02)
69.806.854 €	317.854.255 PLN	06/07/2021	HSBC Bank Plc	3	(703.288)	(0,03)
20.268.569 €	24.130.315 USD	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(91.784)	(0,00)
21.848.424 €	25.999.812 USD	06/07/2021	Morgan Stanley	1	(87.572)	(0,00)
3.073.750 €	13.922.379 PLN	06/07/2021	Morgan Stanley	1	(11.675)	(0,00)
20.193.473 €	24.228.068 USD	06/10/2021	Standard Chartered Bank	1	(231.157)	(0,01)
22.595.315 €	27.609.012 USD	06/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(810.958)	(0,03)
26.011.570 €	31.844.235 USD	06/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(994.502)	(0,04)
1.065.598.151 HUF	3.027.996 €	15/09/2021	Citibank NA	1	(1.274)	(0,00)
4.098.365.856 HUF	11.725.025 €	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(98.897)	(0,00)
74.814.410.278 IDR	5.250.746 USD	27/07/2021	BNP Paribas	1	(119.287)	(0,00)
73.138.504.023 IDR	5.128.927 USD	27/07/2021	Morgan Stanley	1	(112.417)	(0,00)
229.274.909.047 IDR	15.921.086 USD	19/08/2021	Standard Chartered Bank	2	(243.140)	(0,01)
27.302.670.836 KRW	24.580.171 USD	09/07/2021	Citibank NA	1	(418.088)	(0,02)
13.675.620.150 KRW	12.257.325 USD	16/07/2021	HSBC Bank Plc	1	(155.183)	(0,01)
27.945.934.559 KRW	24.744.930 USD	21/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(14.947)	(0,00)
135.194.765 MXN	6.740.694 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(15.758)	(0,00)
368.274.453 MXN	18.402.640 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	2	(83.718)	(0,00)
77.794.292 MYR	18.875.238 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(176.462)	(0,01)
87.669.858 MYR	21.162.493 USD	03/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(111.791)	(0,00)
10.963.284 MYR	2.655.513 USD	04/08/2021	Standard Chartered Bank	1	(20.358)	(0,00)
188.520.662 MYR	45.736.506 USD	15/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(380.617)	(0,02)
46.670.057 PEN	12.390.829 USD	16/07/2021	Citibank NA	1	(199.069)	(0,01)

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (1,45%) (31 de diciembre de 2020: (0,85%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
11.365.065 PEN	3.151.916 USD	16/07/2021	Goldman Sachs International	1	(182.985)	(0,01)
617.000.811 PHP	12.617.604 USD	26/07/2021	HSBC Bank Plc	1	(11.080)	(0,00)
617.309.774 PHP	12.642.019 USD	26/07/2021	Morgan Stanley	1	(29.182)	(0,00)
95.143.686 PLN	21.297.596 €	07/07/2021	Citibank NA	1	(266.872)	(0,01)
179.901.419 PLN	40.240.110 €	30/09/2021	Goldman Sachs International	1	(544.191)	(0,02)
100.838.371 PLN	22.584.561 €	07/07/2021	Morgan Stanley	1	(297.349)	(0,01)
49.549.931 RON	9.777.019 €	30/06/2022	HSBC Bank Plc	1	(1.493)	(0,00)
35.386.259 SGD	26.731.561 USD	12/07/2021	Goldman Sachs International	1	(407.004)	(0,02)
651.078.918 THB	20.429.018 USD	29/09/2021	Barclays Bank Plc	1	(122.062)	(0,01)
200.980.730 THB	6.449.939 USD	01/07/2021	Citibank NA	1	(179.089)	(0,01)
403.804.387 THB	12.942.838 USD	01/07/2021	Goldman Sachs International	2	(343.638)	(0,01)
401.531.290 THB	12.599.036 USD	01/07/2021	HSBC Bank Plc	1	(70.759)	(0,00)
485.121.129 THB	15.196.555 USD	01/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(60.170)	(0,00)
392.081.959 TWD	14.207.155 USD	09/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(154.542)	(0,01)
304.217.348 UAH	10.663.069 USD	16/12/2021	Goldman Sachs International	1	(55.644)	(0,00)
32.187.538 USD	474.000.129.075 IDR	27/07/2021	Citibank NA	1	(323.742)	(0,01)
22.746.040 USD	117.232.751 BRL	02/09/2021	Citibank NA	2	(441.996)	(0,02)
3.882.325 USD	295.099.394 RUB	16/07/2021	Citibank NA	1	(149.457)	(0,01)
14.978.869 USD	78.824.800 BRL	02/07/2021	Goldman Sachs International	1	(730.010)	(0,03)
12.953.686 USD	269.933.747 MXN	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(473.515)	(0,02)
12.698.271 USD	17.073.469 SGD	26/07/2021	Goldman Sachs International	1	(2.566)	(0,00)
27.571.359 USD	399.713.521 ZAR	01/10/2021	Goldman Sachs International	1	(88.455)	(0,00)
5.083.498 USD	74.393.076 ZAR	06/07/2021	HSBC Bank Plc	1	(123.942)	(0,01)
3.762.715 USD	24.488.556 CNY	09/07/2021	HSBC Bank Plc	1	(25.533)	(0,00)
46.172.039 USD	671.472.847 ZAR	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(830.381)	(0,03)
7.488.224 USD	40.796.068 BRL	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(641.965)	(0,03)
21.345.953 USD	1.568.393.920 RUB	16/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(82.155)	(0,00)
1.760 USD	11.456 CNY	08/10/2021	Morgan Stanley	1	(0)	(0,00)
12.682.149 USD	17.073.470 SGD	26/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(18.689)	(0,00)
12.063.348 USD	918.165.518 INR	09/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(278.416)	(0,01)
13.935.410 USD	388.372.900 TWD	26/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(4.578)	(0,00)
7.177.300 USD	531.047.226 RUB	16/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(78.107)	(0,00)
5.917.345 USD	119.002.731 MXN	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(2.158)	(0,00)
499.417.130 ZAR	35.428.745 USD	06/07/2021	Citibank NA	4	(470.052)	(0,02)
352.259.302 ZAR	25.966.699 USD	06/07/2021	Goldman Sachs International	1	(1.308.904)	(0,05)
Clases AUD con cobertura						
89.201.169 AUD	69.239.026 USD	15/09/2021	Citibank NA	3	(2.249.606)	(0,09)
1.203.838 AUD	933.640 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(29.782)	(0,00)
587.725 AUD	450.100 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(8.828)	(0,00)

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (1,45%) (31 de diciembre de 2020: (0,85%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases AUD con cobertura (cont.)						
3.700.626 AUD	2.885.426 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	22	(106.944)	(0,01)
393.163 AUD	295.969 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	7	(707)	(0,00)
983.848 USD	1.312.577 AUD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	2	(1.887)	(0,00)
EUR Hedged Classes						
586.782 €	699.771 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(2.806)	(0,00)
2.545.145 €	3.070.168 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	5	(50.794)	(0,00)
357.735 €	436.677 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(12.286)	(0,00)
61.526.930 €	74.941.155 USD	15/09/2021	UBS AG	2	(1.860.979)	(0,07)
3.653.632 €	4.420.822 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	73	(86.423)	(0,00)
342.050 €	411.070 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	8	(4.793)	(0,00)
98.832 USD	83.220 €	15/09/2021	Westpac Banking Corp	2	(15)	(0,00)
GBP Hedged Classes						
493 £	699 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(18)	(0,00)
825 £	1.143 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(3)	(0,00)
767 £	1.060 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(1)	(0,00)
1.014 £	1.419 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(18)	(0,00)
81.329 £	115.178 USD	15/09/2021	UBS AG	2	(2.808)	(0,00)
2.634 £	3.719 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	(80)	(0,00)
1.250 USD	905 £	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	(0)	(0,00)
Clases SEK con cobertura						
123.651 SEK	14.526 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(57)	(0,00)
547.648 SEK	65.642 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	5	(1.595)	(0,00)
1.118.385.825 SEK	135.366.924 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(4.501.336)	(0,17)
75.986 SEK	9.110 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(224)	(0,00)
344.415 SEK	41.342 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	16	(1.062)	(0,00)
8.000 SEK	949 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	5	(12)	(0,00)
16.191 USD	139.336 SEK	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	(113)	(0,00)
Clases SGD con cobertura						
8.023 SGD	5.975 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(8)	(0,00)
30.804 SGD	23.186 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	4	(270)	(0,00)
4.980 SGD	3.766 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(61)	(0,00)
92.853 SGD	69.632 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	20	(557)	(0,00)
950.902 SGD	718.766 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	3	(11.489)	(0,00)
12.831 USD	17.256 SGD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	3	(3)	(0,00)
Clases ZAR con cobertura						
2.585.348 USD	37.576.108 ZAR	19/07/2021	Citibank NA	1	(40.564)	(0,00)
1.297.156 USD	18.769.314 ZAR	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(4.513)	(0,00)
720.503 USD	10.643.887 ZAR	19/07/2021	UBS AG	2	(23.319)	(0,00)

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (1,45%) (31 de diciembre de 2020: (0,85%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases ZAR con cobertura (cont.)						
6.329.155 USD	92.526.390 ZAR	19/07/2021	Westpac Banking Corp	30	(136.817)	(0,01)
2.334.178 USD	33.724.288 ZAR	15/09/2021	Westpac Banking Corp	5	(4.632)	(0,00)
1.940.725.281 ZAR	141.382.163 USD	15/09/2021	Citibank NA	3	(6.791.066)	(0,26)
10.365.440 ZAR	731.652 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(7.290)	(0,00)
14.434.086 ZAR	1.004.693 USD	15/09/2021	UBS AG	1	(3.675)	(0,00)
84.217.413 ZAR	6.008.035 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	17	(122.711)	(0,01)
15.050.454 ZAR	1.046.342 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	9	(2.580)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(37.615.421)	(1,45)

Contratos de futuros (0,01%) (31 de diciembre de 2020: (0,00%))

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(604)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2021	(254.681)	(0,01)
Minusvalía latente total sobre contratos de futuros *		(254.681)	(0,01)

Contratos de swaps de tipos de interés (0,89%) (31 de diciembre de 2020: (0,73%))

Importe notional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar) [#]	Tipo fijo	Tipo variable	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto	
CNY	140.000.000	01/07/2026	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	2,78%	7D CNRR007	(236)	(0,00)
THB	900.500.000	01/03/2026	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,00%	6M BKIBOR	(2.308)	(0,00)
INR	11.000.000.000	07/02/2023	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	4,42%	1D MIBOR	(3.373)	(0,00)
THB	1.000.000.000	10/03/2026	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,10%	6M BKIBOR	(7.188)	(0,00)
CLP	45.161.320	24/08/2030	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	2,15%	1D CLICP	(9.968)	(0,00)
BRL	72.058.419	02/01/2024	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	7,45%	1D BROIS	(16.899)	(0,00)
PLN	110.414.569	02/07/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	2,12%	6M WIBOR	(18.366)	(0,00)
MXN	34.061.309	08/12/2025	Goldman Sachs International	(Pagar)	6,21%	28D MXIBTIIE	(21.114)	(0,00)
BRL	231.387.210	02/01/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	6,97%	1D BROIS	(23.844)	(0,00)
BRL	42.953.698	02/01/2025	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	6,46%	1D BROIS	(24.561)	(0,00)
MXN	90.000.000	21/05/2026	JPMorgan Chase Bank	(Pagar)	6,33%	28D MXIBTIIE	(48.551)	(0,00)
MXN	95.000.000	16/09/2026	Goldman Sachs International	(Pagar)	6,38%	28D MXIBTIIE	(52.578)	(0,00)
MXN	76.391.828	28/05/2026	JPMorgan Chase Bank	(Pagar)	6,16%	28D MXIBTIIE	(70.345)	(0,00)
RUB	2.094.217.124	06/12/2021	JPMorgan Chase Bank	(Pagar)	6,38%	3M MOSPRIME	(74.052)	(0,00)
MXN	512.441.055	31/08/2029	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	6,92%	28D MXIBTIIE	(74.473)	(0,00)
MXN	75.000.000	18/06/2026	JPMorgan Chase Bank	(Pagar)	6,13%	28D MXIBTIIE	(75.313)	(0,00)
MXN	94.552.835	05/03/2026	Goldman Sachs International	(Pagar)	6,17%	28D MXIBTIIE	(76.380)	(0,00)
MXN	60.000.000	08/04/2026	Goldman Sachs International	(Pagar)	5,95%	28D MXIBTIIE	(78.002)	(0,00)

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de swap de tipos de interés (0,89%) (31 de diciembre de 2020: (0,73%)) (cont.)

	Importe nocional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar) [#]	Tipo fijo	Tipo variable	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
COP	25.311.850.539	03/04/2029	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	5,81%	1D COOVIBR	(82.253)	(0,00)
COP	19.533.769.466	15/05/2029	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	5,93%	1D COOVIBR	(99.942)	(0,01)
BRL	107.195.155	02/01/2024	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,76%	1D BROIS	(132.134)	(0,01)
CLP	29.571.205.266	12/12/2021	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	1,96%	1D CLICP	(156.428)	(0,01)
COP	33.466.230.534	15/05/2029	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	5,92%	1D COOVIBR	(162.488)	(0,01)
BRL	49.384.188	02/01/2024	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,97%	1D BROIS	(196.848)	(0,01)
MXN	689.362.045	13/04/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,55%	28D MXIBTIIE	(262.237)	(0,01)
ZAR	125.243.584	28/02/2030	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	7,54%	3M JIBAR	(267.335)	(0,01)
BRL	233.904.000	03/01/2022	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	2,99%	1D BROIS	(284.263)	(0,01)
BRL	198.363.656	03/01/2022	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	2,89%	1D BROIS	(313.058)	(0,01)
PLN	50.216.606	25/03/2024	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,99%	6M WIBOR	(335.447)	(0,02)
MXN	272.272.993	06/04/2026	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,82%	28D MXIBTIIE	(428.641)	(0,02)
CLP	6.603.785.778	16/03/2026	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	2,26%	1D CLICP	(452.433)	(0,02)
BRL	171.494.694	02/01/2024	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,56%	1D BROIS	(502.080)	(0,02)
CZK	656.230.000	12/11/2030	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	1,40%	6M PRIBOR	(527.003)	(0,02)
CLP	9.321.845.831	12/04/2026	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	2,48%	1D CLICP	(531.850)	(0,02)
CZK	656.513.065	13/11/2030	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	1,38%	6M PRIBOR	(547.118)	(0,02)
RUB	6.346.790.059	02/04/2023	Goldman Sachs International	(Pagar)	7,07%	3M MOSPRIME	(813.949)	(0,03)
BRL	59.389.712	02/01/2024	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	4,99%	1D BROIS	(604.301)	(0,02)
MXN	1.081.791.781	19/06/2024	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,47%	28D MXIBTIIE	(626.168)	(0,02)
MXN	1.074.711.434	22/02/2024	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,15%	28D MXIBTIIE	(762.243)	(0,03)
CLP	8.243.089.517	12/01/2026	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	1,63%	1D CLICP	(831.172)	(0,03)
BRL	195.243.391	02/01/2024	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,68%	1D BROIS	(1.031.269)	(0,04)
BRL	136.490.816	01/07/2024	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,92%	1D BROIS	(1.111.774)	(0,04)
BRL	138.112.873	02/01/2025	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,65%	1D BROIS	(1.144.610)	(0,05)
MXN	1.551.588.424	22/11/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,01%	28D MXIBTIIE	(1.193.092)	(0,05)
MXN	420.720.666	25/06/2025	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	4,85%	28D MXIBTIIE	(1.225.583)	(0,05)
RUB	4.677.712.954	14/01/2023	Goldman Sachs International	(Pagar)	5,50%	3M MOSPRIME	(1.360.308)	(0,05)
CLP	21.831.060.743	17/06/2025	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	1,36%	1D CLICP	(2.071.280)	(0,08)
BRL	223.430.548	02/01/2024	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	4,84%	1D BROIS	(2.080.980)	(0,08)
CLP	21.997.154.748	23/06/2025	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	1,16%	1D CLICP	(2.333.224)	(0,09)
Minusvalía latente total sobre contratos de swap de tipos de interés^{oo}							(23.149.062)	(0,89)

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

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

¹Swap liquidada centralmente.

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

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	(61.019.164)	(2,35)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	2.408.470.895	92,79
Otro activo neto	187.147.827	7,21
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	2.595.618.722	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	1.715.039.834	60,59
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	653.067.119	23,07
† Otros valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario	22.446.229	0,79
μ Fondos de inversión	19.317.150	0,68
± Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	(1.237)	(0,00)
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(1.398.200)	(0,05)
Total inversiones	2.408.470.895	85,08

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
5.613.118.000	Russian Federal Bond - OFZ, 4.50%, 16/07/2025	70.642.516
172.025.365	Bank of Israel Bill – Makam, 0.00%, 02/09/2021	53.066.095
170.324.624	Bank of Israel Bill – Makam, 0.00%, 02/06/2021	51.666.901
12.245.100.000	Hungary Government Bond, 3.25%, 22/10/2031	47.012.252
8.004.890.500	Mexico Cetes, 0.00%, 29/07/2021	40.122.912
7.610.580.900	Mexico Cetes, 0.00%, 04/11/2021	37.495.070
324.891.901	Turkey Government Bond, 11.70%, 13/11/2030	36.775.570
675.490.000	Mexican Bonos, 7.75%, 23/11/2034	36.341.514
10.716.040.000	Hungary Government Bond, 2.25%, 20/04/2033	34.423.788
575.019.516	Republic of South Africa Government Bond, 8.50%, 31/01/2037	32.888.804
2.413.645.000	Russian Federal Bond - OFZ, 6.90%, 23/05/2029	32.875.751
2.350.821.819	Russian Federal Inflation Linked Bond, 2.50%, 17/07/2030	32.242.396
660.720.000	Czech Republic Government Bond, 2.40%, 17/09/2025	32.028.357
5.467.802.000	Mexico Cetes, 0.00%, 20/05/2021	26.832.564
378.200.000.000	Indonesia Treasury Bond, 5.50%, 15/04/2026	26.674.153
811.000.000	Thailand Government Bond, 2.00%, 17/12/2031	26.268.958
255.169.000	Turkey Government Bond, 12.60%, 01/10/2025	25.054.291
487.240.000	Czech Republic Government Bond, 1.00%, 26/06/2026	22.118.235
3.650.843.000	Mexico Cetes, 0.00%, 01/07/2021	17.602.486
274.683.176	Republic of South Africa Government Bond, 8.88%, 28/02/2035	17.238.474
301.112.075	Republic of South Africa Government Bond, 9.00%, 31/01/2040	16.655.860
108.000.000	China Government Bond, 3.27%, 19/11/2030	16.652.926
51.312.000	Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/04/2024	14.205.485
14.151.100	United States Treasury Bill, 0.00%, 20/05/2021	14.146.850
210.241.000	Egypt Government Bond, 15.90%, 02/07/2024	14.118.018
48.689.400.000	Uganda Government Bond, 14.25%, 22/06/2034	13.630.087
193.899.000	Egypt Government Bond, 14.48%, 06/04/2026	12.390.909

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

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
957.370.000	Czech Republic Government Bond, 2.75%, 23/07/2029	49.241.554
169.496.000	Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2026	49.010.488
806.379.548	Republic of South Africa Government Bond, 9.00%, 31/01/2040	48.305.673
12.493.660.000	Hungary Government Bond, 3.25%, 22/10/2031	46.630.051
955.595.600	Petroleos Mexicanos, 7.47%, 12/11/2026	42.423.897
643.650.100	Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031	36.093.323
261.945.291	Turkey Government Bond, 10.70%, 17/08/2022	33.808.586
230.000.000	China Government Bond, 2.68%, 21/05/2030	33.559.736
2.267.281.000	Russian Federal Bond - OFZ, 6.90%, 23/05/2029	31.361.748
9.515.430.000	Hungary Government Bond, 2.25%, 20/04/2033	30.983.058
100.586.000	Republic of Poland Government Bond, 2.75%, 25/10/2029	30.900.607
276.785.363	Turkey Government Bond, 11.70%, 13/11/2030	30.011.626
2.156.724.000	Russian Federal Bond - OFZ, 7.25%, 10/05/2034	29.920.980
417.475.000.000	Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/09/2030	29.721.832
1.875.733.000	Russian Federal Bond - OFZ, 7.95%, 07/10/2026	28.199.693
90.470.000	Malaysia Government Bond, 3.89%, 15/08/2029	23.377.929
1.550.000.000	India Government Bond, 6.45%, 07/10/2029	21.029.462
61.242.000	Peruvian Government International Bond, 6.95%, 12/08/2031	21.029.442
469.460.000	Thailand Government Bond, 3.30%, 17/06/2038	18.548.439
145.128.509	Turkey Government Bond, 10.50%, 11/08/2027	16.939.835
315.660.000	Mexican Bonos, 7.75%, 13/11/2042	16.225.067
202.514.394	Republic of South Africa Government Bond, 10.50%, 21/12/2026	16.000.889
110.393.231	Turkey Government Bond, 16.20%, 14/06/2023	15.228.081
199.800.000.000	Indonesia Treasury Bond, 7.50%, 15/04/2040	14.528.680
7.705.000.000	Bonos Tesoreria Pesos, 6.00%, 01/01/2043	14.260.023
318.700.000	Czech Republic Government Bond, 1.20%, 13/03/2031	14.192.304
257.343.863	Republic of South Africa Government Bond, 8.75%, 28/02/2048	13.793.775
102.554.902	Turkey Government Bond, 12.20%, 18/01/2023	13.564.264
51.700.000	Malaysia Government Bond, 4.06%, 30/09/2024	13.511.972
300.390.000	Czech Republic Government Bond, 0.95%, 15/05/2030	13.132.012
212.120.000	Mexican Bonos, 10.00%, 05/12/2024	12.785.253
190.295.255	Republic of South Africa Government Bond, 8.00%, 31/01/2030	12.467.105
82.000.000	China Government Bond, 2.85%, 04/06/2027	12.432.602
235.090.000	Czech Republic Government Bond, 2.40%, 17/09/2025	11.862.236
372.573.000	Thailand Government Bond, 1.59%, 17/12/2035	11.763.749
7.060.000.000	Bonos Tesoreria Pesos, 4.70%, 01/09/2030	11.694.242
166.537.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.50%, 15/02/2031	11.422.240
160.000.000.000	Indonesia Treasury Bond, 7.50%, 15/05/2038	11.322.057

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al -0,33%. En el mismo periodo, el índice JPM EMBI Global Diversified (Total Return, USD), registró una rentabilidad del -0,66%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Los bonos de mercados emergentes ("ME") en monedas fuertes se enfrentaron a un contexto volátil en la primera mitad del año al verse favorecidos los activos de riesgo por la sólida recuperación económica y las continuas campañas de vacunación mundial, a pesar de la presión que ejerció el "reflation trade" en los mercados de renta fija. Los valores del Tesoro fueron objeto de bruscas ventas masivas que llevaron las rentabilidades a 10 años a un máximo del 1,74% al final de marzo; esto quedó parcialmente contrarrestado a finales del segundo trimestre, a pesar del giro "hawkish" que adoptó la Reserva Federal estadounidense (la "Fed") a mediados de junio. Los precios del petróleo tuvieron un buen comportamiento durante todo el periodo, mientras que los metales preciosos atravesaron dificultades, en ambos casos como consecuencia del sentimiento económico positivo. El dólar estadounidense avanzó en gran medida en consonancia con las rentabilidades de los bonos del Tesoro de EE. UU., aunque experimentó un gran salto tras la reunión de la Fed del mes de junio. Los diferenciales de referencia de mercados emergentes también se mostraron volátiles en este entorno, con una contracción de 352 a 340 pb, tras haber alcanzado un máximo de 372 a comienzos de marzo.

Ecuador fue con diferencia el país que mejor se comportó, con una rentabilidad del 27,51% en el periodo analizado, gracias a que el candidato favorable al mercado Lasso ganó de forma inesperada las elecciones presidenciales. Zambia le siguió de cerca, con una rentabilidad del 21,48% de sus bonos en impago, favorecido por las expectativas de que el país llegue a un acuerdo con el FMI tras las elecciones de agosto. El principal rezagado fue Argentina, puesto que el país todavía tiene que demostrar una combinación de políticas económicas que sea suficiente para estabilizar la dinámica de la deuda, seguido de Bielorrusia, que afrontó sanciones de EE. UU. y de la UE por su mano dura con la oposición política tras las polémicas elecciones del pasado año.

Por lo que respecta a la Cartera, la asignación por países impulsó la rentabilidad relativa superior, mientras que el posicionamiento descendente también favoreció y la selección de valores lastró los resultados. En materia de selección de países, nuestra sobreponderación de Ecuador fue lo que más favoreció, así como una sobreponderación de Costa Rica, que alcanzó un acuerdo de préstamo con el FMI. Nuestra infraponderación de El Salvador perjudicó, dado que los bonos se comportaron bien a comienzos del primer semestre en previsión de un programa del FMI, al igual que nuestra infraponderación de Zambia. Por lo que respecta a la selección de instrumentos, nuestro posicionamiento en deuda corporativa china y en Croacia fue lo que más lastró los resultados.

Las expectativas de crecimiento mundial para el resto de 2021 siguen siendo alentadoras, siendo probable que los ME se beneficien de la incesante recuperación cíclica, tal como reflejan tanto los datos de manufacturas como los precios de las materias primas. Prevemos una continuidad de la recuperación gracias a los constantes estímulos fiscales y al progreso de la vacunación.

Un aumento de los tipos de interés estadounidenses más rápido de lo esperado podría suponer un riesgo de cola para esta clase de activos, aunque nuestra hipótesis central es que los tipos subirán gradualmente en los próximos trimestres, lo cual no creemos que trastoque excesivamente las condiciones de financiación ni los resultados de los diferenciales de ME.

Consideramos que los factores técnicos del mercado son positivos gracias a los sólidos flujos y a los bajos niveles de emisiones netas de los próximos meses. Creemos que, en términos absolutos, las valoraciones de la deuda de ME en monedas fuertes se han situado dentro de una gama de valor razonable y atractiva en comparación con los mercados desarrollados.

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		4.107.519.159	3.812.369.607
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	87.781.800	213.294.329
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		55.736.619	-
Cuentas a percibir por acciones emitidas		43.132.085	21.884.350
Cuentas por cobrar de intermediarios		13.998.881	23.713.792
Ingresos a percibir y otros activos		60.537.324	54.902.299
Activos totales		4.368.705.868	4.126.164.377
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		60.565.320	18.586.064
Descubierto bancario	3	13.932	5.684
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		99.215.042	2.513.341
Gastos devengados		3.183.209	2.957.101
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		26.642.879	2.897
Otras cuentas por pagar		56.559	745.923
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		189.676.941	24.811.010
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		4.179.028.927	4.101.353.367

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		98.622.407	66.439.191
Ingresos por préstamo de valores	15	3.107	359
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(156.417.488)	(203.718.043)
		(57.791.974)	(137.278.493)
Gastos			
Comisión de gestión	5	15.881.252	10.303.119
Comisión de distribución	5	302.463	330.430
Comisión de administración	5	1.496.682	1.355.698
Comisión de compromiso	16	252.448	123.320
Comisión de depósito	5	146.016	105.156
Comisión del Depositario	5	105.214	132.807
Honorarios profesionales	7	167.990	100.716
Honorarios de los Consejeros	6	1.965	2.380
Costes de transacciones	7	168.497	105.943
Honorarios de auditoría	7	15.110	13.748
Reembolso de IVA		(19.447)	(9.180)
Otros gastos	7	13.569	37.696
Gastos totales		18.531.759	12.601.833
Costes financieros			
Gastos por intereses		–	284
Repartos de dividendos abonados	1	24.064.912	17.810.880
		24.064.912	17.811.164
Impuestos retenidos en origen		2.277	3.036
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		(100.390.922)	(167.694.526)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	4.101.353.367	2.504.012.329
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	(100.390.922)	(167.694.526)
Suscripciones	1.461.631.051	1.244.736.718
Reembolsos	(1.283.564.569)	(648.681.512)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	4.179.028.927	2.932.373.009

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

Cartera de inversiones

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Importe principal	Descripción de los valores	Cupón	Fecha de vencimiento	Valor% del Patrimonio razonable USD	neto
Bonos de empresa 32,00% (31 de diciembre de 2020: 30,63%)					
Euro					
8.757.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	2,75%	22/01/2033	10.863.883	0,26
6.921.000	NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance Plc*	7,13%	19/07/2024	8.557.094	0,20
17.229.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	1,88%	05/11/2031	19.995.191	0,48
Total euro				39.416.168	0,94
Dólar estadounidense					
5.200.000	1MDB Energy Ltd**	5,99%	11/05/2022	5.381.653	0,13
34.400.000	1MDB Global Investments Ltd**	4,40%	09/03/2023	34.691.759	0,83
9.752.000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*	3,65%	02/11/2029	10.882.013	0,26
19.827.000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*	4,60%	02/11/2047	23.435.712	0,56
4.527.000	Abu Dhabi Ports Co PJSC*	2,50%	06/05/2031	4.571.624	0,11
7.530.000	Adani Electricity Mumbai Ltd*	3,95%	12/02/2030	7.535.952	0,18
2.177.625	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA*	6,00%	18/11/2048	2.375.539	0,06
2.754.000	African Export-Import Bank*	2,63%	17/05/2026	2.786.606	0,07
3.495.000	African Export-Import Bank*	3,80%	17/05/2031	3.594.118	0,09
3.078.000	African Export-Import Bank*	3,99%	21/09/2029	3.236.354	0,08
1.677.000	AIA Group Ltd*	3,20%	16/09/2040	1.738.206	0,04
2.556.000	Alibaba Group Holding Ltd*	3,25%	09/02/2061	2.482.433	0,06
3.028.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc*	3,75%	01/10/2030	3.136.342	0,08
3.808.000	Banco de Credito e Inversiones SA*	3,50%	12/10/2027	4.093.638	0,10
3.283.000	Banco Nacional de Panama**	2,50%	11/08/2030	3.183.739	0,08
4.318.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santander**	5,38%	17/04/2025	4.904.773	0,12
4.143.000	Bank Leumi Le-Israel BM*	3,28%	29/01/2031	4.246.575	0,10
5.546.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	4,70%	22/10/2031	5.984.579	0,14
12.145.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	5,00%	27/07/2027	13.500.266	0,32
2.363.000	Blossom Joy Ltd*	3,10%	29/12/2049	2.415.190	0,06
752.685	Brazil Loan Trust 1*	5,48%	24/07/2023	783.552	0,02
6.489.000	Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais†	5,33%	15/02/2028	7.045.432	0,17
1.876.000	Cable Onda SA**	4,50%	30/01/2030	1.981.337	0,05
3.254.000	Cemex SAB de CV**	5,13%	29/12/2049	3.362.846	0,08
4.626.000	Cencosud SA*	4,38%	17/07/2027	5.068.754	0,12
2.061.000	Centrais Eletricas Brasileiras SA**	4,63%	04/02/2030	2.133.753	0,05
227.000	China Huadian Overseas Development Management Co Ltd*	4,00%	29/12/2049	238.028	0,01
17.913.000	China Minmetals Corp*	3,75%	29/12/2049	18.298.456	0,44
7.139.000	Chinalco Capital Holdings Ltd*	2,13%	03/06/2026	7.106.812	0,17
600.000	Chinalco Capital Holdings Ltd*	4,00%	25/08/2021	601.473	0,01
7.043.000	Chinalco Capital Holdings Ltd*	4,10%	29/12/2049	7.334.408	0,18

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

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 32,00% (31 de diciembre de 2020: 30,63%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
5.666.000	Chinalco Capital Holdings Ltd*	4,25%	21/04/2022	5.757.680	0,14
6.882.000	Comision Federal de Electricidad*	3,35%	09/02/2031	6.846.248	0,16
3.249.000	Comision Federal de Electricidad*	4,75%	23/02/2027	3.638.263	0,09
6.193.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	3,00%	30/09/2029	6.443.787	0,15
14.049.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	3,15%	14/01/2030	14.773.426	0,36
3.378.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	3,15%	15/01/2051	3.274.268	0,08
2.818.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	3,75%	15/01/2031	3.078.675	0,07
1.973.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	4,38%	05/02/2049	2.312.149	0,06
150.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	6,15%	24/10/2036	205.240	0,00
11.370.000	CSN Inova Ventures**	6,75%	28/01/2028	12.589.433	0,30
12.306.000	CSN Resources SA**	4,63%	10/06/2031	12.587.315	0,30
4.264.000	CSN Resources SA**	7,63%	13/02/2023	4.437.545	0,11
3.865.000	CSN Resources SA**	7,63%	17/04/2026	4.173.002	0,10
8.212.000	Development Bank of Kazakhstan JSC*	2,95%	06/05/2031	8.190.649	0,20
6.693.000	Dianjian Haiyu Ltd*	4,30%	29/12/2049	6.967.580	0,17
4.967.000	Dianjian International Finance Ltd*	4,60%	29/12/2049	5.128.540	0,12
4.664.000	DP World Crescent Ltd*	3,88%	18/07/2029	5.054.633	0,12
3.400.000	DP World Plc*	6,85%	02/07/2037	4.621.056	0,11
5.914.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank*	4,13%	30/06/2028	5.917.075	0,14
6.949.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank*	4,88%	23/05/2024	7.316.880	0,18
5.120.000	Ecopetrol SA*	6,88%	29/04/2030	6.186.291	0,15
8.555.000	Empresa de Transmision Electrica SA*	5,13%	02/05/2049	9.529.543	0,23
1.165.000	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA*	3,65%	07/05/2030	1.258.041	0,03
4.899.000	Empresa Nacional del Petroleo**	3,75%	05/08/2026	5.134.794	0,12
1.925.000	Empresa Nacional del Petroleo*	4,38%	30/10/2024	2.078.682	0,05
1.340.000	Empresa Nacional del Petroleo**	4,50%	14/09/2047	1.325.338	0,03
2.231.000	Empresa Nacional del Petroleo**	4,50%	14/09/2047	2.208.060	0,05
8.430.000	Empresa Nacional del Petroleo*	5,25%	06/11/2029	9.424.386	0,23
5.954.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,16%	31/03/2034	5.860.574	0,14
8.304.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,63%	31/03/2036	8.132.505	0,19
10.446.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,94%	30/09/2040	10.349.779	0,25
10.190.000	Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA*	5,15%	11/02/2026	11.456.428	0,27
12.604.000	Gazprom PJSC via Gaz Finance Plc*	3,25%	25/02/2030	12.528.369	0,30
397.000	Georgian Railway JSC*	4,00%	17/06/2028	400.672	0,01
10.182.000	Grupo Aval Ltd*	4,38%	04/02/2030	10.062.107	0,24
15.134.000	Gtlk Europe Capital DAC*	4,65%	10/03/2027	15.805.202	0,38
7.422.000	Gtlk Europe Capital DAC*	4,95%	18/02/2026	7.900.215	0,19
5.210.000	Hanwha Life Insurance Co Ltd*	4,70%	29/12/2049	5.457.893	0,13

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

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 32,00% (31 de diciembre de 2020: 30,63%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
7.470.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd*	4,00%	29/12/2049	4.659.413	0,11
7.000.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd*	4,50%	29/12/2049	4.744.880	0,11
4.750.000	Huarong Finance II Co Ltd*	5,50%	16/01/2025	3.527.207	0,08
1.685.000	IHS Netherlands Holdco BV**	8,00%	18/09/2027	1.824.049	0,04
2.872.000	Industrias Penoles SAB de CV**	5,65%	12/09/2049	3.449.832	0,08
4.165.000	JBS USA Food Co*	5,75%	15/01/2028	4.474.126	0,11
2.633.000	Kallpa Generacion SA*	4,13%	16/08/2027	2.709.304	0,06
9.034.000	KazMunayGas National Co JSC*	3,50%	14/04/2033	9.359.147	0,22
4.068.000	KazMunayGas National Co JSC*	4,75%	24/04/2025	4.555.862	0,11
38.677.000	KazMunayGas National Co JSC*	5,38%	24/04/2030	46.174.657	1,11
23.247.000	KazMunayGas National Co JSC*	5,75%	19/04/2047	29.101.292	0,70
10.434.000	KazMunayGas National Co JSC*	6,38%	24/10/2048	13.839.397	0,33
1.323.000	Leader Goal International Ltd*	4,25%	29/12/2049	1.354.471	0,03
6.221.887	Leviathan Bond Ltd*	6,75%	30/06/2030	7.007.328	0,17
8.134.000	Liquid Telecommunications Financing Plc*	8,50%	13/07/2022	8.193.596	0,20
8.883.000	MDGH - GMTN BV*	3,70%	07/11/2049	9.744.296	0,23
4.476.000	MDGH - GMTN BV*	3,95%	21/05/2050	5.101.617	0,12
1.837.000	MDGH - GMTN BV*	4,50%	07/11/2028	2.137.191	0,05
2.367.000	MDGH GMTN RSC Ltd*	2,50%	03/06/2031	2.399.546	0,06
5.728.000	Medco Bell Pte Ltd*	6,38%	30/01/2027	5.916.108	0,14
2.915.000	MEGlobal Canada ULC*	5,00%	18/05/2025	3.276.139	0,08
2.182.000	MEGlobal Canada ULC*	5,88%	18/05/2030	2.697.786	0,06
2.334.000	Meituan*	3,05%	28/10/2030	2.311.749	0,06
3.734.000	Mexico City Airport Trust*	5,50%	31/07/2047	3.790.197	0,09
20.083.000	Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd*	3,38%	29/12/2049	20.585.075	0,49
4.496.000	NBK Tier 1 Financing 2 Ltd*	4,50%	29/12/2049	4.692.556	0,11
11.154.000	Nexa Resources SA**	5,38%	04/05/2027	12.009.846	0,29
6.754.000	NWD MTN Ltd*	4,13%	18/07/2029	7.032.405	0,17
2.457.000	OCP SA*	3,75%	23/06/2031	2.487.098	0,06
15.930.000	Oil & Gas Holding Co BSCC**	7,50%	25/10/2027	17.851.954	0,43
1.382.000	Oil & Gas Holding Co BSCC*	7,63%	07/11/2024	1.545.081	0,04
3.900.000	Oil & Gas Holding Co BSCC*	8,38%	07/11/2028	4.558.427	0,11
6.343.000	Ooredoo International Finance Ltd*	2,63%	08/04/2031	6.434.162	0,15
4.880.000	OQ SAOC*	5,13%	06/05/2028	4.917.488	0,12
3.055.000	Oryx Funding Ltd*	5,80%	03/02/2031	3.222.744	0,08
6.880.000	Pertamina Persero PT*	6,45%	30/05/2044	8.980.689	0,21
2.675.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	4,38%	05/02/2050	2.745.379	0,07
1.653.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	5,25%	15/05/2047	1.864.485	0,04

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

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 32,00% (31 de diciembre de 2020: 30,63%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
1.099.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	5,45%	21/05/2028	1.283.769	0,03
6.572.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	6,15%	21/05/2048	8.321.204	0,20
8.098.000	Petrobras Global Finance BV*	5,50%	10/06/2051	8.110.957	0,19
11.455.000	Petroleos de Venezuela SA*	5,38%	12/04/2027	515.475	0,01
730.000	Petroleos de Venezuela SA*	5,50%	12/04/2037	32.850	0,00
38.698.964	Petroleos de Venezuela SA*	6,00%	16/05/2024	1.741.453	0,04
26.169.079	Petroleos de Venezuela SA**	6,00%	15/11/2026	1.177.609	0,03
5.618.000	Petroleos del Peru SA*	4,75%	19/06/2032	5.905.923	0,14
23.073.000	Petroleos del Peru SA*	5,63%	19/06/2047	24.624.659	0,59
19.638.000	Petroleos Mexicanos**	5,35%	12/02/2028	19.337.539	0,46
47.428.000	Petroleos Mexicanos*	5,95%	28/01/2031	46.135.587	1,10
5.538.000	Petroleos Mexicanos*	6,35%	12/02/2048	4.727.154	0,11
300.000	Petroleos Mexicanos*	6,50%	13/03/2027	317.025	0,01
11.077.000	Petroleos Mexicanos*	6,50%	23/01/2029	11.414.848	0,27
7.161.000	Petroleos Mexicanos*	6,75%	21/09/2047	6.346.508	0,15
4.139.000	Petroleos Mexicanos**	6,84%	23/01/2030	4.270.413	0,10
4.941.000	Petroleos Mexicanos*	6,88%	16/10/2025	5.475.863	0,13
900.000	Petroleos Mexicanos**	6,88%	04/08/2026	984.735	0,02
6.945.000	Petroleos Mexicanos*	6,95%	28/01/2060	6.154.659	0,15
28.530.000	Petroleos Mexicanos*	7,69%	23/01/2050	27.495.787	0,66
4.206.000	Power Finance Corp Ltd*	3,95%	23/04/2030	4.343.050	0,10
4.898.000	Powerchina Roadbridge Group British Virgin Islands Ltd*	3,08%	29/12/2049	4.900.204	0,12
5.480.000	Qatar Petroleum Development Co*	3,13%	12/07/2041	5.459.779	0,13
4.596.000	Qatar Petroleum Development Co*	3,30%	12/07/2051	4.596.000	0,11
3.568.000	QNB Finance Ltd*	2,63%	12/05/2025	3.739.171	0,09
10.247.000	QNB Finance Ltd*	2,75%	12/02/2027	10.715.888	0,26
4.272.000	QNB Finansbank AS*	6,88%	07/09/2024	4.638.324	0,11
2.560.000	Rusal Capital DAC*	5,13%	02/02/2022	2.593.843	0,06
5.924.000	Samba Funding Ltd*	2,75%	02/10/2024	6.182.137	0,15
6.305.000	Sasol Financing USA LLC*	4,38%	18/09/2026	6.533.588	0,16
7.850.000	Sasol Financing USA LLC*	5,88%	27/03/2024	8.403.543	0,20
11.610.000	Sasol Financing USA LLC*	6,50%	27/09/2028	13.101.421	0,31
40.064.000	Saudi Arabian Oil Co*	4,25%	16/04/2039	44.943.355	1,08
2.962.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 4*	4,72%	27/09/2028	3.483.558	0,08
5.521.000	Sharjah Sukuk Program Ltd*	2,94%	10/06/2027	5.694.358	0,14
16.352.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*	2,30%	08/01/2031	16.322.460	0,39
13.324.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*	2,70%	13/05/2030	13.758.544	0,33
2.645.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*	3,35%	13/05/2050	2.663.239	0,06

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

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 32,00% (31 de diciembre de 2020: 30,63%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
75.092.000	Southern Gas Corridor CJSC*	6,88%	24/03/2026	89.960.967	2,15
6.462.000	State Agency of Roads of Ukraine*	6,25%	24/06/2028	6.473.922	0,16
18.147.000	State Oil Co of the Azerbaijan Republic*	4,75%	13/03/2023	19.211.878	0,46
28.891.000	State Oil Co of the Azerbaijan Republic*	6,95%	18/03/2030	36.479.134	0,87
3.439.000	Suzano Austria GmbH*	5,00%	15/01/2030	3.900.686	0,09
3.166.000	Suzano Austria GmbH*	6,00%	15/01/2029	3.775.613	0,09
5.696.000	Suzano Austria GmbH**	7,00%	16/03/2047	7.710.191	0,18
1.634.000	TC Ziraat Bankasi AS*	5,13%	03/05/2022	1.663.595	0,04
6.803.000	Tencent Holdings Ltd*	3,24%	03/06/2050	6.678.333	0,16
778.000	Tencent Holdings Ltd**	3,29%	03/06/2060	761.497	0,02
1.900.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd**	2,63%	15/08/2025	1.948.558	0,05
5.985.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd**	3,25%	15/08/2030	6.091.264	0,15
3.905.000	Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS*	6,95%	14/03/2026	4.333.037	0,10
4.752.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*	6,50%	08/01/2026	4.857.203	0,12
416.667	Ukreximbank Via Biz Finance Plc*	9,63%	27/04/2022	429.217	0,01
114.000	Ukreximbank Via Biz Finance Plc*	9,75%	22/01/2025	122.892	0,00
4.472.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	13,88%	21/01/2024	4.909.786	0,12
6.350.000	Vedanta Resources Ltd*	6,38%	30/07/2022	6.279.420	0,15
4.050.000	Vedanta Resources Ltd*	7,13%	31/05/2023	3.758.441	0,09
8.047.000	VEON Holdings BV*	3,38%	25/11/2027	8.118.618	0,19
450.000	Vnesheconombank Via VEB Finance Plc*	6,80%	22/11/2025	532.125	0,01
3.572.000	Votorantim Cimentos International SA**	7,25%	05/04/2041	4.858.920	0,12
724.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS*	5,85%	21/06/2024	743.326	0,02
Total dólar estadounidense				1.297.865.926	31,06
Total bonos de empresa				1.337.282.094	32,00
Bonos del Estado 65,23% (31 de diciembre de 2020: 60,76%)					
Euro					
6.760.000	Banque Centrale de Tunisie International Bond*	5,63%	17/02/2024	7.472.357	0,18
9.031.000	Banque Centrale de Tunisie International Bond*	6,38%	15/07/2026	9.859.935	0,24
1.825.000	Benin Government International Bond*	4,88%	19/01/2032	2.164.599	0,05
1.367.000	Benin Government International Bond*	6,88%	19/01/2052	1.680.496	0,04
8.222.000	Croatia Government International Bond*	1,13%	19/06/2029	10.015.003	0,24
8.050.000	Croatia Government International Bond*	1,13%	04/03/2033	9.473.075	0,23
10.306.000	Croatia Government International Bond*	1,50%	17/06/2031	12.720.142	0,30
21.267.000	Croatia Government International Bond**	2,75%	27/01/2030	29.098.848	0,70
1.757.000	Egypt Government International Bond*	4,75%	11/04/2025	2.173.186	0,05

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

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 del Estado 65,23% (31 de diciembre de 2020: 60,76%) (cont.)					
Euro (cont.)					
4.170.000	Egypt Government International Bond*	4,75%	16/04/2026	5.152.840	0,12
10.344.000	Egypt Government International Bond*	5,63%	16/04/2030	12.315.185	0,29
24.283.000	Egypt Government International Bond*	6,38%	11/04/2031	29.950.305	0,72
3.722.000	Hungary Government International Bond*	1,50%	17/11/2050	4.098.661	0,10
1.211.000	Hungary Government International Bond*	1,75%	05/06/2035	1.519.884	0,04
8.417.000	Indonesia Government International Bond*	1,10%	12/03/2033	9.740.759	0,23
18.989.000	Indonesia Government International Bond*	1,40%	30/10/2031	22.895.935	0,55
4.779.000	Indonesia Government International Bond*	3,75%	14/06/2028	6.722.255	0,16
20.869.000	Ivory Coast Government International Bond*	4,88%	30/01/2032	24.708.092	0,59
3.530.000	Ivory Coast Government International Bond*	5,25%	22/03/2030	4.368.099	0,10
25.871.000	Ivory Coast Government International Bond*	5,88%	17/10/2031	32.960.171	0,79
20.258.000	Ivory Coast Government International Bond*	6,63%	22/03/2048	25.127.011	0,60
38.650.000	Ivory Coast Government International Bond*	6,88%	17/10/2040	49.974.052	1,20
5.368.000	Kazakhstan Government International Bond*	2,38%	09/11/2028	7.110.124	0,17
5.341.000	North Macedonia Government International Bond*	1,63%	10/03/2028	6.263.263	0,15
30.688.000	Peruvian Government International Bond*	1,25%	11/03/2033	35.361.604	0,85
16.240.000	Peruvian Government International Bond*	3,75%	01/03/2030	23.175.529	0,55
6.893.000	Philippine Government International Bond*	1,75%	28/04/2041	8.078.515	0,19
2.530.000	Provincia de Buenos Aires*	5,38%	20/01/2023	1.192.630	0,03
9.677.000	Republic of Cameroon International Bond*	5,95%	07/07/2032	11.475.954	0,27
3.132.000	Romanian Government International Bond*	2,00%	28/01/2032	3.749.991	0,09
7.236.000	Romanian Government International Bond*	2,00%	14/04/2033	8.506.815	0,20
869.000	Romanian Government International Bond*	2,12%	16/07/2031	1.061.828	0,03
6.109.000	Romanian Government International Bond*	2,63%	02/12/2040	7.173.076	0,17
31.250.000	Romanian Government International Bond*	3,38%	28/01/2050	39.433.217	0,94
2.868.000	Romanian Government International Bond*	3,62%	26/05/2030	3.928.923	0,09
20.140.000	Romanian Government International Bond*	3,88%	29/10/2035	28.018.717	0,67
16.891.000	Romanian Government International Bond*	4,63%	03/04/2049	25.319.612	0,61
10.040.000	Senegal Government International Bond*	4,75%	13/03/2028	12.398.231	0,30
4.783.000	Senegal Government International Bond*	5,38%	08/06/2037	5.601.541	0,13
27.611.000	Serbia International Bond*	1,50%	26/06/2029	32.977.058	0,79
4.899.000	Serbia International Bond*	1,65%	03/03/2033	5.680.409	0,14
2.833.000	Serbia International Bond*	3,13%	15/05/2027	3.735.118	0,09
3.600.000	Ukraine Government International Bond*	4,38%	27/01/2030	3.981.795	0,10
8.748.000	Ukraine Government International Bond**	6,75%	20/06/2026	11.312.790	0,27
Total euro				599.727.630	14,35

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

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 del Estado 65,23% (31 de diciembre de 2020: 60,76%) (cont.)					
Dólar estadounidense					
9.724.000	Abu Dhabi Government International Bond*	2,70%	02/09/2070	8.767.354	0,21
4.861.000	Abu Dhabi Government International Bond*	3,88%	16/04/2050	5.569.160	0,13
13.371.000	Angolan Government International Bond*	8,00%	26/11/2029	13.694.307	0,33
26.493.000	Angolan Government International Bond*	8,25%	09/05/2028	27.614.142	0,66
11.984.000	Angolan Government International Bond*	9,13%	26/11/2049	12.231.986	0,29
32.513.000	Angolan Government International Bond*	9,38%	08/05/2048	33.862.355	0,81
3.560.000	Angolan Government International Bond*	9,50%	12/11/2025	3.890.169	0,09
111.155.784	Argentine Republic Government International Bond*	0,13%	09/07/2030	40.095.003	0,96
40.653.704	Argentine Republic Government International Bond*	0,13%	09/07/2035	12.968.938	0,31
67.604.545	Argentine Republic Government International Bond*	0,13%	09/01/2038	25.644.432	0,61
73.887.149	Argentine Republic Government International Bond*	0,13%	09/07/2041	26.488.543	0,63
23.443.526	Argentine Republic Government International Bond*	1,00%	09/07/2029	8.936.203	0,21
860.000	Belize Government International Bond*	4,94%	20/02/2034	360.125	0,01
2.674.000	Bermuda Government International Bond*	2,38%	20/08/2030	2.680.685	0,06
5.009.000	Bermuda Government International Bond*	3,72%	25/01/2027	5.497.378	0,13
23.368.000	Bermuda Government International Bond*	4,75%	15/02/2029	27.269.288	0,65
3.721.000	Bermuda Government International Bond*	4,85%	06/02/2024	4.111.352	0,10
12.410.000	Brazilian Government International Bond*	3,88%	12/06/2030	12.535.961	0,30
6.270.000	Brazilian Government International Bond*	5,00%	27/01/2045	6.362.639	0,15
31.591.000	Brazilian Government International Bond*	5,63%	07/01/2041	34.454.092	0,82
2.320.000	Brazilian Government International Bond*	8,25%	20/01/2034	3.208.282	0,08
34.398.000	Colombia Government International Bond*	3,00%	30/01/2030	33.762.153	0,81
2.155.000	Colombia Government International Bond*	4,50%	15/03/2029	2.356.406	0,06
42.908.000	Colombia Government International Bond*	5,00%	15/06/2045	45.737.783	1,09
18.370.000	Colombia Government International Bond*	5,20%	15/05/2049	20.166.219	0,48
4.330.000	Colombia Government International Bond*	6,13%	18/01/2041	5.141.052	0,12
2.043.000	Corp Financiera de Desarrollo SA*	2,40%	28/09/2027	2.011.997	0,05
240.000	Costa Rica Government International Bond*	5,63%	30/04/2043	222.936	0,01
25.543.000	Costa Rica Government International Bond*	6,13%	19/02/2031	27.158.850	0,65
9.669.000	Costa Rica Government International Bond*	7,00%	04/04/2044	10.031.684	0,24
45.318.000	Costa Rica Government International Bond*	7,16%	12/03/2045	47.471.058	1,14
5.035.000	Croatia Government International Bond*	6,00%	26/01/2024	5.707.056	0,14
7.316.000	Development Bank of Mongolia LLC*	7,25%	23/10/2023	7.893.970	0,19
7.152.000	Dominican Republic International Bond*	5,30%	21/01/2041	7.152.072	0,17
1.600.000	Dominican Republic International Bond*	5,50%	27/01/2025	1.760.640	0,04
32.308.000	Dominican Republic International Bond*	5,88%	30/01/2060	32.336.257	0,77
19.188.000	Dominican Republic International Bond*	6,00%	19/07/2028	21.855.132	0,52
553.000	Dominican Republic International Bond*	6,40%	05/06/2049	597.351	0,01

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

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 del Estado 65,23% (31 de diciembre de 2020: 60,76%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
33.355.000	Dominican Republic International Bond*	6,85%	27/01/2045	37.816.231	0,91
2.000.000	Dominican Republic International Bond*	6,88%	29/01/2026	2.322.200	0,06
5.863.231	Ecuador Government International Bond*	0,00%	31/07/2030	3.261.422	0,08
21.392.375	Ecuador Government International Bond*	0,50%	31/07/2030	18.344.175	0,44
66.456.921	Ecuador Government International Bond*	0,50%	31/07/2035	45.855.275	1,10
27.011.577	Ecuador Government International Bond*	0,50%	31/07/2040	16.848.471	0,40
1.631.000	Egypt Government International Bond*	7,05%	15/01/2032	1.668.334	0,04
9.916.000	Egypt Government International Bond*	7,50%	16/02/2061	9.325.502	0,22
18.557.000	Egypt Government International Bond*	7,63%	29/05/2032	19.647.339	0,47
13.331.000	Egypt Government International Bond*	7,90%	21/02/2048	13.236.083	0,32
5.408.000	Egypt Government International Bond*	8,15%	20/11/2059	5.425.116	0,13
34.950.000	Egypt Government International Bond*	8,50%	31/01/2047	36.518.381	0,87
10.483.000	Egypt Government International Bond*	8,70%	01/03/2049	11.102.021	0,27
7.044.000	Egypt Government International Bond*	8,88%	29/05/2050	7.611.613	0,18
6.658.000	El Salvador Government International Bond*	7,12%	20/01/2050	5.692.590	0,13
1.040.000	El Salvador Government International Bond*	7,63%	01/02/2041	925.610	0,02
2.500.000	El Salvador Government International Bond*	7,65%	15/06/2035	2.294.000	0,06
3.488.000	El Salvador Government International Bond*	7,75%	24/01/2023	3.462.538	0,08
753.000	El Salvador Government International Bond*	8,63%	28/02/2029	737.940	0,02
26.643.000	El Salvador Government International Bond*	9,50%	15/07/2052	26.309.963	0,63
4.130.000	Emirate of Dubai Government International Bonds*	5,25%	30/01/2043	4.672.017	0,11
24.382.000	Ghana Government International Bond*	7,63%	16/05/2029	24.624.390	0,59
15.358.000	Ghana Government International Bond*	7,75%	07/04/2029	15.681.964	0,38
17.514.000	Ghana Government International Bond*	7,88%	11/02/2035	17.222.035	0,41
11.138.000	Ghana Government International Bond*	8,63%	07/04/2034	11.485.699	0,28
5.375.000	Ghana Government International Bond*	8,75%	11/03/2061	5.181.769	0,12
9.457.000	Ghana Government International Bond*	8,88%	07/05/2042	9.533.858	0,23
8.151.000	Ghana Government International Bond*	8,95%	26/03/2051	8.082.206	0,19
30.821.000	Ghana Government International Bond*	10,75%	14/10/2030	38.901.151	0,93
3.260.000	Honduras Government International Bond*	5,63%	24/06/2030	3.427.890	0,08
1.247.000	Honduras Government International Bond*	6,25%	19/01/2027	1.367.336	0,03
500.000	Indonesia Government International Bond*	4,35%	11/01/2048	569.013	0,01
1.650.000	Indonesia Government International Bond*	4,75%	18/07/2047	1.970.720	0,05
5.600.000	Indonesia Government International Bond*	5,13%	15/01/2045	6.946.741	0,17
42.877.000	Indonesia Government International Bond*	5,25%	17/01/2042	53.552.540	1,28
400.000	Indonesia Government International Bond*	7,75%	17/01/2038	606.117	0,01
8.770.000	Indonesia Government International Bond*	8,50%	12/10/2035	14.057.793	0,34
18.936.750	Iraq International Bond*	5,80%	15/01/2028	18.380.104	0,44

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

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 del Estado 65,23% (31 de diciembre de 2020: 60,76%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
1.458.000	Israel Government International Bond*	3,88%	03/07/2050	1.690.765	0,04
9.487.899	Ivory Coast Government International Bond*	5,75%	31/12/2032	9.537.142	0,23
5.980.000	Kenya Government International Bond*	6,30%	23/01/2034	5.958.160	0,14
372.000	Korea Housing Finance Corp*	3,00%	31/10/2022	383.925	0,01
21.038.000	Lebanon Government International Bond*	6,60%	27/11/2026	2.616.538	0,06
1.752.000	Lebanon Government International Bond*	6,65%	26/02/2030	220.570	0,01
6.112.000	Lebanon Government International Bond*	6,85%	25/05/2029	769.929	0,02
43.727.000	Lebanon Government International Bond*	8,25%	17/05/2034	5.469.373	0,13
7.365.000	Mexico Government International Bond*	2,66%	24/05/2031	7.213.207	0,17
4.815.000	Mexico Government International Bond*	3,77%	24/05/2061	4.490.589	0,11
5.609.000	Mexico Government International Bond*	5,00%	27/04/2051	6.383.042	0,15
53.214.000	Mexico Government International Bond*	5,75%	12/10/2110	63.786.025	1,53
5.169.000	Mongolia Government International Bond*	3,50%	07/07/2027	5.093.813	0,12
8.042.000	Mongolia Government International Bond*	5,13%	07/04/2026	8.605.962	0,21
8.777.000	Mongolia Government International Bond*	5,63%	01/05/2023	9.292.649	0,22
26.783.000	Mongolia Government International Bond*	8,75%	09/03/2024	30.894.677	0,74
5.327.000	Morocco Government International Bond*	3,00%	15/12/2032	5.130.834	0,12
5.927.000	Nigeria Government International Bond*	6,50%	28/11/2027	6.279.560	0,15
2.128.000	Nigeria Government International Bond*	7,63%	21/11/2025	2.400.052	0,06
2.059.000	Nigeria Government International Bond*	7,70%	23/02/2038	2.115.787	0,05
26.691.000	Nigeria Government International Bond*	7,88%	16/02/2032	28.696.561	0,69
4.165.000	Nigeria Government International Bond*	8,75%	21/01/2031	4.719.169	0,11
6.077.000	Nigeria Government International Bond*	9,25%	21/01/2049	6.943.671	0,17
3.971.000	Oman Government International Bond*	6,25%	25/01/2031	4.257.701	0,10
49.137.000	Oman Government International Bond*	6,75%	17/01/2048	49.029.636	1,17
2.960.000	Oman Government International Bond*	7,00%	25/01/2051	3.001.873	0,07
7.786.000	Oman Government International Bond*	7,38%	28/10/2032	8.868.787	0,21
4.329.000	Oman Sovereign Sukuk Co*	4,88%	15/06/2030	4.435.593	0,11
9.900.000	Panama Government International Bond*	6,70%	26/01/2036	13.471.870	0,32
5.300.000	Panama Government International Bond*	8,88%	30/09/2027	7.324.123	0,18
8.644.000	Papua New Guinea Government International Bond*	8,38%	04/10/2028	8.662.152	0,21
308.000	Paraguay Government International Bond*	4,70%	27/03/2027	350.661	0,01
33.991.000	Paraguay Government International Bond*	4,95%	28/04/2031	39.190.571	0,93
4.406.000	Paraguay Government International Bond*	5,00%	15/04/2026	5.029.449	0,12
5.175.000	Paraguay Government International Bond*	5,40%	30/03/2050	6.058.631	0,15
4.778.000	Paraguay Government International Bond*	5,60%	13/03/2048	5.632.067	0,14
6.340.000	Paraguay Government International Bond*	6,10%	11/08/2044	7.906.043	0,19
13.000.000	Peruvian Government International Bond*	8,75%	21/11/2033	20.441.330	0,49

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

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 del Estado 65,23% (31 de diciembre de 2020: 60,76%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
647.997	Provincia de Cordoba*	5,00%	10/12/2025	503.299	0,01
4.000.000	Provincia de Mendoza Argentina*	2,75%	19/03/2029	2.630.000	0,06
9.071.000	Qatar Government International Bond*	3,75%	16/04/2030	10.249.267	0,25
5.600.000	Qatar Government International Bond*	4,40%	16/04/2050	6.787.445	0,16
41.187.000	Qatar Government International Bond*	4,82%	14/03/2049	53.133.125	1,27
3.737.000	Qatar Government International Bond*	5,10%	23/04/2048	4.970.128	0,12
7.546.000	Republic of Armenia International Bond*	3,60%	02/02/2031	7.114.330	0,17
2.840.000	Republic of Azerbaijan International Bond*	4,75%	18/03/2024	3.078.237	0,07
800.000	Republic of Azerbaijan International Bond*	5,13%	01/09/2029	895.981	0,02
3.850.000	Republic of Cameroon International Bond*	9,50%	19/11/2025	4.527.372	0,11
3.410.000	Republic of South Africa Government International Bond*	4,85%	27/09/2027	3.670.012	0,09
3.956.000	Republic of South Africa Government International Bond*	5,65%	27/09/2047	4.043.625	0,10
43.282.000	Republic of South Africa Government International Bond*	5,75%	30/09/2049	44.378.549	1,06
1.946.000	Republic of South Africa Government International Bond*	6,30%	22/06/2048	2.131.045	0,05
11.101.000	Republic of Uzbekistan Bond*	4,75%	20/02/2024	11.816.527	0,28
14.061.000	Republic of Uzbekistan Bond*	5,38%	20/02/2029	15.717.840	0,38
9.000.000	Russian Foreign Bond - Eurobond*	4,38%	21/03/2029	10.126.093	0,24
21.400.000	Russian Foreign Bond - Eurobond*	5,10%	28/03/2035	25.493.820	0,61
2.553.713	Russian Foreign Bond - Eurobond*	7,50%	31/03/2030	2.940.284	0,07
5.330.000	Senegal Government International Bond*	6,75%	13/03/2048	5.397.425	0,13
14.213.000	Serbia International Bond*	2,13%	01/12/2030	13.445.313	0,32
8.468.000	Serbia International Bond*	7,25%	28/09/2021	8.607.781	0,21
11.443.000	Sri Lanka Government International Bond*	5,75%	18/04/2023	8.610.858	0,21
2.503.000	Sri Lanka Government International Bond*	5,88%	25/07/2022	2.127.550	0,05
6.070.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,13%	03/06/2025	4.076.066	0,10
23.820.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,20%	11/05/2027	14.827.950	0,36
19.419.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,75%	18/04/2028	12.233.970	0,29
18.234.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,85%	14/03/2024	12.718.215	0,30
16.064.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,85%	03/11/2025	10.803.040	0,26
21.170.000	Sri Lanka Government International Bond*	7,55%	28/03/2030	13.548.800	0,32
43.537.000	Sri Lanka Government International Bond*	7,85%	14/03/2029	27.863.680	0,67
2.940.000	Turkey Government International Bond*	4,25%	14/04/2026	2.831.984	0,07
7.153.000	Turkey Government International Bond*	4,75%	26/01/2026	7.049.568	0,17
6.960.000	Turkey Government International Bond*	4,88%	09/10/2026	6.829.764	0,16
1.532.000	Turkey Government International Bond*	5,13%	17/02/2028	1.491.813	0,04
8.607.000	Turkey Government International Bond*	5,60%	14/11/2024	8.864.909	0,21
11.399.000	Turkey Government International Bond*	5,88%	26/06/2031	11.102.626	0,27
6.861.000	Turkey Government International Bond*	5,95%	15/01/2031	6.742.264	0,16

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

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 del Estado 65,23% (31 de diciembre de 2020: 60,76%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
23.604.000	Turkey Government International Bond*	6,00%	14/01/2041	21.431.960	0,51
10.240.000	Turkey Government International Bond*	6,38%	14/10/2025	10.744.095	0,26
14.989.000	Turkey Government International Bond*	7,25%	23/12/2023	16.198.606	0,39
5.780.000	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*	5,00%	23/09/2021	5.809.082	0,14
4.811.000	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*	5,38%	24/10/2023	4.940.896	0,12
2.278.000	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*	6,13%	03/05/2024	2.352.528	0,06
2.414.000	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*	8,25%	24/01/2024	2.618.999	0,06
14.935.000	Ukraine Government International Bond*	1,26%	31/05/2040	17.697.975	0,42
5.161.000	Ukraine Government International Bond*	6,88%	21/05/2029	5.351.375	0,13
6.233.000	Ukraine Government International Bond*	7,25%	15/03/2033	6.477.574	0,16
49.531.000	Ukraine Government International Bond*	7,38%	25/09/2032	52.002.093	1,24
6.889.000	Ukraine Government International Bond*	7,75%	01/09/2025	7.562.193	0,18
7.910.000	Ukraine Government International Bond*	7,75%	01/09/2026	8.752.803	0,21
20.774.000	Ukraine Government International Bond*	7,75%	01/09/2027	22.916.423	0,55
28.540.000	Ukraine Government International Bond*	9,75%	01/11/2028	33.970.508	0,81
8.325.000	Uruguay Government International Bond*	5,10%	18/06/2050	10.935.601	0,27
32.118.500	Venezuela Government International Bond*	8,25%	13/10/2024	3.388.502	0,08
7.989.000	Zambia Government International Bond*	8,97%	30/07/2027	5.008.560	0,12
Total dólar estadounidense				2.126.165.972	50,88
Total bonos del Estado				2.725.893.602	65,23

Número de acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Fondos de inversión 0,39% (31 de diciembre de 2020: 0,40%)			
Dólar estadounidense			
150.000	Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	16.606.500	0,39
Total fondos de inversión ^H		16.606.500	0,39
Total inversiones		4.079.782.196	97,62

Contratos de divisas a plazo 0,45% (31 de diciembre de 2020: 0,55%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
396.557.565 USD	329.171.979 €	04/08/2021	Goldman Sachs International	1	5.920.388	0,14
297.957.034 USD	243.650.365 €	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	8.987.592	0,22

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,45% (31 de diciembre de 2020: 0,55%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases AUD con cobertura						
7.968 AUD	5.964 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	19	0,00
247.155 USD	318.089 AUD	19/07/2021	UBS AG	1	8.330	0,00
161.325 USD	209.353 AUD	15/09/2021	UBS AG	1	4.103	0,00
30.822.933 USD	39.764.811 AUD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	38	966.961	0,02
98.711 USD	128.894 AUD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	10	1.912	0,00
Clases CHF con cobertura						
1.384 CHF	1.496 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	2	0,00
7.598 CHF	8.235 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	1	0,00
538.115 USD	486.853 CHF	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	11.174	0,00
522.155 USD	474.071 CHF	19/07/2021	UBS AG	1	9.048	0,00
441.389 USD	397.797 CHF	19/07/2021	Westpac Banking Corp	33	10.839	0,00
708.422 USD	648.162 CHF	15/09/2021	Westpac Banking Corp	10	5.778	0,00
Clases EUR con cobertura						
293.401 €	348.439 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	2	55	0,00
7.304.462 USD	6.031.985 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	148.556	0,01
9.908.946 USD	8.288.267 €	15/09/2021	UBS AG	1	64.347	0,00
89.416.671 USD	73.480.659 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	48	2.244.591	0,06
2.202.651 USD	1.825.087 €	15/09/2021	Westpac Banking Corp	12	34.858	0,00
Clases GBP con cobertura						
2.188.859 £	3.011.945 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	8	12.006	0,00
1.375.545 USD	986.570 £	19/07/2021	UBS AG	1	12.580	0,00
7.870.838 USD	5.637.447 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	25	82.600	0,00
1.700.790 USD	1.218.246 £	15/09/2021	Westpac Banking Corp	10	17.558	0,00
Clases HKD con cobertura						
18.166 HKD	2.339 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	1	0,00
15.395 HKD	1.982 USD	19/07/2021	UBS AG	1	0	0,00
1.470 HKD	189 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
1.876 USD	14.558 HKD	19/07/2021	UBS AG	1	1	0,00
1.620 USD	12.577 HKD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
Clases JPY con cobertura						
98.118 USD	10.672.580 ¥	19/07/2021	UBS AG	1	1.946	0,00
131.999 USD	14.637.748 ¥	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	29	0,00
Clases SEK con cobertura						
43.753 SEK	5.092 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	25	0,00
10 SEK	1 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
546.091 USD	4.566.303 SEK	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	12.066	0,00
96.097 USD	803.458 SEK	19/07/2021	Westpac Banking Corp	27	2.133	0,00

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,45% (31 de diciembre de 2020: 0,55%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases SEK con cobertura (cont.)						
48.195 USD	405.914 SEK	15/09/2021	Westpac Banking Corp	8	698	0,00
Clases SGD con cobertura						
319.782 SGD	237.728 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	8	123	0,00
100.881 USD	133.798 SGD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	1.348	0,00
523.647 USD	696.470 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	43	5.539	0,00
381.670 USD	508.551 SGD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	7	3.412	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					18.570.619	0,45

Contratos de futuros 0,22% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(88)	Euro-Schatz Future September 2021	1.043	0,00
1.326	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2021	63.988	0,00
130	US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2021	602.266	0,02
1.022	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2021	8.499.047	0,20
Plusvalía latente total sobre contratos de futuros [*]		9.166.344	0,22

Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
	4.107.519.159	98,29

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (1,32%) (31 de diciembre de 2020: (0,33%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
34.107.302 €	41.737.361 USD	04/08/2021	Deutsche Bank AG	1	(1.261.315)	(0,03)
Clases AUD con cobertura						
60.161.670 AUD	46.709.520 USD	15/09/2021	UBS AG	1	(1.528.550)	(0,04)
391.137 AUD	300.194 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	16	(6.453)	(0,00)
17.225.840 AUD	13.285.685 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	46	(352.282)	(0,01)
15 USD	20 AUD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	(0)	(0,00)
Clases CHF con cobertura						
2.076.958 CHF	2.282.031 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	4	(34.054)	(0,00)
614.500 CHF	688.234 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(22.083)	(0,00)
982.595 CHF	1.080.607 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(17.103)	(0,00)
70.521.512 CHF	78.940.076 USD	15/09/2021	UBS AG	2	(2.490.927)	(0,06)
13.626.900 CHF	15.095.560 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	50	(346.601)	(0,01)

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (1,32%) (31 de diciembre de 2020: (0,33%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases CHF con cobertura (cont.)						
985.868 CHF	1.076.221 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	17	(7.486)	(0,00)
31.107 USD	28.785 CHF	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(49)	(0,00)
Clases EUR con cobertura						
14.011.654 €	16.819.974 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(197.573)	(0,01)
6.187.991 €	7.547.443 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(197.500)	(0,00)
14.838.476 €	18.117.788 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(514.505)	(0,01)
1.173.111.228 €	1.428.875.285 USD	15/09/2021	UBS AG	2	(35.482.608)	(0,85)
91.426.828 €	111.041.784 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	43	(2.579.680)	(0,06)
10.318.695 €	12.341.788 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	14	(85.495)	(0,00)
778.492 USD	655.493 €	15/09/2021	Westpac Banking Corp	2	(86)	(0,00)
Clases GBP con cobertura						
2.047.029 £	2.862.038 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(34.029)	(0,00)
787.550 £	1.093.883 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(5.867)	(0,00)
153.157.508 £	216.903.499 USD	15/09/2021	UBS AG	3	(5.288.076)	(0,13)
11.697.559 £	16.470.912 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	49	(310.510)	(0,01)
4.633.870 £	6.492.268 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	19	(89.720)	(0,00)
337.256 USD	244.852 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	7	(1.011)	(0,00)
38.435 USD	27.836 £	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	(26)	(0,00)
Clases HKD con cobertura						
12.813 HKD	1.651 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(1)	(0,00)
14.159 HKD	1.823 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(0)	(0,00)
16.093 HKD	2.075 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(2)	(0,00)
14.866 HKD	1.916 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(1)	(0,00)
2.751.985 HKD	354.722 USD	15/09/2021	UBS AG	2	(298)	(0,00)
13.334 HKD	1.717 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	(0)	(0,00)
2.113 USD	16.414 HKD	19/07/2021	UBS AG	1	(1)	(0,00)
48.711 USD	378.320 HKD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(7)	(0,00)
Clases JPY con cobertura						
44.779.828 ¥	411.046 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	(7.531)	(0,00)
2.066.751.972 ¥	18.885.957 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	3	(252.632)	(0,01)
14.773.316 ¥	135.470 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(2.346)	(0,00)
36.430.986 ¥	335.454 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	(7.171)	(0,00)
Clases SEK con cobertura						
32.624.869 SEK	3.894.748 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	6	(79.301)	(0,00)
836.202.636 SEK	101.213.885 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	3	(3.367.375)	(0,08)
6.492.873 SEK	763.209 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(3.874)	(0,00)
79.347.993 SEK	9.415.680 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	31	(136.003)	(0,00)

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (1,32%) (31 de diciembre de 2020: (0,33%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases SEK con cobertura (cont.)						
14.083.019 SEK	1.663.994 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	12	(16.100)	(0,00)
23.074 USD	197.608 SEK	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	(35)	(0,00)
578.551 USD	4.945.506 SEK	15/09/2021	Westpac Banking Corp	2	(137)	(0,00)
Clases SGD con cobertura						
762.437 SGD	572.569 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	5	(5.387)	(0,00)
182.973 SGD	138.193 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(2.098)	(0,00)
1.365.418 SGD	1.026.921 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	39	(11.177)	(0,00)
25.285.122 SGD	19.111.723 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	12	(304.756)	(0,01)
123.126 USD	165.556 SGD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	(13)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(55.049.835)	(1,32)

Contratos de futuros (0,13%) (31 de diciembre de 2020: (0,12%))

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(545)	Euro-BOBL Future September 2021	(109.874)	(0,00)
(1.739)	Euro-Bund Future September 2021	(2.454.113)	(0,06)
(636)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2021	(2.642.185)	(0,06)
(404)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2021	(309.313)	(0,01)
Minusvalía latente total sobre contratos de futuros [*]		(5.515.485)	(0,13)

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(60.565.320)	(1,45)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	4.046.953.839	96,84
Otro activo neto	132.075.088	3,16
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	4.179.028.927	100,00

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

Análisis de la cartera	USD	% de los Activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	3.835.346.872	87,81
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	220.783.392	5,05
† Otros valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario	7.045.432	0,16
μ Fondos de inversión	16.606.500	0,38
± Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	3.650.859	0,08
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(36.479.216)	(0,84)
Total inversiones	4.046.953.839	92,64

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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 período 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 período. Como mínimo, se presentan las 20 compras y las 20 ventas más importantes, siempre que se disponga de dicha información.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
105.200.000	Argentine Republic Government International Bond, 0.13%, 09/07/2030	37.700.486
30.688.000	Peruvian Government International Bond, 1.25%, 11/03/2033	36.242.712
25.620.000	Colombia Government International Bond, 5.00%, 15/06/2045	26.892.795
24.516.000	Ukraine Government International Bond, 7.38%, 25/09/2032	25.868.161
13.000.000	Peruvian Government International Bond, 8.75%, 21/11/2033	20.258.299
18.370.000	Colombia Government International Bond, 5.20%, 15/05/2049	19.750.463
17.300.000	El Salvador Government International Bond, 9.50%, 15/07/2052	19.415.155
14.000.000	Indonesia Government International Bond, 1.40%, 30/10/2031	17.507.967
14.803.000	Petroleos del Peru SA, 5.63%, 19/06/2047	16.981.706
15.890.000	Brazilian Government International Bond, 5.63%, 07/01/2041	16.777.138
13.500.000	KazMunayGas National Co JSC, 5.38%, 24/04/2030	16.514.885
16.352.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 2.30%, 08/01/2031	16.267.951
15.358.000	Ghana Government International Bond, 7.75%, 07/04/2029	15.602.282
11.220.000	Romanian Government International Bond, 3.38%, 28/01/2050	15.245.681
10.600.000	Romanian Government International Bond, 3.88%, 29/10/2035	15.182.155
25.870.000	Ecuador Government International Bond, 0.50%, 31/07/2030	14.786.600
11.293.000	Philippine Government International Bond, 1.75%, 28/04/2041	13.454.739
11.610.000	Sasol Financing USA LLC, 6.50%, 27/09/2028	13.003.425
10.040.000	Senegal Government International Bond, 4.75%, 13/03/2028	12.969.063
10.300.000	Mexico Government International Bond, 5.75%, 12/10/2110	12.408.245
12.306.000	CSN Resources SA, 4.63%, 10/06/2031	12.306.000
28.260.000	Ecuador Government International Bond, 0.50%, 31/07/2035	11.823.385
9.210.000	Ghana Government International Bond, 10.75%, 14/10/2030	11.695.425
11.500.000	Ghana Government International Bond, 7.88%, 11/02/2035	11.587.550
9.677.000	Republic of Cameroon International Bond, 5.95%, 07/07/2032	11.475.954
11.138.000	Ghana Government International Bond, 8.63%, 07/04/2034	11.342.507
11.399.000	Turkey Government International Bond, 5.88%, 26/06/2031	11.334.026
11.300.000	Oman Government International Bond, 6.75%, 17/01/2048	11.297.043
10.100.000	Nigeria Government International Bond, 7.88%, 16/02/2032	11.131.720
8.370.000	Ivory Coast Government International Bond, 6.88%, 17/10/2040	11.070.443
9.236.000	Romanian Government International Bond, 2.00%, 14/04/2033	10.871.167
8.757.000	Banque Ouest Africaine de Developpement, 2.75%, 22/01/2033	10.713.526

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

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
29.640.000	Croatia Government International Bond, 1.50%, 17/06/2031	36.770.714
27.480.000	Serbia International Bond, 1.50%, 26/06/2029	33.197.594
23.938.000	Abu Dhabi Government International Bond, 3.13%, 16/04/2030	25.990.998
19.651.000	Petronas Capital Ltd, 4.55%, 21/04/2050	23.615.813
14.750.000	Ukraine Government International Bond, 7.75%, 01/09/2026	16.428.689
22.980.000	Ecuador Government International Bond, 0.50%, 31/07/2035	16.178.987
28.260.000	Ecuador Government International Bond, 0.50%, 31/07/2030	15.152.926
12.400.000	Russian Foreign Bond - Eurobond, 4.38%, 21/03/2029	13.935.800
13.691.000	Republic of Armenia International Bond, 3.95%, 26/09/2029	13.333.955
11.370.000	Egypt Government International Bond, 7.63%, 29/05/2032	12.185.043
12.270.000	Turkey Government International Bond, 5.95%, 15/01/2031	11.106.667
9.700.000	Saudi Arabian Oil Co, 4.25%, 16/04/2039	10.665.830
8.400.000	Croatia Government International Bond, 1.13%, 19/06/2029	10.422.534
8.797.000	Qatar Government International Bond, 4.00%, 14/03/2029	10.060.147
8.070.000	Ivory Coast Government International Bond, 4.88%, 30/01/2032	10.002.972
8.700.000	Bermuda Government International Bond, 3.72%, 25/01/2027	9.523.195
9.380.000	Romanian Government International Bond, 3.00%, 14/02/2031	9.520.700
8.781.000	Samba Funding Ltd, 2.90%, 29/01/2027	9.367.571
8.917.000	Panama Government International Bond, 3.16%, 23/01/2030	9.317.493
7.000.000	Indonesia Government International Bond, 1.40%, 30/10/2031	8.646.505
8.870.000	Vedanta Resources Ltd, 6.38%, 30/07/2022	8.160.400
7.779.000	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 5.13%, 14/03/2028	8.040.285
7.821.000	Panama Government International Bond, 2.25%, 29/09/2032	7.505.708
7.866.000	Republic of Belarus Ministry of Finance, 6.38%, 24/02/2031	7.501.555
6.500.000	Qatar Government International Bond, 3.75%, 16/04/2030	7.339.350
7.268.000	Gabon Government International Bond, 6.63%, 06/02/2031	7.254.625
6.600.000	Republic of Uzbekistan Bond, 4.75%, 20/02/2024	7.040.820
5.120.000	Votorantim Cimentos International SA, 7.25%, 05/04/2041	6.882.565
6.000.000	Russian Foreign Bond - Eurobond, 4.25%, 23/06/2027	6.668.140
5.471.000	Eskom Holdings SOC Ltd, 6.35%, 10/08/2028	6.004.423

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 0,60%. En el mismo periodo, el índice de referencia, el JPMorgan CEMBI Diversified Index (rentabilidad total en USD) (el «índice»), registró una rentabilidad del 1,11%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Los bonos corporativos en monedas fuertes de mercados emergentes ("ME") rebotaron ligeramente en el primer semestre de 2021, dado que las expectativas de moderación de las medidas de confinamiento y un fuerte repunte del crecimiento dieron lugar a una pequeña contracción de los diferenciales en general. El mercado de alta rentabilidad generó una rentabilidad superior, con un avance del 2,7%, mientras que su homólogo con grado de inversión obtuvo una rentabilidad plana. A diferencia de 2020, hemos presenciado un repunte de los precios del petróleo gracias a la recuperación continuada de la demanda y al aplazamiento de la reincorporación de Irán a los mercados de crudo. Los metales también obtuvieron excelentes resultados durante el año; sin embargo, tanto el sector industrial como el de metales preciosos dieron un giro a la baja en junio como consecuencia de las presiones procedentes de China. El dólar estadounidense se debilitó durante el segundo trimestre, pero rebotó con fuerza tras la reunión de la Reserva Federal estadounidense.

La selección de valores y el movimiento en la curva de tipos fueron los principales detractores de la rentabilidad, mientras que el posicionamiento en duración de diferenciales larga fue positivo. Lo que motivó principalmente la peor rentabilidad relativa fue la sobreponderación de China y la selección de valores en este país, así como el posicionamiento en los EAU y Filipinas, donde mantenemos una posición infraponderada en efectivo. En China, el sector que más perjudicó a la rentabilidad fue el financiero, donde una importante sociedad gestora de activos ("AMC") no publicó los resultados financieros en plazo y los bonos cayeron al no recibir la ayuda del gobierno, lo que generó preocupación en todo el sector de AMC. La sobreponderación de diferenciales favoreció a los resultados, al igual que la exposición al segmento de calificaciones BB y B, que tuvo un buen comportamiento, mientras que la infraponderación de títulos con calificación CCC lastró los resultados debido al fuerte repunte de los activos de riesgo. La cifra de emisiones nuevas sigue siendo elevada, superando los 300.000 millones de dólares a mediados de año, y la previsión de cara al futuro es que cierren el año ligeramente por encima de lo que se esperaba, con emisiones nuevas por valor de 550.000 millones de dólares. Por otra parte, hemos observado un considerable interés en los bonos verdes, sociales y sostenibles (GSS, por sus siglas en inglés) y que las empresas emiten este tipo de bonos de forma mucho más activa que nunca, con una oferta que ya ha alcanzado los 50.000 millones de dólares en lo que va de año.

Las expectativas de crecimiento mundial para el resto de 2021 siguen siendo alentadoras, siendo probable que los ME se beneficien de la incesante recuperación cíclica, tal como reflejan tanto los datos de manufacturas como los precios de las materias primas. La aceleración de la vacunación prevista para el segundo semestre del año en el mundo emergente probablemente también favorecerá a la dinámica del crecimiento doméstico. Prevemos un rebote del EBITDA de la deuda corporativa de ME y una mejora de las métricas de apalancamiento de las empresas. Los impagos de bonos corporativos de alta rentabilidad de ME probablemente seguirán contenidos de aquí en adelante y prevemos una tasa de morosidad del 3,5% para 2021, ligeramente por encima del promedio a 10 años de esta clase de activos. Un aumento exagerado de los tipos de interés estadounidenses podría suponer un riesgo de cola para esta clase de activos, aunque nuestra hipótesis central es que los tipos subirán gradualmente en los próximos trimestres, lo cual no creemos que trastoque excesivamente las condiciones de financiación ni los resultados de los diferenciales de ME. Parece que las valoraciones de la deuda corporativa se sitúan dentro de un rango de valor razonable, pero todavía atractivo en comparación con los mercados desarrollados.

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		148.952.236	156.663.738
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	582.455	6.660.369
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		1.564.916	6
Cuentas a percibir por acciones emitidas		428.471	1.114.652
Cuentas por cobrar de intermediarios		560.113	257.706
Ingresos a percibir y otros activos		1.900.036	2.183.115
Activos totales		153.988.227	166.879.586
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		3.715.558	202.262
Descubierto bancario	3	28.492	279
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		111.092	134.090
Gastos devengados		165.086	194.934
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		3.111.266	-
Otras cuentas por pagar		77.808	55.296
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		7.209.302	586.861
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		146.778.925	166.292.725

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		3.572.259	3.973.030
Ingresos por préstamo de valores	15	1.214	–
Ingresos varios		–	1
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(6.694.891)	(8.595.474)
		(3.121.418)	(4.622.443)
Gastos			
Comisión de gestión	5	574.432	618.718
Comisión de distribución	5	37.952	53.212
Comisión de administración	5	122.757	145.502
Comisión de compromiso	16	12.074	8.043
Comisión de depósito	5	6.396	7.155
Comisión del Depositario	5	3.809	7.796
Honorarios profesionales	7	80.251	32.718
Honorarios de los Consejeros	6	1.931	2.324
Costes de transacciones	7	29.562	31.246
Honorarios de auditoría	7	11.990	11.659
Reembolso de IVA		(752)	(514)
Otros gastos	7	5.289	6.593
Gastos no asumidos	5	(131.375)	(106.750)
Gastos totales		754.316	817.702
Costes financieros			
Gastos por intereses		1.865	25
Repartos de dividendos abonados	1	214.314	192.827
		216.179	192.852
Impuestos retenidos en origen		46	–
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		(4.091.959)	(5.632.997)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	166.292.725	175.607.911
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	(4.091.959)	(5.632.997)
Suscripciones	11.462.608	8.743.663
Reembolsos	(26.884.449)	(25.820.865)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	146.778.925	152.897.712

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)

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 de empresa 98,73% (31 de diciembre de 2020: 91,88%)					
Euro					
455.000	Novolipetsk Steel Via Steel Funding DAC*	1,45%	02/06/2026	539.973	0,37
Total euro				539.973	0,37
Dólar estadounidense					
1.000.000	1MDB Global Investments Ltd**	4,40%	09/03/2023	1.008.481	0,69
300.000	ABJA Investment Co Pte Ltd*	5,45%	24/01/2028	321.597	0,22
200.000	ABJA Investment Co Pte Ltd*	5,95%	31/07/2024	216.570	0,15
391.000	ABQ Finance Ltd*	3,13%	24/09/2024	409.485	0,28
300.000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*	4,60%	02/11/2047	354.603	0,24
416.000	Abu Dhabi National Energy Co PJSC*	2,00%	29/04/2028	419.245	0,29
278.000	Abu Dhabi National Energy Co PJSC*	4,88%	23/04/2030	334.838	0,23
650.000	Adani Electricity Mumbai Ltd*	3,95%	12/02/2030	650.514	0,44
300.000	Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ*	6,25%	10/12/2024	331.737	0,23
347.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd*	4,20%	04/08/2027	362.397	0,25
800.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd**	4,38%	03/07/2029	839.802	0,57
210.000	AES Gener SA*	7,13%	26/03/2079	225.100	0,15
217.000	Africa Finance Corp*	2,88%	28/04/2028	218.261	0,15
335.000	African Export-Import Bank*	3,99%	21/09/2029	352.235	0,24
303.000	AIA Group Ltd*	2,70%	29/12/2049	306.939	0,21
500.000	AIA Group Ltd**	3,60%	09/04/2029	554.515	0,38
300.000	Akbank TAS*	5,00%	24/10/2022	307.329	0,21
352.000	Akbank TAS**	6,80%	06/02/2026	371.085	0,25
250.000	Alfa SAB de CV**	6,88%	25/03/2044	330.758	0,23
450.000	Alibaba Group Holding Ltd*	4,00%	06/12/2037	506.336	0,34
368.000	Alpek SAB de CV*	3,25%	25/02/2031	373.664	0,25
357.000	Alpek SAB de CV**	4,25%	18/09/2029	388.516	0,26
400.000	Altice Financing SA*	7,50%	15/05/2026	417.020	0,28
517.000	America Movil SAB de CV*	3,63%	22/04/2029	571.462	0,39
260.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc*	3,75%	01/10/2030	269.303	0,18
246.000	Antofagasta Plc**	2,38%	14/10/2030	237.329	0,16
581.000	Arabian Centres Sukuk II Ltd*	5,63%	07/10/2026	618.492	0,42
200.000	Atento Luxco 1 SA**	8,00%	10/02/2026	217.587	0,15
271.000	Axiata SPV2 Bhd*	2,16%	19/08/2030	266.625	0,18
288.000	Azul Investments LLP**	7,25%	15/06/2026	282.937	0,19
285.000	B2W Digital Lux Sarl**	4,38%	20/12/2030	285.965	0,19
272.000	Baidu Inc*	3,08%	07/04/2025	287.620	0,20
400.000	Banco BTG Pactual SA*	2,75%	11/01/2026	390.304	0,27

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)

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 98,73% (31 de diciembre de 2020: 91,88%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
210.000	Banco Davivienda SA**	6,65%	29/12/2049	220.854	0,15
500.000	Banco de Bogota SA*	4,38%	03/08/2027	528.732	0,36
750.000	Banco de Bogota SA*	6,25%	12/05/2026	822.214	0,56
506.000	Banco de Credito del Peru**	3,13%	01/07/2030	503.925	0,34
300.000	Banco do Brasil SA**	4,75%	20/03/2024	321.285	0,22
470.000	Banco do Brasil SA**	9,00%	29/12/2049	524.332	0,36
442.000	Banco General SA**	4,13%	07/08/2027	484.680	0,33
350.000	Banco Inbursa SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Inbursa*	4,38%	11/04/2027	374.904	0,26
300.000	Banco Internacional del Peru SAA Interbank**	3,25%	04/10/2026	306.945	0,21
213.000	Banco Mercantil del Norte SA*	7,50%	29/12/2049	240.956	0,16
250.000	Banco Mercantil del Norte SA*	7,63%	29/12/2049	284.188	0,19
363.000	Banco Santander Chile**	2,70%	10/01/2025	379.393	0,26
200.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand**	5,38%	17/04/2025	227.178	0,15
395.000	Bancolombia SA*	4,63%	18/12/2029	401.916	0,27
548.000	Bangkok Bank PCL**	3,73%	25/09/2034	569.630	0,39
685.000	Bank Leumi Le-Israel BM*	3,28%	29/01/2031	702.125	0,48
204.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT*	3,75%	11/04/2024	216.323	0,15
211.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT*	4,75%	13/05/2025	235.224	0,16
333.000	Bank Muscat SAOG*	4,75%	17/03/2026	346.320	0,24
213.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*	3,75%	30/03/2026	217.318	0,15
200.000	BBK BSC*	5,50%	09/07/2024	212.169	0,14
259.000	BBVA Bancomer SA**	5,88%	13/09/2034	283.883	0,19
200.000	Bharti Airtel Ltd**	3,25%	03/06/2031	199.242	0,14
950.000	BOC Aviation Ltd*	3,00%	11/09/2029	976.639	0,67
205.000	BOC Aviation Ltd**	3,50%	18/09/2027	218.717	0,15
200.000	Braskem Idesa SAPI*	7,45%	15/11/2029	212.664	0,14
525.000	Braskem Netherlands Finance BV**	8,50%	23/01/2081	612.334	0,42
500.000	BRF SA**	4,88%	24/01/2030	525.692	0,36
250.000	Burgan Bank SAK*	5,75%	29/12/2049	252.756	0,17
400.000	C&W Senior Financing DAC**	6,88%	15/09/2027	428.220	0,29
462.000	C&W Senior Financing DAC**	7,50%	15/10/2026	486.678	0,33
270.000	Cable Onda SA**	4,50%	30/01/2030	285.160	0,19
580.000	CAS Capital No 1 Ltd*	4,00%	29/12/2049	582.320	0,40
302.000	CBQ Finance Ltd*	2,00%	15/09/2025	303.762	0,21
321.000	CBQ Finance Ltd*	2,00%	12/05/2026	319.997	0,22
200.000	CBQ Finance Ltd*	5,00%	24/05/2023	215.512	0,15
574.000	Celestial Miles Ltd*	5,75%	29/12/2049	611.310	0,42

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)

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 98,73% (31 de diciembre de 2020: 91,88%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
200.000	Cemex SAB de CV**	5,13%	29/12/2049	206.690	0,14
225.000	Cemex SAB de CV**	7,38%	05/06/2027	253.688	0,17
250.000	Cemig Geracao e Transmissao SA*	9,25%	05/12/2024	288.815	0,20
300.000	Cencosud SA*	4,38%	17/07/2027	328.713	0,22
200.000	Cencosud SA**	6,63%	12/02/2045	256.050	0,17
427.000	Central American Bottling Corp*	5,75%	31/01/2027	447.240	0,30
222.000	Champion Path Holdings Ltd*	4,50%	27/01/2026	230.349	0,16
285.000	Champion Path Holdings Ltd*	4,85%	27/01/2028	297.495	0,20
500.000	China Construction Bank Corp*	2,45%	24/06/2030	511.073	0,35
300.000	China Development Bank Financial Leasing Co Ltd*	2,88%	28/09/2030	304.581	0,21
235.000	China Evergrande Group*	8,25%	23/03/2022	200.449	0,14
350.000	China Evergrande Group*	8,75%	28/06/2025	231.668	0,16
200.000	China Overseas Finance Cayman VI Ltd*	6,45%	11/06/2034	267.546	0,18
203.000	China Resources Land Ltd*	4,13%	26/02/2029	221.629	0,15
413.000	Chinalco Capital Holdings Ltd*	2,13%	03/06/2026	411.138	0,28
230.000	CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd*	2,00%	26/01/2026	229.036	0,16
300.000	CIFI Holdings Group Co Ltd*	5,95%	20/10/2025	316.457	0,22
400.000	CK Hutchison Capital Securities 17 Ltd**	4,00%	29/12/2049	408.000	0,28
200.000	CLP Power HK Finance Ltd*	3,55%	29/12/2049	209.552	0,14
320.000	CMB International Leasing Management Ltd*	1,88%	12/08/2025	317.273	0,22
214.000	CMB International Leasing Management Ltd*	2,75%	12/08/2030	210.928	0,14
362.000	Colombia Telecomunicaciones SA ESP**	4,95%	17/07/2030	376.717	0,26
600.000	Commercial Bank PSQC*	4,50%	29/12/2049	605.250	0,41
395.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	3,00%	30/09/2029	410.996	0,28
450.000	Cosan SA**	5,50%	20/09/2029	486.225	0,33
353.000	Country Garden Holdings Co Ltd*	4,80%	06/08/2030	367.404	0,25
230.000	Country Garden Holdings Co Ltd*	6,15%	17/09/2025	252.193	0,17
200.000	Credicorp Ltd**	2,75%	17/06/2025	203.485	0,14
200.000	Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc*	4,70%	29/01/2025	206.964	0,14
939.000	CSN Inova Ventures**	6,75%	28/01/2028	1.039.708	0,71
695.000	CSN Resources SA**	4,63%	10/06/2031	710.888	0,48
345.000	CSN Resources SA**	7,63%	17/04/2026	372.493	0,25
200.000	DBS Group Holdings Ltd*	4,52%	11/12/2028	215.937	0,15
323.000	DIB Sukuk Ltd*	1,96%	22/06/2026	323.245	0,22
250.000	DIB Tier 1 Sukuk 3 Ltd*	6,25%	29/12/2049	271.250	0,18
273.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank*	4,13%	30/06/2028	273.142	0,19
580.000	Ecopetrol SA*	5,88%	28/05/2045	622.220	0,42

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)

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 98,73% (31 de diciembre de 2020: 91,88%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
636.000	Ecopetrol SA*	6,88%	29/04/2030	768.453	0,52
539.000	Ecopetrol SA*	7,38%	18/09/2043	665.775	0,45
200.000	EI Sukuk Co Ltd*	1,83%	23/09/2025	201.041	0,14
275.000	Elect Global Investments Ltd*	4,10%	29/12/2049	280.401	0,19
220.000	Elect Global Investments Ltd*	4,85%	29/12/2049	230.198	0,16
292.000	Emaar Sukuk Ltd*	3,88%	17/09/2029	297.719	0,20
710.000	Embraer Netherlands Finance BV*	6,95%	17/01/2028	813.838	0,55
300.000	Emirates Development Bank PJSC*	3,52%	06/03/2024	320.071	0,22
400.000	Emirates NBD Bank PJSC*	4,25%	29/12/2049	412.724	0,28
500.000	Emirates NBD Bank PJSC*	6,13%	29/12/2049	538.750	0,37
205.000	Enel Chile SA*	4,88%	12/06/2028	236.980	0,16
246.835	Energean Israel Finance Ltd*	4,88%	30/03/2026	252.673	0,17
280.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd*	3,38%	12/05/2026	285.753	0,19
200.000	Equate Petrochemical BV*	2,63%	28/04/2028	202.480	0,14
200.000	Equate Petrochemical BV*	4,25%	03/11/2026	221.898	0,15
488.000	First Quantum Minerals Ltd**	6,88%	15/10/2027	532.384	0,36
300.000	First Quantum Minerals Ltd**	7,25%	01/04/2023	306.189	0,21
296.000	First Quantum Minerals Ltd**	7,50%	01/04/2025	307.880	0,21
200.000	FirstRand Bank Ltd*	6,25%	23/04/2028	210.883	0,14
500.000	Formosa Group Cayman Ltd*	3,38%	22/04/2025	529.175	0,36
600.000	Franshion Brilliant Ltd*	4,25%	23/07/2029	597.709	0,41
200.000	Fresnillo Plc**	4,25%	02/10/2050	202.933	0,14
550.000	FS Luxembourg Sarl**	10,00%	15/12/2025	616.025	0,42
600.000	FWD Group Ltd*	5,75%	09/07/2024	616.814	0,42
300.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,63%	31/03/2036	293.804	0,20
300.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,94%	30/09/2040	297.237	0,20
500.000	Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA*	5,15%	11/02/2026	562.141	0,38
500.000	Gazprom PJSC via Gaz Finance Plc*	3,25%	25/02/2030	497.000	0,34
300.000	GC Treasury Center Co Ltd*	2,98%	18/03/2031	307.094	0,21
200.000	Geopark Ltd**	5,50%	17/01/2027	202.252	0,14
400.000	GNL Quintero SA*	4,63%	31/07/2029	436.750	0,30
100.000	Gol Finance SA*	7,00%	31/01/2025	96.573	0,07
226.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd*	6,13%	15/05/2029	268.669	0,18
200.000	Greenko Dutch BV**	3,85%	29/03/2026	205.150	0,14
300.000	Greenland Global Investment Ltd*	6,75%	25/06/2022	277.638	0,19
232.803	Guara Norte Sarl**	5,20%	15/06/2034	242.999	0,17
200.000	Gulf International Bank BSC*	2,38%	23/09/2025	201.932	0,14

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)

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 98,73% (31 de diciembre de 2020: 91,88%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
600.000	Haidilao International Holding Ltd*	2,15%	14/01/2026	593.343	0,40
301.000	Haitong International Securities Group Ltd*	3,13%	18/05/2025	313.451	0,21
258.000	Haitong International Securities Group Ltd*	3,38%	19/07/2024	270.774	0,18
921.000	Hanwha Life Insurance Co Ltd*	4,70%	29/12/2049	964.821	0,66
200.000	HKT Capital No 2 Ltd*	3,63%	02/04/2025	213.788	0,15
300.000	Hongkong Electric Finance Ltd*	1,88%	27/08/2030	289.807	0,20
203.000	HPHT Finance 21 Ltd*	2,00%	19/03/2026	206.062	0,14
700.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd*	4,00%	29/12/2049	436.625	0,30
217.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	3,38%	24/02/2030	149.348	0,10
233.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	4,50%	29/05/2029	161.935	0,11
275.000	Huarong Finance II Co Ltd*	5,50%	16/01/2025	204.207	0,14
800.000	Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru**	6,38%	01/06/2028	845.000	0,58
300.000	Hyundai Capital America**	3,50%	02/11/2026	324.943	0,22
456.000	ICL Group Ltd**	6,38%	31/05/2038	577.921	0,39
491.000	IHS Netherlands Holdco BV**	8,00%	18/09/2027	531.518	0,36
216.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT*	3,40%	09/06/2031	219.366	0,15
252.000	Industrias Penoles SAB de CV**	4,15%	12/09/2029	274.166	0,19
233.000	Industrias Penoles SAB de CV**	4,75%	06/08/2050	252.497	0,17
475.000	Inkia Energy Ltd*	5,88%	09/11/2027	494.655	0,34
215.000	InRetail Consumer**	3,25%	22/03/2028	212.939	0,15
300.000	InterCement Financial Operations BV*	5,75%	17/07/2024	292.350	0,20
274.000	Investment Energy Resources Ltd*	6,25%	26/04/2029	296.948	0,20
200.000	Israel Electric Corp Ltd*	5,00%	12/11/2024	224.027	0,15
400.000	Israel Electric Corp Ltd*	6,88%	21/06/2023	446.909	0,30
323.000	Itau Unibanco Holding SA**	4,50%	21/11/2029	332.181	0,23
513.000	JBS Finance Luxembourg Sarl**	3,63%	15/01/2032	513.354	0,35
324.000	JBS USA Food Co*	5,75%	15/01/2028	348.047	0,24
600.000	JMH Co Ltd*	2,50%	09/04/2031	607.718	0,41
208.000	JSW Hydro Energy Ltd*	4,13%	18/05/2031	211.316	0,14
640.000	JSW Steel Ltd*	5,95%	18/04/2024	683.744	0,47
200.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	9,38%	30/06/2024	188.460	0,13
200.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	10,50%	15/01/2025	187.863	0,13
200.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	10,88%	23/07/2023	199.724	0,14
200.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	11,25%	16/04/2025	188.942	0,13
200.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	11,70%	11/11/2025	188.843	0,13
850.000	Kallpa Generacion SA*	4,13%	16/08/2027	874.633	0,60
500.000	Kenbourne Invest SA**	6,88%	26/11/2024	531.435	0,36

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)

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 98,73% (31 de diciembre de 2020: 91,88%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
413.000	Klabin Austria GmbH**	3,20%	12/01/2031	406.483	0,28
200.000	Klabin Austria GmbH*	5,75%	03/04/2029	228.861	0,16
400.000	KOC Holding AS*	5,25%	15/03/2023	412.015	0,28
223.000	Kookmin Bank*	2,50%	04/11/2030	222.235	0,15
226.000	Kookmin Bank*	4,35%	29/12/2049	238.851	0,16
307.000	Kosmos Energy Ltd*	7,13%	04/04/2026	305.316	0,21
224.000	Krung Thai Bank PCL*	4,40%	29/12/2049	226.793	0,15
300.000	Kuwait Projects Co SPC Ltd*	5,00%	15/03/2023	310.608	0,21
301.000	Kyobo Life Insurance Co Ltd*	3,95%	29/12/2049	307.359	0,21
600.000	Lenovo Group Ltd**	5,88%	24/04/2025	677.827	0,46
471.671	Leviathan Bond Ltd*	6,50%	30/06/2027	523.249	0,36
309.038	Leviathan Bond Ltd*	6,75%	30/06/2030	348.050	0,24
229.000	LG Chem Ltd*	2,38%	07/07/2031	229.078	0,16
256.000	Light Servicos de Eletricidade SA/Light Energia SA*	4,38%	18/06/2026	257.920	0,18
400.000	Liquid Telecommunications Financing PLC*	8,50%	13/07/2022	402.931	0,27
600.000	Lukoil Securities BV*	3,88%	06/05/2030	635.046	0,43
628.000	MARB BondCo Plc*	3,95%	29/01/2031	606.303	0,41
243.000	Marble II Pte Ltd*	5,30%	20/06/2022	243.383	0,17
246.000	Mashreqbank PSC*	4,25%	26/02/2024	263.513	0,18
239.000	MCC Holding Hong Kong Corp Ltd*	3,25%	29/12/2049	242.585	0,17
411.000	Medco Bell Pte Ltd*	6,38%	30/01/2027	424.497	0,29
579.000	Medco Oak Tree Pte Ltd*	7,38%	14/05/2026	634.558	0,43
335.000	MEGlobal Canada ULC*	5,00%	18/05/2025	376.503	0,26
322.000	MEGlobal Canada ULC*	5,88%	18/05/2030	398.115	0,27
204.000	Meituan*	3,05%	28/10/2030	202.055	0,14
218.000	Melco Resorts Finance Ltd*	5,38%	04/12/2029	230.671	0,16
1.200.000	Melco Resorts Finance Ltd**	5,63%	17/07/2027	1.255.668	0,86
200.000	Melco Resorts Finance Ltd*	5,75%	21/07/2028	211.500	0,14
200.000	MercadoLibre Inc**	3,13%	14/01/2031	196.600	0,13
450.000	Metinvest BV*	8,50%	23/04/2026	513.838	0,35
400.000	MHP SE*	7,75%	10/05/2024	435.423	0,30
235.000	Millicom International Cellular SA**	4,50%	27/04/2031	243.548	0,17
200.700	Millicom International Cellular SA*	6,25%	25/03/2029	219.701	0,15
361.800	Millicom International Cellular SA*	6,63%	15/10/2026	383.854	0,26
705.000	Minera Mexico SA de CV**	4,50%	26/01/2050	791.137	0,54
694.000	Minerva Luxembourg SA*	4,38%	18/03/2031	690.357	0,47
589.000	Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd*	3,38%	29/12/2049	603.725	0,41

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)

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 98,73% (31 de diciembre de 2020: 91,88%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
290.000	Mizrahi Tefahot Bank Ltd*	3,08%	07/04/2031	292.900	0,20
200.000	Movida Europe SA**	5,25%	08/02/2031	202.504	0,14
246.000	MSU Energy SA/UGEN SA/UENSA SA**	6,88%	01/02/2025	195.265	0,13
500.000	MTN Mauritius Investments Ltd*	6,50%	13/10/2026	579.717	0,39
653.639	MV24 Capital BV*	6,75%	01/06/2034	725.131	0,49
243.538	Nakilat Inc**	6,07%	31/12/2033	300.513	0,20
231.000	National Central Cooling Co PJSC*	2,50%	21/10/2027	229.194	0,16
467.000	Natura Cosmetics SA**	4,13%	03/05/2028	479.259	0,33
559.000	NBK Tier 1 Financing 2 Ltd*	4,50%	29/12/2049	583.438	0,40
370.000	Nemak SAB de CV**	3,63%	28/06/2031	372.572	0,25
250.000	Network i2i Ltd*	5,65%	29/12/2049	268.281	0,18
400.000	Nexa Resources SA**	5,38%	04/05/2027	430.692	0,29
343.000	Nexa Resources SA**	6,50%	18/01/2028	387.931	0,26
377.000	NWD MTN Ltd*	4,13%	18/07/2029	392.540	0,27
202.000	OCP SA*	3,75%	23/06/2031	204.475	0,14
200.000	OCP SA*	6,88%	25/04/2044	244.777	0,17
237.000	Oil & Gas Holding Co BSCC*	7,63%	07/11/2024	264.967	0,18
550.000	Oil India International Pte Ltd*	4,00%	21/04/2027	580.685	0,40
400.000	Oil India Ltd*	5,13%	04/02/2029	447.764	0,31
294.000	Ooredoo International Finance Ltd*	2,63%	08/04/2031	298.225	0,20
226.000	OQ SAOC*	5,13%	06/05/2028	227.736	0,16
500.000	Orazul Energy Egenor SCA*	5,63%	28/04/2027	519.690	0,35
338.000	Orbia Advance Corp SAB de CV**	2,88%	11/05/2031	340.549	0,23
300.000	Orbia Advance Corp SAB de CV*	5,88%	17/09/2044	365.108	0,25
272.000	Oryx Funding Ltd*	5,80%	03/02/2031	286.935	0,20
200.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd**	1,83%	10/09/2030	200.552	0,14
200.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd*	4,25%	19/06/2024	218.672	0,15
483.000	Oztel Holdings SPC Ltd*	6,63%	24/04/2028	534.857	0,36
315.000	Pampa Energia SA*	7,38%	21/07/2023	306.906	0,21
250.000	Parkway Pantai Ltd*	4,25%	29/12/2049	252.937	0,17
500.000	Periama Holdings LLC*	5,95%	19/04/2026	541.344	0,37
233.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	4,38%	05/02/2050	239.130	0,16
381.000	Petrobras Global Finance BV*	5,50%	10/06/2051	381.610	0,26
203.000	Petrobras Global Finance BV*	5,60%	03/01/2031	227.614	0,16
200.000	Petroleos Mexicanos*	6,50%	23/01/2029	206.100	0,14
300.000	Petropavlovsk 2016 Ltd*	8,13%	14/11/2022	311.612	0,21
283.000	Petrorio Luxembourg Sarl**	6,13%	09/06/2026	289.863	0,20

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)

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 98,73% (31 de diciembre de 2020: 91,88%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
342.000	Philippine National Bank [*]	3,28%	27/09/2024	359.038	0,24
239.000	Power Finance Corp Ltd [*]	3,95%	23/04/2030	246.788	0,17
200.000	Power Finance Corp Ltd [*]	6,15%	06/12/2028	237.037	0,16
309.000	Prosus NV [*]	4,85%	06/07/2027	352.643	0,24
500.000	Prosus NV [*]	5,50%	21/07/2025	571.710	0,39
480.000	PTTEP Treasury Center Co Ltd [*]	3,90%	06/12/2059	517.710	0,35
600.000	Qatar Petroleum [*]	2,25%	12/07/2031	593.622	0,40
295.000	Qatar Petroleum [*]	3,13%	12/07/2041	293.911	0,20
300.000	QIB Sukuk Ltd [*]	3,98%	26/03/2024	321.831	0,22
241.000	QNB Finance Ltd [*]	2,63%	12/05/2025	252.562	0,17
367.000	QNB Finance Ltd [*]	2,75%	12/02/2027	383.793	0,26
291.000	QNB Finance Ltd [*]	3,50%	28/03/2024	310.226	0,21
597.000	QNB Finansbank AS [*]	6,88%	07/09/2024	648.193	0,44
300.000	Raizen Fuels Finance SA ^{**}	5,30%	20/01/2027	339.683	0,23
390.000	REC Ltd [*]	2,25%	01/09/2026	382.471	0,26
605.000	Rede D'or Finance Sarl ^{**}	4,50%	22/01/2030	621.864	0,42
250.000	Reliance Industries Ltd [*]	3,67%	30/11/2027	273.798	0,19
250.000	Reliance Industries Ltd [*]	4,88%	10/02/2045	311.974	0,21
400.000	RKPF Overseas 2020 A Ltd [*]	5,20%	12/01/2026	402.701	0,27
800.000	Rumo Luxembourg Sarl ^{**}	5,25%	10/01/2028	857.320	0,58
241.000	SA Global Sukuk Ltd [*]	2,69%	17/06/2031	243.542	0,17
337.000	SABIC Capital I BV [*]	2,15%	14/09/2030	326.404	0,22
600.000	Sable International Finance Ltd ^{**}	5,75%	07/09/2027	632.193	0,43
1.278.000	Saka Energi Indonesia PT [*]	4,45%	05/05/2024	1.215.046	0,83
500.000	Samba Funding Ltd [*]	2,75%	02/10/2024	521.787	0,36
500.000	Samba Funding Ltd [*]	2,90%	29/01/2027	522.302	0,36
200.000	Sands China Ltd ^{**}	3,80%	08/01/2026	214.344	0,15
275.000	Sands China Ltd [*]	5,13%	08/08/2025	307.942	0,21
1.350.000	Sands China Ltd [*]	5,40%	08/08/2028	1.568.956	1,07
1.240.000	Sasol Financing USA LLC [*]	5,88%	27/03/2024	1.327.439	0,90
500.000	Sasol Financing USA LLC [*]	6,50%	27/09/2028	564.230	0,38
1.600.000	Saudi Arabian Oil Co [*]	4,25%	16/04/2039	1.794.862	1,22
742.000	Saudi Arabian Oil Co [*]	4,38%	16/04/2049	851.787	0,58
315.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 4 [*]	4,22%	27/01/2024	340.977	0,23
272.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 4 [*]	4,72%	27/09/2028	319.895	0,22
275.000	SEPLAT Energy Plc [*]	7,75%	01/04/2026	287.514	0,20
200.000	Shanghai Port Group BVI Development Co Ltd [*]	2,85%	11/09/2029	209.133	0,14

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)

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 98,73% (31 de diciembre de 2020: 91,88%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
520.000	Shinhan Bank Co Ltd [*]	4,00%	23/04/2029	582.183	0,40
327.000	Shinhan Bank Co Ltd [*]	4,50%	26/03/2028	373.901	0,25
446.000	Shinhan Financial Group Co Ltd [*]	5,88%	29/12/2049	478.777	0,33
400.000	Shriram Transport Finance Co Ltd [*]	4,40%	13/03/2024	401.900	0,27
200.000	Shriram Transport Finance Co Ltd [*]	5,10%	16/07/2023	203.600	0,14
200.000	Siam Commercial Bank PCL [*]	4,40%	11/02/2029	229.446	0,16
800.000	SierraCol Energy Andina LLC ^{**}	6,00%	15/06/2028	810.760	0,55
200.000	Sigma Alimentos SA de CV [*]	4,13%	02/05/2026	218.499	0,15
500.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd [*]	2,30%	08/01/2031	499.097	0,34
208.000	SK Battery America Inc [*]	2,13%	26/01/2026	206.247	0,14
366.000	SK Hynix Inc [*]	2,38%	19/01/2031	357.141	0,24
500.000	Southern Copper Corp [*]	6,75%	16/04/2040	714.005	0,49
455.000	State Agency of Roads of Ukraine [*]	6,25%	24/06/2028	455.839	0,31
275.000	StoneCo Ltd ^{**}	3,95%	16/06/2028	274.731	0,19
200.000	Studio City Finance Ltd [*]	6,00%	15/07/2025	210.550	0,14
800.000	Studio City Finance Ltd [*]	6,50%	15/01/2028	858.964	0,59
200.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd [*]	3,75%	25/02/2029	219.969	0,15
254.000	Sunac China Holdings Ltd [*]	6,50%	26/01/2026	244.849	0,17
650.000	Sunac China Holdings Ltd [*]	7,00%	09/07/2025	639.634	0,44
350.000	Sunac China Holdings Ltd [*]	8,35%	19/04/2023	362.373	0,25
371.000	Suzano Austria GmbH [*]	5,00%	15/01/2030	420.807	0,29
276.000	Suzano Austria GmbH ^{**}	7,00%	16/03/2047	373.598	0,25
229.000	Telecom Argentina SA ^{**}	8,00%	18/07/2026	216.405	0,15
390.000	Telefonica Celular del Paraguay SA ^{**}	5,88%	15/04/2027	410.280	0,28
283.000	Tencent Holdings Ltd [*]	3,24%	03/06/2050	277.814	0,19
400.000	Tencent Holdings Ltd [*]	3,60%	19/01/2028	438.531	0,30
429.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd ^{**}	3,25%	15/08/2030	436.617	0,30
1.295.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV [*]	3,15%	01/10/2026	1.233.487	0,84
560.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV ^{**}	7,13%	31/01/2025	618.142	0,42
710.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd [*]	3,75%	18/06/2050	679.963	0,46
339.000	TNB Global Ventures Capital Bhd [*]	4,85%	01/11/2028	395.654	0,27
200.000	Total Play Telecomunicaciones SA de CV ^{**}	7,50%	12/11/2025	212.281	0,14
241.000	Transportadora de Gas del Sur SA [*]	6,75%	02/05/2025	227.815	0,16
216.000	Trust Fibra Uno [*]	6,39%	15/01/2050	253.520	0,17
200.000	Tullow Oil Plc ^{**}	7,00%	01/03/2025	178.300	0,12
301.000	Tullow Oil Plc [*]	10,25%	15/05/2026	316.651	0,22
200.000	Turk Telekomunikasyon AS [*]	6,88%	28/02/2025	220.488	0,15

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)

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 98,73% (31 de diciembre de 2020: 91,88%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
400.000	Turkcell İletişim Hizmetleri AS*	5,80%	11/04/2028	425.085	0,29
300.000	Türkiye Garanti Bankası AS*	5,88%	16/03/2023	313.512	0,21
245.000	Türkiye İş Bankası AS*	6,13%	25/04/2024	254.786	0,17
400.000	Türkiye Petrol Rafinerileri AS*	4,50%	18/10/2024	400.720	0,27
302.000	Türkiye Sınai Kalkınma Bankası AS*	6,00%	23/01/2025	306.934	0,21
615.000	Türkiye Sise ve Cam Fabrikaları AS*	6,95%	14/03/2026	682.412	0,46
354.000	Türkiye Vakıflar Bankası TAO*	6,50%	08/01/2026	361.837	0,25
263.000	Ulker Bisküvi Sanayi AS*	6,95%	30/10/2025	285.689	0,19
600.000	Ultrapar International SA*	5,25%	06/06/2029	646.869	0,44
656.000	Unigel Luxembourg SA*	8,75%	01/10/2026	712.127	0,49
200.000	United Bank for Africa Plc*	7,75%	08/06/2022	206.463	0,14
400.000	United Overseas Bank Ltd*	2,00%	14/10/2031	400.648	0,27
300.000	United Overseas Bank Ltd*	3,75%	15/04/2029	319.599	0,22
600.000	Usiminas International Sarl**	5,88%	18/07/2026	651.402	0,44
220.000	Vale Overseas Ltd*	6,88%	21/11/2036	301.831	0,21
337.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	8,95%	11/03/2025	331.505	0,23
200.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	13,88%	21/01/2024	219.579	0,15
582.000	Vedanta Resources Ltd*	7,13%	31/05/2023	540.102	0,37
697.000	VEON Holdings BV**	4,00%	09/04/2025	736.475	0,50
464.000	Volcan Compania Minera SAA*	4,38%	11/02/2026	460.877	0,31
300.000	Votorantim Cimentos International SA**	7,25%	05/04/2041	408.084	0,28
325.000	VTR Comunicaciones SpA**	5,13%	15/01/2028	340.975	0,23
371.000	VTR Finance NV**	6,38%	15/07/2028	394.590	0,27
200.000	West China Cement Ltd*	4,95%	08/07/2026	202.750	0,14
300.000	Woori Bank*	4,75%	30/04/2024	329.852	0,22
300.000	Wynn Macau Ltd*	4,88%	01/10/2024	303.924	0,21
450.000	Wynn Macau Ltd*	5,50%	15/01/2026	472.259	0,32
750.000	XP Inc**	3,25%	01/07/2026	742.500	0,51
300.000	Yapi ve Kredi Bankası AS*	8,25%	15/10/2024	326.971	0,22
450.000	YPF SA**	7,00%	15/12/2047	295.832	0,20
740.000	YPF SA*	8,50%	23/03/2025	661.379	0,45
285.000	YPF SA*	8,50%	28/07/2025	225.934	0,15
560.000	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd*	3,13%	16/07/2025	560.701	0,38
Total dólar estadounidense				144.378.730	98,36
Total bonos de empresa				144.918.703	98,73

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)

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 del Estado 2,53% (31 de diciembre de 2020: 1,69%)					
Euro					
194.000	Argentine Republic Government International Bond*	0,13%	09/07/2030	78.918	0,05
6.298	Argentine Republic Government International Bond*	0,50%	09/07/2029	2.822	0,00
588.000	Republic of Cameroon International Bond*	5,95%	07/07/2032	697.309	0,48
200.000	Ukraine Government International Bond**	6,75%	20/06/2026	258.637	0,18
Total euro				1.037.686	0,71
Dólar estadounidense					
254.000	Airport Authority*	2,40%	29/12/2049	253.215	0,17
579.253	Argentine Republic Government International Bond*	0,13%	09/07/2030	208.942	0,14
439.246	Argentine Republic Government International Bond*	0,13%	09/07/2035	140.124	0,10
815.685	Argentine Republic Government International Bond*	0,13%	09/01/2038	309.414	0,21
652.025	Argentine Republic Government International Bond*	0,13%	09/07/2041	233.751	0,16
107.488	Argentine Republic Government International Bond*	1,00%	09/07/2029	40.972	0,03
479.000	Korea Resources Corp*	1,75%	15/04/2026	481.242	0,33
600.000	Turk Ihracat Kredi Bankasi AS*	5,75%	06/07/2026	596.310	0,41
392.000	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*	5,38%	24/10/2023	402.584	0,27
Total dólar estadounidense				2.666.554	1,82
Total bonos del Estado				3.704.240	2,53
Total inversiones				148.622.943	101,26

Contratos de divisas a plazo 0,22% (31 de diciembre de 2020: 0,62%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
2.099.999 CNY	322.618 USD	09/07/2021	Goldman Sachs International	1	2.240	0,00
1.451.996 USD	1.187.360 €	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	43.787	0,03
Clases CHF con cobertura						
828.633 USD	758.500 CHF	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	7.677	0,01
36.410 USD	33.081 CHF	15/09/2021	Westpac Banking Corp	3	549	0,00
Clases EUR con cobertura						
10.344.986 USD	8.493.267 €	15/09/2021	UBS AG	1	256.892	0,17
50.105 USD	41.904 €	15/09/2021	Westpac Banking Corp	5	332	0,00
406.851 USD	335.635 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	28	8.677	0,01
Clases GBP con cobertura						
303.045 USD	213.984 £	15/09/2021	UBS AG	1	7.387	0,00
19.323 USD	13.661 £	15/09/2021	Westpac Banking Corp	2	448	0,00

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,22% (31 de diciembre de 2020: 0,62%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases SEK con cobertura						
2 SEK	0 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
59.134 USD	495.789 SEK	19/07/2021	Westpac Banking Corp	12	1.153	0,00
44.847 USD	381.975 SEK	15/09/2021	Westpac Banking Corp	3	151	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					329.293	0,22
					Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados					148.952.236	101,48

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (2,32%) (31 de diciembre de 2020: (0,11%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
6.600.000 CNY	1.029.084 USD	09/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(8.100)	(0,00)
337.512 €	411.676 USD	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(11.387)	(0,01)
1.470.624 USD	9.692.935 CNY	09/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(28.820)	(0,02)
Clases CHF con cobertura						
467.652 CHF	520.446 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(14.288)	(0,01)
40.889.721 CHF	45.770.966 USD	15/09/2021	UBS AG	2	(1.444.287)	(0,98)
325.050 CHF	363.210 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	(11.395)	(0,01)
250 CHF	280 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	(9)	(0,00)
Clases EUR con cobertura						
294.903 €	357.894 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(8.042)	(0,01)
60.809.606 €	74.067.438 USD	15/09/2021	UBS AG	1	(1.839.283)	(1,25)
428.078 €	519.666 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	9	(11.826)	(0,01)
13.079 €	15.638 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	2	(103)	(0,00)
18.187 USD	15.314 €	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	(3)	(0,00)
Clases GBP con cobertura						
914 £	1.291 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(28)	(0,00)
368.005 £	521.172 USD	15/09/2021	UBS AG	2	(12.704)	(0,01)
844 £	1.177 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(11)	(0,00)
Clases SEK con cobertura						
5.390.295 SEK	652.430 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	2	(21.695)	(0,01)
10.400 SEK	1.250 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	2	(33)	(0,00)
209.772 SEK	25.057 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	14	(525)	(0,00)

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (2,32%) (31 de diciembre de 2020: (0,11%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases SEK con cobertura (cont.)						
12.374 USD	105.979 SEK	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(20)	(0,00)
298 USD	2.572 SEK	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	(3)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					(3.412.562)	(2,32)

Contratos de futuros (0,21%) (31 de diciembre de 2020: (0,01%))

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(7)	Euro-Bund Future September 2021	(9.262)	(0,01)
(54)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2021	(48.453)	(0,03)
(45)	US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2021	(226.844)	(0,16)
(2)	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2021	(18.437)	(0,01)
Minusvalía latente total sobre contratos de futuros \pm		(302.996)	(0,21)

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	(3.715.558)	(2,53)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	145.236.678	98,95
Otro activo neto	1.542.247	1,05
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	146.778.925	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	109.406.134	71,05
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	39.216.809	25,47
\pm Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	(302.996)	(0,20)
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(3.083.269)	(2,00)
Total inversiones	145.236.678	94,32

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
1.606.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 2.30%, 08/01/2031	1.597.745
1.428.000	Comision Federal de Electricidad, 4.68%, 09/02/2051	1.428.000
1.121.000	SierraCol Energy Andina LLC, 6.00%, 15/06/2028	1.113.153
1.110.000	XP Inc, 3.25%, 01/07/2026	1.097.368
857.000	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS, 5.75%, 06/07/2026	852.389
700.000	Cosan SA, 5.50%, 20/09/2029	756.100
650.000	Petroleos del Peru SA, 5.63%, 19/06/2047	745.667
714.000	Volcan Compania Minera SAA, 4.38%, 11/02/2026	714.000
656.000	Unigel Luxembourg SA, 8.75%, 01/10/2026	698.640
588.000	Republic of Cameroon International Bond, 5.95%, 07/07/2032	697.309
695.000	CSN Resources SA, 4.63%, 10/06/2031	695.000
694.000	Minerva Luxembourg SA, 4.38%, 18/03/2031	687.074
667.000	Natura Cosmetics SA, 4.13%, 03/05/2028	667.000
656.000	Light Servicos de Eletricidade SA/Light Energia SA, 4.38%, 18/06/2026	656.000
655.000	State Agency of Roads of Ukraine, 6.25%, 24/06/2028	655.000
600.000	Usiminas International Sarl, 5.88%, 18/07/2026	651.900
639.000	Banco BTG Pactual SA, 2.75%, 11/01/2026	635.307
600.000	Ultrapar International SA, 5.25%, 06/06/2029	635.100
600.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd, 4.38%, 03/07/2029	634.848
638.000	Orbia Advance Corp SAB de CV, 2.88%, 11/05/2031	630.446

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas (cont.)

20 ventas de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
1.400.000	Altice Financing SA, 7.50%, 15/05/2026	1.454.268
1.428.000	Comision Federal de Electricidad, 4.68%, 09/02/2051	1.429.822
1.106.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 2.30%, 08/01/2031	1.104.473
779.000	Banco de Credito e Inversiones SA, 3.50%, 12/10/2027	834.583
717.000	GUSAP III LP, 4.25%, 21/01/2030	771.516
600.000	CNOOC Petroleum North America ULC, 5.88%, 10/03/2035	768.600
650.000	Petroleos del Peru SA, 5.63%, 19/06/2047	751.075
600.000	United Overseas Bank Ltd, 3.75%, 15/04/2029	640.246
579.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA, 4.20%, 29/01/2030	626.768
450.000	Southern Copper Corp, 6.75%, 16/04/2040	622.125
562.000	NBM US Holdings Inc, 7.00%, 14/05/2026	607.146
555.000	Arab Republic of Egypt, 7.50%, 16/02/2061	557.775
500.000	Baidu Inc, 3.63%, 06/07/2027	551.118
549.000	Total Play Telecomunicaciones SA de CV, 7.50%, 12/11/2025	546.828
543.000	Comision Federal de Electricidad, 3.35%, 09/02/2031	535.864
500.000	JBS Investments II GmbH, 7.00%, 15/01/2026	532.050
550.000	MTR Corp Ltd, 1.63%, 19/08/2030	528.343
500.000	VF Ukraine PAT via VFU Funding Plc, 6.20%, 11/02/2025	523.507
537.000	Republic of Armenia International Bond, 3.60%, 02/02/2031	520.871
500.000	Turkiye Garanti Bankasi AS, 5.25%, 13/09/2022	516.900

Neuberger Berman Strategic Income Fund

Informe del Gestor de inversiones

Durante el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 (el "periodo analizado"), la rentabilidad total de la Clase de Acumulación USD I se situó en el 2,40%. En el mismo periodo, el índice de referencia, el Bloomberg Barclays US Aggregate Index (Total Return, USD) (el "Índice"), rindió un -1,60%. (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).

Los mercados de renta fija sufrieron altibajos en el primer semestre del año. Los mercados se pusieron a prueba en el primer trimestre, con una pronunciada caída de las rentabilidades de los bonos de deuda pública provocada por el creciente optimismo con respecto al ritmo de la recuperación económica, el aumento de la inflación (tanto materializada como esperada) y la magnitud de los futuros estímulos fiscales. En el segundo trimestre asistimos a un cambio de tendencia en la deuda pública, con las rentabilidades de las economías del G4 entre estables y más bajas y un continuo estrechamiento de los diferenciales de crédito. Dicho esto, las rentabilidades de los bonos de deuda pública a plazo intermedio avanzaron durante el periodo analizado —lo que supuso un viento de cara para los títulos más sensibles a los tipos—, mientras que los diferenciales de crédito se contrajeron.

Durante el periodo analizado, la posición infraponderada en duración y las exposiciones a crédito diversificado de la cartera fueron el principal motor de la rentabilidad relativa superior. En crédito, la asignación al segmento de alta rentabilidad, la selección de títulos de crédito con grado de inversión ("IG") y las asignaciones a títulos del Tesoro estadounidense protegidos frente a la inflación, las transferencias de riesgo de crédito, los préstamos bancarios y los CLO realizaron contribuciones destacadas a la rentabilidad. La selección de valores en títulos con garantía hipotecaria emitidos por agencia y la exposición a títulos híbridos del sector financiero, bonos municipales y deuda de mercados emergentes también favorecieron a los resultados. Por el contrario, el posicionamiento en la curva de tipos y la selección de valores de crédito IG fue lo que más la perjudicó.

Creemos probable que la volatilidad del mercado aumente en el segundo semestre del año. Prevemos una retirada gradual de estímulos y un giro de política de la Reserva Federal (la "Fed") y del BCE en el segundo semestre de 2021, lo cual obligará a los mercados a adaptarse a una política monetaria menos acomodaticia incluso con una comunicación y previsión perfectas de los bancos centrales. En segundo lugar, es probable que los mercados se muestren más reactivos a los datos económicos reales. Un avance significativo, tanto al alza como a la baja, del crecimiento y la inflación probablemente afectaría a la trayectoria de la política de los bancos centrales.

Por otra parte, se ha reducido la probabilidad de unos resultados económicos de "cola derecha". De la reunión de la Fed celebrada en junio se desprende que no es deseable permanecer mucho tiempo con tasas de inflación superiores al 3,5%. Por consiguiente, invertir durante periodos prolongados de inflación notablemente superior al 2% probablemente no tenga sentido, dado que la Fed ha definido su umbral de tolerancia de aumento de la inflación, incluso en el contexto de su nuevo marco del objetivo de inflación media. Cuando la Fed comience finalmente a subir los tipos, puede que el ritmo sea más fuerte de lo que se espera actualmente, dependiendo del nivel y de la evolución de la inflación.

Aunque el cambio de tono de la Fed fue el principal acontecimiento en los mercados de renta fija en el primer semestre del año, el segundo semestre debería representar una especie de punto de inflexión para la zona euro a medida que se normalice la actividad. Los sectores de servicios europeos han reabierto gradualmente a medida que se ha ido controlando la pandemia. Desde julio, el Euro Recovery Fund comenzará a repartir "becas" a países específicos para financiar el gasto en activos fijos durante los próximos trimestres. Además, el BCE ha introducido un nuevo mecanismo de flexibilidad en su programa de compras de bonos, que debería permitirle iniciar sin contratiempos la retirada gradual del Programa de Compras de Emergencia frente a la Pandemia ("PEPP").

Prevemos un entorno constante en el que los tipos de interés se moverán de manera dentro de una banda, con un sesgo alcista en respuesta a una recuperación económica mundial duradera. Prevemos que las tasas de equilibrio de la inflación estadounidense se negociarán en un rango más estrecho; una conclusión duradera probable que cabría extraer de la reunión de la Fed en junio es que la probabilidad de que la Fed tolere un movimiento alcista más estructural de las tasas de inflación es bastante baja. También es importante destacar que, en nuestra opinión, los detonantes subyacentes de los estrechos diferenciales de crédito, el fuerte crecimiento económico y las bajas tasas de impago probablemente no se vean demasiado afectados por la evolución del panorama de los bancos centrales.

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		1.275.578.280	1.339.893.125
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	295.776.367	187.942.925
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		10.613.560	5.095.274
Cuentas a percibir por acciones emitidas		2.967.198	4.905.111
Cuentas por cobrar de intermediarios		8.699.307	–
Ingresos a percibir y otros activos		11.781.287	10.153.962
Activos totales		1.605.415.999	1.547.990.397
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		12.149.487	1.548.993
Descubierto bancario	3	193.800	520
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		6.068.159	2.769.975
Adeudado a los intermediarios		1.090.000	2.915.785
Gastos devengados		1.134.224	971.082
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		221.646.716	304.479.533
Otras cuentas por pagar		169.920	517.174
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		242.452.306	313.203.062
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		1.362.963.693	1.234.787.335

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		26.017.114	25.818.211
Ingresos por dividendos		12.236	–
Ingresos por préstamo de valores	15	10.752	3.103
Ingresos varios		58.388	72.616
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(12.288.903)	(50.444.875)
		13.809.587	(24.550.945)
Gastos			
Comisión de gestión	5	4.396.601	4.456.308
Comisión de distribución	5	596.250	542.903
Comisión de administración	5	638.129	845.231
Comisión de compromiso	16	89.982	74.687
Comisión de depósito	5	25.170	30.983
Comisión del Depositario	5	31.845	64.373
Honorarios profesionales	7	96.456	62.157
Honorarios de los Consejeros	6	1.947	2.380
Costes de transacciones	7	122.872	129.910
Honorarios de auditoría	7	33.728	22.632
Reembolso de IVA		(5.766)	(4.416)
Otros gastos	7	8.757	36.525
Gastos no asumidos	5	–	(11)
Gastos totales		6.035.971	6.263.662
Costes financieros			
Gastos por intereses		276	529
Repartos de dividendos abonados	1	8.066.608	5.157.131
		8.066.884	5.157.660
Impuestos retenidos en origen		219.538	127.386
Impuesto sobre las plusvalías		(41.582)	(4.833)
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		(471.224)	(36.094.820)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	1.234.787.335	1.442.746.695
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	(471.224)	(36.094.820)
Suscripciones	259.431.951	237.342.285
Reembolsos	(130.784.369)	(501.356.964)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	1.362.963.693	1.142.637.196

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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 Tesoro 0,59% (31 de diciembre de 2020: 0,88%)					
Dólar estadounidense					
8.100.000	United States Treasury Bill	0,01%	02/12/2021	8.098.383	0,59
Total bonos del Tesoro **				8.098.383	0,59
Bonos de agencia 0,08% (31 de diciembre de 2020: 0,09%)					
Dólar estadounidense					
690.000	Federal National Mortgage Association	5,63%	15/07/2037	1.050.383	0,08
Total bonos de agencia **				1.050.383	0,08
Valores respaldados por activos 6,47% (31 de diciembre de 2020: 10,05%)					
Dólar estadounidense					
459.585	Bear Stearns Asset Backed Securities Trust 2005-SD2 Class 2M2	1,59%	25/12/2044	459.013	0,03
21.664.215	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC25 Class XA	1,11%	10/10/2047	580.516	0,04
16.833.505	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 Class XA	1,48%	10/02/2048	675.192	0,05
6.170.457	COMM 2014-CCRE16 Mortgage Trust Class XA	1,13%	10/04/2047	148.195	0,01
8.824.445	COMM 2014-CCRE17 Mortgage Trust Class XA	1,12%	10/05/2047	196.418	0,01
24.624.024	COMM 2014-LC15 Mortgage Trust Class XA	1,23%	10/04/2047	571.268	0,04
1.837.763	COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust Class XA	1,23%	10/06/2047	47.797	0,00
15.524.485	COMM 2014-UBS6 Mortgage Trust Class XA	1,03%	10/12/2047	372.901	0,03
1.753.302	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2	2,29%	25/01/2030	1.783.092	0,13
6.977.332	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2	2,34%	25/07/2030	7.081.316	0,52
7.593.756	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2	2,44%	25/01/2031	7.693.229	0,56
7.077.378	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2	3,09%	25/10/2029	7.304.746	0,54
1.725.925	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2	2,29%	25/08/2030	1.746.519	0,13
2.961.515	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2	2,64%	25/12/2030	3.017.728	0,22
6.078.959	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2	2,89%	25/02/2030	6.222.101	0,46
5.327.091	Fannie Mae Interest Strip Class C24	4,00%	25/08/2043	866.267	0,06
4.297.553	Fannie Mae Interest Strip Class C26	4,00%	25/10/2041	633.910	0,05
4.300.137	Fannie Mae REMICS Class DS	6,06%	25/06/2043	887.342	0,07
3.000.086	Fannie Mae REMICS Class HS	5,91%	25/06/2046	581.196	0,04
4.622.730	Fannie Mae REMICS Class SA	5,91%	25/09/2046	1.065.521	0,08
2.923.583	Fannie Mae REMICS Class SB	6,01%	25/03/2046	597.055	0,04
4.554.383	Fannie Mae REMICS Class SN	6,01%	25/07/2049	887.670	0,07
5.184.586	Fannie Mae REMICS Class ST	6,01%	25/12/2044	1.149.068	0,08
4.879.844	Fannie Mae REMICS Class SY	6,06%	25/07/2043	862.515	0,06
3.293.340	Freddie Mac REMICS Class BI	4,50%	25/02/2050	613.557	0,04
2.589.511	Freddie Mac REMICS Class LI	4,00%	25/12/2048	482.919	0,04

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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
Valores respaldados por activos (ABS) 6,47% (31 de diciembre de 2020: 10,05%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
1.797.748	Freddie Mac REMICS Class SA	5,93%	15/10/2046	385.911	0,03
2.506.781	Freddie Mac REMICS Class SA	6,08%	15/03/2045	561.378	0,04
3.775.955	Freddie Mac REMICS Class SP	6,08%	15/01/2043	859.652	0,06
670.000	Freddie Mac STACR Trust Class M2	2,24%	25/12/2030	678.260	0,05
1.974.226	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2	1,89%	25/07/2030	1.988.180	0,15
4.177.366	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2	2,39%	25/09/2030	4.242.214	0,31
4.809.128	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2	2,44%	25/04/2030	4.922.467	0,36
10.605.000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2	2,59%	25/03/2030	10.853.123	0,80
3.423.499	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2	3,34%	25/07/2029	3.550.219	0,26
8.650.000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2	3,54%	25/10/2029	9.046.708	0,66
4.830.142	Government National Mortgage Association Class HS	6,11%	20/10/2045	957.180	0,07
4.323.256	Government National Mortgage Association Class KS	6,11%	20/07/2047	890.211	0,07
2.517.654	Government National Mortgage Association Class SA	6,03%	16/12/2043	461.934	0,03
23.034.526	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC18 Class XA	1,17%	10/01/2047	482.663	0,04
12.911.268	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC26 Class XA	1,11%	10/11/2047	344.323	0,03
10.467.384	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC30 Class XA	0,88%	10/05/2050	258.325	0,02
295.497	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2004-DO1 Class M1	1,07%	25/07/2034	294.484	0,02
10.248.964	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 Class XA	1,18%	15/08/2047	260.894	0,02
16.952.306	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C22 Class XA	0,95%	15/09/2057	350.019	0,03
7.637.250	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14 Class XA	1,43%	15/03/2047	205.692	0,02
Total valores respaldados por activos **				88.120.888	6,47
Bonos de empresa 48,62% (31 de diciembre de 2020: 50,01%)					
Euro					
1.000.000	Accor SA*	2,63%	29/12/2049	1.159.383	0,08
100.000	Aedas Homes Opco SLU*	4,00%	15/08/2026	121.248	0,01
100.000	Afflelou SAS*	4,25%	19/05/2026	122.055	0,01
324.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl*	3,63%	01/06/2028	380.923	0,03
435.000	Altice Finco SA*	4,75%	15/01/2028	505.196	0,04
660.000	Altice France Holding SA*	4,00%	15/02/2028	751.321	0,05
210.000	Ashland Services BV**	2,00%	30/01/2028	252.258	0,02
215.000	Avis Budget Finance Plc**	4,75%	30/01/2026	260.405	0,02
420.000	Banijay Group SAS**	6,50%	01/03/2026	514.026	0,04
288.000	BK LC Lux Finco1 Sarl*	5,25%	30/04/2029	349.284	0,03
145.000	Brunello Bidco SpA*	3,50%	15/02/2028	171.869	0,01
265.000	Carnival Corp*	7,63%	01/03/2026	347.803	0,03
245.000	Carnival Corp**	10,13%	01/02/2026	338.644	0,02
700.000	Casino Guichard Perrachon SA*	4,50%	07/03/2024	843.652	0,06

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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 48,62% (31 de diciembre de 2020: 50,01%) (cont.)					
Euro (cont.)					
109.000	Cedacri Mergeco SpA*	4,63%	15/05/2028	130.233	0,01
265.000	Centurion Bidco SpA*	5,88%	30/09/2026	328.011	0,02
126.000	Chrome Holdco SASU*	5,00%	31/05/2029	153.355	0,01
205.000	Clarios Global LP/Clarios US Finance Co**	4,38%	15/05/2026	252.154	0,02
455.000	CMA CGM SA*	7,50%	15/01/2026	599.750	0,04
207.000	Constellium SE*	3,13%	15/07/2029	243.693	0,02
135.000	CPI Property Group SA*	4,88%	29/12/2049	169.030	0,01
850.000	Dufry One BV**	2,00%	15/02/2027	950.005	0,07
100.000	Dufry One BV*	3,38%	15/04/2028	117.681	0,01
455.000	eG Global Finance Plc*	4,38%	07/02/2025	533.584	0,04
100.000	eG Global Finance Plc*	6,25%	30/10/2025	121.768	0,01
135.000	Energizer Gamma Acquisition BV**	3,50%	30/06/2029	159.353	0,01
100.000	Flamingo Lux II SCA*	5,00%	31/03/2029	117.739	0,01
153.000	Foncia Management SASU**	3,38%	31/03/2028	180.298	0,01
167.000	Grupo Antolin-Irausa SA*	3,50%	30/04/2028	197.432	0,01
233.000	Guala Closures SpA*	3,25%	15/06/2028	277.433	0,02
270.000	House of HR**	7,50%	15/01/2027	340.849	0,02
200.000	Infineon Technologies AG*	3,63%	29/12/2049	260.405	0,02
120.000	International Design Group SpA*	4,25%	15/05/2026	143.717	0,01
580.000	Intrum AB*	3,00%	15/09/2027	678.666	0,05
300.000	IPD 3 BV*	5,50%	01/12/2025	369.893	0,03
280.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	4,50%	15/01/2026	352.621	0,03
355.000	Kapla Holding SAS*	3,38%	15/12/2026	419.333	0,03
285.000	Kleopatra Holdings 2 SCA*	6,50%	01/09/2026	328.703	0,02
275.000	Kronos International Inc**	3,75%	15/09/2025	333.435	0,02
295.000	La Financiere Atalian SASU*	4,00%	15/05/2024	348.621	0,03
180.000	Laboratoire Eimer Selas**	5,00%	01/02/2029	218.024	0,02
320.000	LeasePlan Corp NV*	7,38%	29/12/2049	424.078	0,03
280.000	Loxam SAS*	5,75%	15/07/2027	346.662	0,03
470.000	Maxeda DIY Holding BV**	5,88%	01/10/2026	571.348	0,04
100.000	Modulaire Global Finance Plc**	6,50%	15/02/2023	121.353	0,01
365.000	Motion Bondco DAC*	4,50%	15/11/2027	421.303	0,03
208.000	NH Hotel Group SA*	4,00%	02/07/2026	246.883	0,02
415.000	Nidda BondCo GmbH**	5,00%	30/09/2025	493.774	0,04
100.000	Novelis Sheet Ingot GmbH*	3,38%	15/04/2029	121.584	0,01
292.000	Ontex Group NV*	3,50%	15/07/2026	346.000	0,03
275.000	Paprec Holding SA*	4,00%	31/03/2025	332.645	0,02
308.000	Paysafe Finance Plc/Paysafe Holdings US Corp**	3,00%	15/06/2029	360.984	0,03

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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 48,62% (31 de diciembre de 2020: 50,01%) (cont.)					
Euro (cont.)					
100.000	PCF GmbH*	4,75%	15/04/2026	120.962	0,01
880.000	Petroleos Mexicanos*	4,75%	26/02/2029	1.033.979	0,08
114.000	Picard Bondco SA**	5,38%	01/07/2027	135.193	0,01
210.000	Platin 1426 GmbH**	5,38%	15/06/2023	251.315	0,02
205.000	Playtech Plc*	4,25%	07/03/2026	250.478	0,02
100.000	PLT VII Finance Sarl**	4,63%	05/01/2026	122.389	0,01
259.000	Repsol International Finance BV*	4,25%	29/12/2049	337.820	0,02
505.000	Sazka Group A/S**	3,88%	15/02/2027	603.323	0,04
200.000	Schaeffler AG*	3,38%	12/10/2028	261.239	0,02
135.000	Schoeller Packaging BV**	6,38%	01/11/2024	166.188	0,01
290.000	Scientific Games International Inc**	5,50%	15/02/2026	349.932	0,03
210.000	SGL Carbon SE*	4,63%	30/09/2024	254.954	0,02
280.000	Sofima Holding SpA*	3,75%	15/01/2028	333.384	0,02
200.000	SoftBank Group Corp*	4,00%	19/09/2029	249.966	0,02
100.000	SpA Holdings 3 Oy*	3,63%	04/02/2028	119.477	0,01
270.000	Sunshine Mid BV*	6,50%	15/05/2026	331.876	0,02
215.000	Tendam Brands SAU*	5,25%	15/09/2024	253.254	0,02
740.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	1,88%	31/03/2027	803.173	0,06
176.000	TI Automotive Finance Plc**	3,75%	15/04/2029	212.685	0,02
510.000	United Group BV**	3,63%	15/02/2028	587.117	0,04
200.000	Verisure Midholding AB*	5,25%	15/02/2029	243.648	0,02
530.000	Vertical Holdco GmbH**	6,63%	15/07/2028	669.323	0,05
400.000	Vivion Investments Sarl*	3,00%	08/08/2024	473.995	0,03
200.000	Wintershall Dea Finance 2 BV*	3,00%	29/12/2049	233.919	0,02
600.000	ZF Europe Finance BV*	3,00%	23/10/2029	745.793	0,05
Total euro				27.375.849	2,01
Libra esterlina					
100.000	AA Bond Co Ltd*	6,50%	31/01/2026	143.207	0,01
160.000	AA Bond Co Ltd*	6,50%	31/01/2026	229.131	0,02
200.000	Bellis Finco Plc**	4,00%	16/02/2027	276.290	0,02
355.000	CPUK Finance Ltd**	6,50%	28/08/2026	519.224	0,04
480.000	Encore Capital Group Inc*	5,38%	15/02/2026	698.739	0,05
300.000	Iceland Bondco Plc*	4,63%	15/03/2025	407.406	0,03
240.000	National Express Group Plc*	4,25%	29/12/2049	344.465	0,02
105.000	Petrobras Global Finance BV*	5,38%	01/10/2029	158.890	0,01
850.000	Pinnacle Bidco Plc*	6,38%	15/02/2025	1.202.585	0,09
137.000	Premier Foods Finance Plc*	3,50%	15/10/2026	189.191	0,01

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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 48,62% (31 de diciembre de 2020: 50,01%) (cont.)					
Libra esterlina (cont.)					
100.000	RAC Bond Co Plc*	5,00%	06/11/2022	138.163	0,01
700.000	Rolls-Royce Plc*	5,75%	15/10/2027	1.057.415	0,08
355.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC**	4,88%	15/07/2028	497.690	0,04
Total libra esterlina				5.862.396	0,43
Dólar estadounidense					
2.200.000	1MDB Global Investments Ltd**	4,40%	09/03/2023	2.218.659	0,16
1.165.000	ABJA Investment Co Pte Ltd*	5,45%	24/01/2028	1.248.868	0,09
275.000	Acadia Healthcare Co Inc**	5,00%	15/04/2029	287.570	0,02
965.000	Acadia Healthcare Co Inc**	5,50%	01/07/2028	1.032.111	0,08
450.000	Adani Electricity Mumbai Ltd*	3,95%	12/02/2030	450.216	0,03
995.000	ADT Security Corp**	4,88%	15/07/2032	1.052.113	0,08
791.000	AerCap Global Aviation Trust*	6,50%	15/06/2045	846.319	0,06
4.505.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust*	4,45%	01/10/2025	4.963.621	0,36
3.200.000	Air Lease Corp*	2,30%	01/02/2025	3.310.938	0,24
560.000	Akbank TAS**	6,80%	06/02/2026	592.320	0,04
2.265.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	6,75%	15/10/2027	2.383.301	0,18
1.175.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp**	6,00%	01/06/2029	1.192.754	0,09
1.075.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp**	6,63%	15/07/2026	1.141.091	0,08
800.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl**	4,63%	01/06/2028	802.595	0,06
590.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl**	4,63%	01/06/2028	592.867	0,04
835.000	Ally Financial Inc**	4,70%	29/12/2049	866.897	0,06
320.000	Ally Financial Inc**	4,70%	29/12/2049	324.896	0,02
3.610.000	Altice France Holding SA**	6,00%	15/02/2028	3.599.820	0,26
1.300.000	Altice France SA*	5,50%	15/01/2028	1.350.635	0,10
707.000	Altice France SA*	7,38%	01/05/2026	736.114	0,05
605.000	Altice France SA**	8,13%	01/02/2027	659.904	0,05
190.000	American Airlines Group Inc**	3,75%	01/03/2025	175.306	0,01
1.395.000	American Airlines Group Inc**	5,00%	01/06/2022	1.398.515	0,10
1.800.000	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,50%	20/04/2026	1.908.000	0,14
1.465.000	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,75%	20/04/2029	1.585.862	0,12
330.000	American Axle & Manufacturing Inc*	6,50%	01/04/2027	350.460	0,03
1.090.000	American Axle & Manufacturing Inc*	6,88%	01/07/2028	1.192.013	0,09
2.250.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc*	4,75%	15/04/2058	2.826.883	0,21
555.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	5,38%	15/06/2029	579.284	0,04
480.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	5,75%	01/03/2027	500.662	0,04
2.265.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	5,75%	15/01/2028	2.386.585	0,18
1.015.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	7,88%	15/05/2026	1.137.713	0,08

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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 48,62% (31 de diciembre de 2020: 50,01%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
490.000	APX Group Inc**	6,75%	15/02/2027	523.131	0,04
645.000	APX Group Inc**	7,63%	01/09/2023	663.544	0,05
130.000	APX Group Inc**	8,50%	01/11/2024	136.094	0,01
2.790.000	Aramark Services Inc**	5,00%	01/02/2028	2.925.175	0,21
1.145.000	Aramark Services Inc**	6,38%	01/05/2025	1.217.994	0,09
1.670.000	ArcelorMittal SA*	7,00%	01/03/2041	2.322.335	0,17
2.115.000	ArcelorMittal SA*	7,25%	15/10/2039	2.991.131	0,22
905.000	Archrock Partners LP/Archrock Partners Finance Corp**	6,25%	01/04/2028	946.549	0,07
875.000	Ascension Health**	3,11%	15/11/2039	937.258	0,07
655.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	5,88%	30/06/2029	655.819	0,05
1.265.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	7,00%	01/11/2026	1.327.776	0,10
245.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	8,25%	31/12/2028	269.990	0,02
347.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	9,00%	01/11/2027	480.895	0,04
2.130.000	AssuredPartners Inc**	5,63%	15/01/2029	2.134.260	0,16
740.000	AssuredPartners Inc**	7,00%	15/08/2025	758.378	0,06
2.745.000	AT&T Inc*	3,65%	01/06/2051	2.857.018	0,21
3.452.000	AT&T Inc*	4,50%	09/03/2048	4.078.672	0,30
817.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd*	6,75%	29/12/2049	961.172	0,07
2.585.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc**	4,75%	01/04/2028	2.652.598	0,19
535.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc**	5,38%	01/03/2029	557.831	0,04
1.200.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc**	5,75%	15/07/2027	1.259.814	0,09
1.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA*	6,50%	29/12/2049	1.090.000	0,08
540.000	Banco de Bogota SA*	6,25%	12/05/2026	591.994	0,04
800.000	Banco do Brasil SA*	6,25%	29/12/2049	817.816	0,06
445.000	Banco do Brasil SA*	9,00%	29/12/2049	496.442	0,04
90.000	Banco Mercantil del Norte SA*	6,75%	29/12/2049	97.051	0,01
1.000.000	Banco Santander SA*	7,50%	29/12/2049	1.101.280	0,08
445.000	Bangkok Bank PCL**	3,73%	25/09/2034	462.564	0,03
420.000	Bank of America Corp**	5,88%	29/12/2049	481.240	0,04
468.000	Bank of America Corp**	6,25%	29/12/2049	518.017	0,04
370.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	4,70%	22/10/2031	401.280	0,03
1.025.000	Barclays Plc*	6,13%	29/12/2049	1.137.104	0,08
3.760.000	BAT Capital Corp*	3,73%	25/09/2040	3.681.246	0,27
2.140.000	BAT Capital Corp*	4,91%	02/04/2030	2.460.966	0,18
1.170.000	Bausch Health Cos Inc**	5,00%	30/01/2028	1.111.687	0,08
455.000	Bausch Health Cos Inc**	5,50%	01/11/2025	467.399	0,03
3.578.000	Bausch Health Cos Inc**	6,13%	15/04/2025	3.671.923	0,27
465.000	BNP Paribas SA*	4,50%	29/12/2049	472.847	0,03

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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 48,62% (31 de diciembre de 2020: 50,01%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
914.000	BNP Paribas SA [*]	7,38%	29/12/2049	1.066.012	0,08
4.180.000	Boeing Co [*]	5,81%	01/05/2050	5.638.156	0,41
4.390.000	BP Capital Markets Plc [*]	4,88%	29/12/2049	4.831.195	0,35
2.755.000	Broadcom Inc ^{**}	3,50%	15/02/2041	2.821.942	0,21
3.030.000	Broadcom Inc ^{**}	4,15%	15/11/2030	3.401.242	0,25
75.000	Buckeye Partners LP ^{**}	3,95%	01/12/2026	76.530	0,01
805.000	Buckeye Partners LP ^{**}	4,13%	01/03/2025	836.810	0,06
365.000	Buckeye Partners LP ^{**}	4,13%	01/12/2027	371.617	0,03
50.000	Buckeye Partners LP ^{**}	4,15%	01/07/2023	51.831	0,00
545.000	Buckeye Partners LP ^{**}	4,35%	15/10/2024	571.909	0,04
2.065.000	Buckeye Partners LP ^{**}	4,50%	01/03/2028	2.121.395	0,16
1.405.000	Buckeye Partners LP ^{**}	5,60%	15/10/2044	1.368.997	0,10
240.000	Buckeye Partners LP ^{**}	5,85%	15/11/2043	239.225	0,02
1.420.000	C&W Senior Financing DAC ^{**}	6,88%	15/09/2027	1.520.181	0,11
530.000	Caesars Entertainment Inc ^{**}	6,25%	01/07/2025	562.462	0,04
1.860.000	Caesars Entertainment Inc ^{**}	8,13%	01/07/2027	2.071.017	0,15
2.600.000	Caesars Resort Collection LLC/CRC Finco Inc ^{**}	5,25%	15/10/2025	2.635.750	0,19
3.165.000	Calpine Corp ^{**}	4,50%	15/02/2028	3.232.256	0,24
2.307.000	Calpine Corp ^{**}	4,63%	01/02/2029	2.274.575	0,17
2.009.000	Calpine Corp ^{**}	5,00%	01/02/2031	2.002.973	0,15
460.000	Calpine Corp ^{**}	5,13%	15/03/2028	468.701	0,03
515.000	Capital One Financial Corp ^{**}	3,93%	29/12/2049	517.166	0,04
740.000	Capital One Financial Corp ^{**}	3,95%	29/12/2049	757.575	0,06
2.345.000	Carnival Corp ^{**}	5,75%	01/03/2027	2.459.319	0,18
1.535.000	Carnival Corp ^{**}	7,63%	01/03/2026	1.669.312	0,12
2.405.000	Carnival Corp ^{**}	9,88%	01/08/2027	2.810.880	0,21
500.000	Carnival Corp ^{**}	10,50%	01/02/2026	582.772	0,04
720.000	Cars.com Inc ^{**}	6,38%	01/11/2028	768.895	0,06
4.705.000	Carvana Co ^{**}	5,88%	01/10/2028	4.957.141	0,36
2.545.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp ^{**}	4,50%	15/08/2030	2.653.071	0,19
970.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp ^{**}	4,75%	01/03/2030	1.026.987	0,08
1.490.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp ^{**}	5,00%	01/02/2028	1.564.500	0,11
397.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp ^{**}	5,75%	15/02/2026	411.254	0,03
859.000	Cedar Fair LP ^{**}	5,25%	15/07/2029	886.651	0,07
1.300.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op [*]	5,38%	15/04/2027	1.340.930	0,10
1.515.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op ^{**}	5,50%	01/05/2025	1.583.175	0,12
215.000	Cemex SAB de CV ^{**}	5,20%	17/09/2030	237.050	0,02
250.000	Centene Corp ^{**}	5,38%	15/08/2026	261.599	0,02

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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 48,62% (31 de diciembre de 2020: 50,01%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
370.000	Charles Schwab Corp**	5,38%	29/12/2049	409.886	0,03
3.040.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	4,80%	01/03/2050	3.498.099	0,26
2.965.000	Cheniere Energy Partners LP**	4,50%	01/10/2029	3.191.081	0,23
535.000	CHS/Community Health Systems Inc**	4,75%	15/02/2031	537.675	0,04
300.000	CHS/Community Health Systems Inc**	5,63%	15/03/2027	320.644	0,02
330.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,00%	15/01/2029	353.537	0,03
2.580.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,13%	01/04/2030	2.621.925	0,19
160.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,63%	15/02/2025	169.398	0,01
2.185.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,88%	15/04/2029	2.292.906	0,17
1.560.000	CHS/Community Health Systems Inc**	8,00%	15/03/2026	1.682.873	0,12
1.312.000	CHS/Community Health Systems Inc**	8,00%	15/12/2027	1.461.378	0,11
510.000	Churchill Downs Inc**	5,50%	01/04/2027	532.629	0,04
360.000	Citigroup Inc**	4,70%	29/12/2049	372.141	0,03
297.000	Citigroup Inc**	5,00%	29/12/2049	311.583	0,02
294.000	Citizens Financial Group Inc**	6,00%	29/12/2049	307.048	0,02
393.000	Citizens Financial Group Inc**	6,38%	29/12/2049	418.545	0,03
1.125.000	Clarivate Science Holdings Corp**	4,88%	30/06/2029	1.155.937	0,08
346.000	Clear Channel Worldwide Holdings Inc**	5,13%	15/08/2027	355.614	0,03
305.000	Commercial Bank PSQC*	4,50%	29/12/2049	307.669	0,02
400.000	Commerzbank AG*	7,00%	29/12/2049	434.500	0,03
845.000	CommonSpirit Health**	4,19%	01/10/2049	974.024	0,07
3.860.000	Commonwealth Bank of Australia**	2,69%	11/03/2031	3.862.896	0,28
2.115.000	CommScope Inc**	6,00%	01/03/2026	2.235.449	0,16
1.875.000	CommScope Inc**	7,13%	01/07/2028	2.034.581	0,15
720.000	CommScope Inc**	8,25%	01/03/2027	770.436	0,06
130.000	CommScope Technologies LLC**	5,00%	15/03/2027	133.250	0,01
615.000	CommScope Technologies LLC**	6,00%	15/06/2025	628.837	0,05
725.000	Comstock Resources Inc**	5,88%	15/01/2030	740.406	0,05
1.659.000	Comstock Resources Inc**	6,75%	01/03/2029	1.769.290	0,13
1.035.000	Cornerstone Building Brands Inc**	6,13%	15/01/2029	1.112.149	0,08
565.000	Country Garden Holdings Co Ltd*	4,80%	06/08/2030	588.055	0,04
3.880.000	CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**	5,50%	15/06/2031	4.047.771	0,30
3.000.000	Credit Suisse Group AG**	3,09%	14/05/2032	3.097.321	0,23
310.000	Credit Suisse Group AG*	4,50%	29/12/2049	308.419	0,02
380.000	Credit Suisse Group AG*	5,10%	29/12/2049	392.825	0,03
800.000	Credit Suisse Group AG*	5,25%	29/12/2049	848.000	0,06
389.000	Credit Suisse Group AG*	6,38%	29/12/2049	433.916	0,03
369.000	Credit Suisse Group AG*	7,50%	29/12/2049	402.210	0,03

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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 48,62% (31 de diciembre de 2020: 50,01%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
195.000	CrownRock LP/CrownRock Finance Inc**	5,63%	15/10/2025	202.380	0,01
205.000	CSC Holdings LLC**	4,13%	01/12/2030	204.341	0,02
895.000	CSC Holdings LLC**	4,63%	01/12/2030	879.212	0,06
5.850.000	CSC Holdings LLC**	5,75%	15/01/2030	6.084.000	0,45
280.000	CSC Holdings LLC**	6,50%	01/02/2029	310.481	0,02
860.000	CSC Holdings LLC**	7,50%	01/04/2028	946.400	0,07
1.660.000	CSN Inova Ventures**	6,75%	28/01/2028	1.838.035	0,14
1.940.000	DaVita Inc**	4,63%	01/06/2030	1.997.172	0,15
730.000	DCP Midstream Operating LP*	5,13%	15/05/2029	807.701	0,06
195.000	DCP Midstream Operating LP*	5,60%	01/04/2044	215.432	0,02
525.000	DCP Midstream Operating LP**	5,63%	15/07/2027	598.663	0,04
465.000	DCP Midstream Operating LP**	5,85%	21/05/2043	432.345	0,03
650.000	Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC**	8,00%	01/02/2028	702.887	0,05
1.825.000	Delta Air Lines Inc*	7,38%	15/01/2026	2.142.780	0,16
662.000	Discover Financial Services**	5,50%	29/12/2049	711.624	0,05
1.005.000	DISH DBS Corp**	5,13%	01/06/2029	993.623	0,07
2.190.000	DISH DBS Corp**	7,38%	01/07/2028	2.359.462	0,17
1.320.000	DISH DBS Corp**	7,75%	01/07/2026	1.496.550	0,11
190.000	Dominion Energy Inc**	4,65%	29/12/2049	202.350	0,01
1.970.000	DT Midstream Inc**	4,13%	15/06/2029	2.002.663	0,15
500.000	Ecopetrol SA*	5,88%	28/05/2045	536.375	0,04
605.000	Ecopetrol SA*	7,38%	18/09/2043	747.299	0,05
1.720.000	Emirates NBD Bank PJSC*	6,13%	29/12/2049	1.853.300	0,14
1.135.000	Endo Dac/Endo Finance LLC/Endo Finco Inc**	5,88%	15/10/2024	1.119.621	0,08
780.000	Endure Digital Inc**	6,00%	15/02/2029	773.296	0,06
2.070.000	Energizer Holdings Inc**	4,75%	15/06/2028	2.125.372	0,16
4.780.000	Energy Transfer LP**	6,63%	29/12/2049	4.696.350	0,34
7.505.000	Energy Transfer LP**	7,13%	29/12/2049	7.767.675	0,57
1.590.000	Envision Healthcare Corp**	8,75%	15/10/2026	1.117.166	0,08
1.635.000	EPR Properties*	3,75%	15/08/2029	1.639.313	0,12
935.000	EPR Properties*	4,50%	01/06/2027	998.131	0,07
825.000	EPR Properties**	4,95%	15/04/2028	891.855	0,07
910.000	EQM Midstream Partners LP*	4,13%	01/12/2026	933.933	0,07
355.000	EQM Midstream Partners LP**	4,50%	15/01/2029	361.627	0,03
355.000	EQM Midstream Partners LP**	4,75%	15/01/2031	366.250	0,03
1.395.000	EQM Midstream Partners LP*	5,50%	15/07/2028	1.510.199	0,11
270.000	EQM Midstream Partners LP**	6,00%	01/07/2025	294.253	0,02
130.000	EQM Midstream Partners LP**	6,50%	01/07/2027	145.330	0,01

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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 48,62% (31 de diciembre de 2020: 50,01%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
2.675.000	EQT Corp*	3,90%	01/10/2027	2.868.937	0,21
845.000	EQT Corp*	5,00%	15/01/2029	943.316	0,07
415.000	ESH Hospitality Inc**	5,25%	01/05/2025	422.262	0,03
170.000	Everi Holdings Inc**	5,00%	15/07/2029	170.000	0,01
220.000	Fifth Third Bancorp**	4,50%	29/12/2049	239.250	0,02
441.000	Fifth Third Bancorp**	5,10%	29/12/2049	458.640	0,03
875.000	First Quantum Minerals Ltd**	6,88%	01/03/2026	916.440	0,07
1.770.000	First Quantum Minerals Ltd**	6,88%	15/10/2027	1.930.981	0,14
2.075.000	FirstEnergy Corp*	5,35%	15/07/2047	2.493.637	0,18
935.000	FirstEnergy Corp*	7,38%	15/11/2031	1.281.988	0,09
3.800.000	Ford Motor Co*	4,75%	15/01/2043	4.042.250	0,30
2.430.000	Ford Motor Co*	5,29%	08/12/2046	2.717.092	0,20
175.000	Ford Motor Co*	7,45%	16/07/2031	230.344	0,02
665.000	Ford Motor Co*	9,63%	22/04/2030	955.143	0,07
1.970.000	Ford Motor Credit Co LLC*	4,39%	08/01/2026	2.130.062	0,16
725.000	Ford Motor Credit Co LLC*	5,11%	03/05/2029	812.609	0,06
160.000	Freeport-McMoRan Inc*	4,13%	01/03/2028	167.200	0,01
160.000	Freeport-McMoRan Inc*	4,25%	01/03/2030	171.600	0,01
240.000	Freeport-McMoRan Inc*	5,00%	01/09/2027	254.188	0,02
590.000	Freeport-McMoRan Inc*	5,25%	01/09/2029	653.292	0,05
1.185.000	Freeport-McMoRan Inc*	5,40%	14/11/2034	1.432.855	0,11
2.690.000	Freeport-McMoRan Inc*	5,45%	15/03/2043	3.291.645	0,24
530.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,00%	01/05/2028	548.592	0,04
715.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,88%	15/10/2027	766.837	0,06
785.000	Frontier Communications Holdings LLC**	6,75%	01/05/2029	836.237	0,06
175.000	FS Luxembourg Sarl**	10,00%	15/12/2025	196.008	0,01
1.180.000	FXI Holdings Inc**	7,88%	01/11/2024	1.222.055	0,09
1.010.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd**	2,94%	30/09/2040	1.005.693	0,07
540.000	Garda World Security Corp**	4,63%	15/02/2027	543.788	0,04
1.245.000	Garda World Security Corp**	6,00%	01/06/2029	1.237.287	0,09
510.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	6,25%	15/05/2026	512.295	0,04
330.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	6,50%	01/10/2025	333.965	0,02
230.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	8,00%	15/01/2027	241.931	0,02
845.000	Georgetown University**	2,94%	01/04/2050	854.820	0,06
2.275.000	GFL Environmental Inc**	4,75%	15/06/2029	2.364.976	0,17
4.947.221	Global Aircraft Leasing Co Ltd**	6,50%	15/09/2024	4.978.265	0,37
280.000	Goldman Sachs Group Inc**	3,80%	29/12/2049	285.684	0,02
360.000	Goldman Sachs Group Inc**	4,95%	29/12/2049	385.690	0,03

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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 48,62% (31 de diciembre de 2020: 50,01%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
57.000	Goldman Sachs Group Inc**	5,50%	29/12/2049	62.666	0,00
1.795.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	5,00%	15/07/2029	1.881.609	0,14
1.060.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	9,50%	31/05/2025	1.186.140	0,09
660.000	Graham Packaging Co Inc**	7,13%	15/08/2028	713.005	0,05
800.000	Grupo Aval Ltd*	4,38%	04/02/2030	791.740	0,06
4.260.000	Grupo Bimbo SAB de CV*	4,70%	10/11/2047	5.019.031	0,37
1.485.000	GTCR AP Finance Inc**	8,00%	15/05/2027	1.586.715	0,12
935.000	Harsco Corp**	5,75%	31/07/2027	982.180	0,07
1.055.000	Harvest Midstream I LP**	7,50%	01/09/2028	1.147.840	0,08
1.015.000	HB Fuller Co*	4,25%	15/10/2028	1.050.525	0,08
1.505.000	HCA Inc*	5,38%	01/09/2026	1.733.760	0,13
1.795.000	HCA Inc*	5,63%	01/09/2028	2.129.319	0,16
240.000	HCA Inc*	5,88%	01/02/2029	290.519	0,02
160.000	HCA Inc*	7,69%	15/06/2025	195.000	0,01
376.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	5,75%	01/02/2029	392.508	0,03
415.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	6,00%	01/02/2031	440.419	0,03
340.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	6,25%	01/11/2028	362.187	0,03
310.000	Hilton Domestic Operating Co Inc**	4,88%	15/01/2030	331.545	0,02
690.000	Hilton Domestic Operating Co Inc**	5,75%	01/05/2028	748.415	0,06
1.655.000	Hilton Worldwide Finance LLC/Hilton Worldwide Finance Corp*	4,88%	01/04/2027	1.729.889	0,13
630.000	HSBC Holdings Plc*	4,00%	29/12/2049	641.812	0,05
560.000	HSBC Holdings Plc*	4,70%	29/12/2049	582.400	0,04
4.330.000	HSBC Holdings Plc**	6,00%	29/12/2049	4.817.125	0,35
781.000	HSBC Holdings Plc**	6,38%	29/12/2049	871.733	0,06
1.680.000	HUB International Ltd**	7,00%	01/05/2026	1.746.478	0,13
560.000	Hudbay Minerals Inc**	4,50%	01/04/2026	562.800	0,04
565.000	Hudbay Minerals Inc**	6,13%	01/04/2029	602.431	0,04
290.000	Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru**	6,38%	01/06/2028	306.312	0,02
235.000	Huntington Bancshares Inc**	5,63%	29/12/2049	273.775	0,02
508.000	Huntington Bancshares Inc**	5,70%	29/12/2049	528.320	0,04
515.000	IAA Inc**	5,50%	15/06/2027	541.636	0,04
425.000	IHS Netherlands Holdco BV**	8,00%	18/09/2027	462.187	0,03
775.000	Imola Merger Corp**	4,75%	15/05/2029	798.250	0,06
1.202.000	ING Groep NV*	5,75%	29/12/2049	1.332.339	0,10
589.000	ING Groep NV*	6,50%	29/12/2049	658.031	0,05
795.000	Intelligent Packaging Ltd Finco Inc/Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC**	6,00%	15/09/2028	828.911	0,06
275.000	Investment Energy Resources Ltd*	6,25%	26/04/2029	298.031	0,02
830.000	Iron Mountain Inc**	4,88%	15/09/2027	861.540	0,06

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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 48,62% (31 de diciembre de 2020: 50,01%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
780.000	Iron Mountain Inc**	4,88%	15/09/2029	806.208	0,06
615.000	Iron Mountain Inc**	5,00%	15/07/2028	640.307	0,05
2.465.000	Iron Mountain Inc**	5,25%	15/03/2028	2.584.676	0,19
390.000	Iron Mountain Inc**	5,25%	15/07/2030	413.367	0,03
2.225.000	Iron Mountain Inc**	5,63%	15/07/2032	2.389.806	0,18
980.000	ITT Holdings LLC**	6,50%	01/08/2029	999.600	0,07
275.000	JELD-WEN Inc**	4,63%	15/12/2025	280.845	0,02
800.000	JELD-WEN Inc**	4,88%	15/12/2027	832.976	0,06
390.000	JPMorgan Chase & Co**	4,60%	29/12/2049	404.644	0,03
263.000	JPMorgan Chase & Co**	4,63%	29/12/2049	264.756	0,02
449.000	JPMorgan Chase & Co**	5,00%	29/12/2049	474.851	0,03
2.630.000	KAR Auction Services Inc**	5,13%	01/06/2025	2.702.193	0,20
955.000	KazMunayGas National Co JSC*	5,75%	19/04/2047	1.196.071	0,09
2.475.000	Kraft Heinz Foods Co**	4,38%	01/06/2046	2.809.211	0,21
2.815.000	Kraft Heinz Foods Co**	4,88%	01/10/2049	3.424.692	0,25
520.000	Kraft Heinz Foods Co**	5,20%	15/07/2045	646.759	0,05
645.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC**	4,25%	01/07/2029	654.675	0,05
1.515.000	Level 3 Financing Inc**	4,63%	15/09/2027	1.577.062	0,12
550.000	Leviathan Bond Ltd*	6,13%	30/06/2025	604.185	0,04
485.000	Leviathan Bond Ltd*	6,50%	30/06/2027	538.036	0,04
1.500.000	Lions Gate Capital Holdings LLC**	5,50%	15/04/2029	1.578.817	0,12
695.000	Live Nation Entertainment Inc**	4,75%	15/10/2027	721.062	0,05
730.000	Live Nation Entertainment Inc**	4,88%	01/11/2024	743.140	0,05
1.630.000	Live Nation Entertainment Inc**	6,50%	15/05/2027	1.813.823	0,13
310.000	Lloyds Banking Group Plc**	7,50%	29/12/2049	363.475	0,03
964.000	Lloyds Banking Group Plc Series WI*	7,50%	29/12/2049	1.099.153	0,08
560.000	Lukoil Securities BV*	3,88%	06/05/2030	592.710	0,04
1.055.000	Lumen Technologies Inc**	5,38%	15/06/2029	1.072.144	0,08
495.000	Masonite International Corp**	5,38%	01/02/2028	526.168	0,04
515.000	Masonite International Corp**	5,75%	15/09/2026	534.668	0,04
1.160.000	Matador Resources Co**	5,88%	15/09/2026	1.196.366	0,09
2.870.000	MDC Holdings Inc*	6,00%	15/01/2043	3.702.228	0,27
525.000	Medco Bell Pte Ltd*	6,38%	30/01/2027	542.241	0,04
960.000	Melco Resorts Finance Ltd**	5,63%	17/07/2027	1.004.534	0,07
285.000	Metinvest BV*	7,65%	01/10/2027	317.020	0,02
895.000	Metinvest BV*	7,75%	17/10/2029	996.506	0,07
560.000	MHP SE*	7,75%	10/05/2024	609.654	0,04
470.000	Minera Mexico SA de CV**	4,50%	26/01/2050	527.425	0,04

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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 48,62% (31 de diciembre de 2020: 50,01%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
1.945.000	Morgan Stanley**	3,79%	29/12/2049	1.952.342	0,14
875.000	Mount Sinai Hospitals Group Inc**	3,74%	01/07/2049	966.771	0,07
2.640.000	MPH Acquisition Holdings LLC**	5,75%	01/11/2028	2.656.460	0,20
985.127	MV24 Capital BV*	6,75%	01/06/2034	1.092.876	0,08
390.000	Natura Cosmetics SA**	4,13%	03/05/2028	400.238	0,03
4.505.000	Natwest Group Plc*	3,03%	28/11/2035	4.517.839	0,33
775.000	Natwest Group Plc*	4,60%	29/12/2049	780.580	0,06
830.000	Natwest Group Plc*	6,00%	29/12/2049	927.176	0,07
1.150.000	NCL Corp Ltd**	3,63%	15/12/2024	1.112.079	0,08
1.270.000	NCL Corp Ltd**	5,88%	15/03/2026	1.333.138	0,10
1.345.000	NCL Finance Ltd**	6,13%	15/03/2028	1.413.474	0,10
650.000	Netflix Inc**	5,38%	15/11/2029	790.365	0,06
160.000	Netflix Inc**	5,88%	15/11/2028	196.594	0,01
160.000	Netflix Inc**	6,38%	15/05/2029	204.580	0,02
3.695.000	New Fortress Energy Inc**	6,50%	30/09/2026	3.780.170	0,28
1.125.000	New Fortress Energy Inc**	6,75%	15/09/2025	1.153.125	0,08
2.125.000	Newell Brands Inc**	6,00%	01/04/2046	2.695.520	0,20
770.000	Nielsen Co Luxembourg Sarl**	5,00%	01/02/2025	794.371	0,06
1.030.000	Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co**	5,63%	01/10/2028	1.089.127	0,08
1.350.000	Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co**	5,88%	01/10/2030	1.472.814	0,11
575.000	NOVA Chemicals Corp**	4,88%	01/06/2024	607.344	0,04
1.705.000	NOVA Chemicals Corp**	5,25%	01/06/2027	1.839.780	0,14
3.975.000	NRG Energy Inc**	3,63%	15/02/2031	3.911.201	0,29
250.000	NRG Energy Inc**	5,25%	15/06/2029	266.277	0,02
240.000	NRG Energy Inc*	7,25%	15/05/2026	249.413	0,02
460.000	NWD MTN Ltd*	4,13%	18/07/2029	478.962	0,04
3.340.000	Occidental Petroleum Corp*	3,20%	15/08/2026	3.374.653	0,25
3.450.000	Occidental Petroleum Corp*	3,50%	15/08/2029	3.466.974	0,25
1.830.000	Occidental Petroleum Corp*	4,30%	15/08/2039	1.751.310	0,13
3.275.000	ON Semiconductor Corp**	3,88%	01/09/2028	3.378.441	0,25
1.300.000	OneMain Finance Corp*	3,50%	15/01/2027	1.311.375	0,10
645.000	OneMain Finance Corp*	6,13%	15/03/2024	694.988	0,05
840.000	OneMain Finance Corp**	7,13%	15/03/2026	979.406	0,07
195.000	OneMain Finance Corp*	8,88%	01/06/2025	216.774	0,02
500.000	Open Text Corp**	5,88%	01/06/2026	518.615	0,04
546.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc/Ortho-Clinical Diagnostics SA**	7,38%	01/06/2025	588.487	0,04
675.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc/Ortho-Clinical Diagnostics SA**	7,25%	01/02/2028	738.619	0,05
506.000	Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp**	5,00%	15/08/2027	524.659	0,04

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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 48,62% (31 de diciembre de 2020: 50,01%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
1.330.000	Oztel Holdings SPC Ltd*	6,63%	24/04/2028	1.480.164	0,11
1.820.000	Pacific Gas & Electric Co*	3,30%	01/08/2040	1.647.505	0,12
3.565.000	Pacific Gas & Electric Co*	4,30%	15/03/2045	3.435.326	0,25
550.000	PDC Energy Inc**	5,75%	15/05/2026	575.262	0,04
870.000	Performance Food Group Inc**	5,50%	15/10/2027	915.523	0,07
130.000	Performance Food Group Inc**	6,88%	01/05/2025	139.027	0,01
460.000	Periama Holdings LLC*	5,95%	19/04/2026	498.036	0,04
850.000	Petrobras Global Finance BV*	5,60%	03/01/2031	953.063	0,07
762.400	Petroleos de Venezuela SA*	5,38%	12/04/2027	34.308	0,00
4.488.565	Petroleos de Venezuela SA*	6,00%	16/05/2024	201.985	0,01
2.302.978	Petroleos de Venezuela SA**	6,00%	15/11/2026	103.634	0,01
810.000	Petroleos Mexicanos*	6,35%	12/02/2048	691.404	0,05
2.170.000	Petroleos Mexicanos*	7,69%	23/01/2050	2.091.338	0,15
1.785.000	Pilgrim's Pride Corp**	4,25%	15/04/2031	1.851.938	0,14
3.518.000	Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp**	3,55%	15/12/2029	3.708.163	0,27
1.005.000	Post Holdings Inc**	4,50%	15/09/2031	1.004.598	0,07
660.000	Post Holdings Inc**	4,63%	15/04/2030	671.933	0,05
1.800.000	Post Holdings Inc**	5,50%	15/12/2029	1.934.433	0,14
1.660.000	Post Holdings Inc**	5,63%	15/01/2028	1.764.646	0,13
985.000	Post Holdings Inc**	5,75%	01/03/2027	1.031.788	0,08
705.000	Presidio Holdings Inc**	4,88%	01/02/2027	726.686	0,05
900.000	Presidio Holdings Inc**	8,25%	01/02/2028	982.053	0,07
335.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	3,38%	31/08/2027	325.369	0,02
3.385.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	5,75%	15/04/2026	3.748.211	0,28
3.025.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	6,25%	15/01/2028	3.221.686	0,24
550.000	QNB Finansbank AS*	6,88%	07/09/2024	597.162	0,04
3.205.000	QualityTech LP/QTS Finance Corp**	3,88%	01/10/2028	3.431.433	0,25
375.000	Radiate Holdco LLC/Radiate Finance Inc**	4,50%	15/09/2026	389.091	0,03
930.000	Radiate Holdco LLC/Radiate Finance Inc**	6,50%	15/09/2028	978.365	0,07
680.000	Range Resources Corp*	4,88%	15/05/2025	704.650	0,05
1.280.000	Range Resources Corp**	8,25%	15/01/2029	1.444.819	0,11
560.000	Range Resources Corp**	9,25%	01/02/2026	618.380	0,05
600.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	4,88%	01/06/2023	625.050	0,05
1.035.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	7,63%	15/06/2025	1.123.969	0,08
1.880.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	9,38%	01/04/2027	2.091.359	0,15
2.806.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	5,75%	15/01/2029	2.937.293	0,22
360.000	Resideo Funding Inc**	6,13%	01/11/2026	379.184	0,03
1.195.000	RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**	4,75%	15/10/2027	1.229.344	0,09

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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 48,62% (31 de diciembre de 2020: 50,01%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
510.000	Ritchie Bros Auctioneers Inc**	5,38%	15/01/2025	526.108	0,04
3.405.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	5,50%	01/04/2028	3.570.313	0,26
615.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	11,50%	01/06/2025	709.593	0,05
485.000	Rumo Luxembourg Sarl**	5,25%	10/01/2028	519.750	0,04
355.000	Sasol Financing USA LLC*	5,88%	27/03/2024	380.033	0,03
1.415.000	Science Applications International Corp**	4,88%	01/04/2028	1.489.040	0,11
571.000	Scientific Games International Inc**	5,00%	15/10/2025	591.074	0,04
2.250.000	Scientific Games International Inc**	7,00%	15/05/2028	2.461.950	0,18
775.000	Scientific Games International Inc**	8,25%	15/03/2026	832.141	0,06
510.000	Sealed Air Corp**	5,50%	15/09/2025	572.174	0,04
680.000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc**	9,50%	01/08/2025	730.160	0,05
1.872.000	Service Properties Trust**	3,95%	15/01/2028	1.769.957	0,13
618.000	Service Properties Trust**	4,95%	15/02/2027	616.854	0,05
525.000	Silgan Holdings Inc**	4,75%	15/03/2025	535.164	0,04
3.665.000	Sirius XM Radio Inc**	4,13%	01/07/2030	3.706.469	0,27
330.000	Sirius XM Radio Inc**	4,63%	15/07/2024	339.469	0,03
1.205.000	Sirius XM Radio Inc**	5,00%	01/08/2027	1.265.401	0,09
2.840.000	Sirius XM Radio Inc**	5,50%	01/07/2029	3.098.298	0,23
600.000	Six Flags Entertainment Corp**	4,88%	31/07/2024	606.750	0,04
2.085.000	Six Flags Entertainment Corp**	5,50%	15/04/2027	2.156.495	0,16
1.480.000	Six Flags Theme Parks Inc**	7,00%	01/07/2025	1.596.957	0,12
1.600.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB*	5,13%	29/12/2049	1.698.000	0,12
460.000	Societe Generale SA*	4,75%	29/12/2049	477.825	0,04
4.680.000	Southern Co**	4,00%	15/01/2051	4.960.800	0,36
1.120.000	Spirit AeroSystems Inc**	7,50%	15/04/2025	1.198.831	0,09
970.000	Sprint Capital Corp**	6,88%	15/11/2028	1.245.238	0,09
1.660.000	Sprint Capital Corp**	8,75%	15/03/2032	2.525.275	0,19
460.000	Sprint Corp**	7,63%	01/03/2026	562.410	0,04
510.000	SPX FLOW Inc**	5,88%	15/08/2026	528.271	0,04
675.000	SRS Distribution Inc**	4,63%	01/07/2028	691.031	0,05
375.000	SRS Distribution Inc**	6,13%	01/07/2029	386.786	0,03
1.385.000	SS&C Technologies Inc**	5,50%	30/09/2027	1.471.043	0,11
1.240.000	Standard Industries Inc**	4,38%	15/07/2030	1.282.414	0,09
410.000	Standard Industries Inc**	4,75%	15/01/2028	429.660	0,03
220.000	Standard Industries Inc**	5,00%	15/02/2027	228.113	0,02
670.000	Starwood Property Trust Inc**	3,63%	15/07/2026	675.863	0,05
475.000	State Oil Co of the Azerbaijan Republic*	6,95%	18/03/2030	599.757	0,04
545.000	Studio City Finance Ltd*	6,50%	15/01/2028	585.169	0,04

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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 48,62% (31 de diciembre de 2020: 50,01%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
350.000	Summer BC Bidco B LLC**	5,50%	31/10/2026	356.279	0,03
515.000	Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp*	5,75%	15/04/2025	474.513	0,03
575.000	Sunac China Holdings Ltd*	6,50%	26/01/2026	554.285	0,04
615.000	Sunac China Holdings Ltd*	7,00%	09/07/2025	605.192	0,04
445.000	Suzano Austria GmbH*	5,00%	15/01/2030	504.741	0,04
6.715.000	Synchrony Financial*	2,85%	25/07/2022	6.874.898	0,50
2.663.000	Sysco Corp*	6,60%	01/04/2050	4.143.969	0,30
665.000	Talen Energy Supply LLC**	7,25%	15/05/2027	621.359	0,05
10.000	Talen Energy Supply LLC**	7,63%	01/06/2028	9.371	0,00
1.260.000	Talen Energy Supply LLC**	10,50%	15/01/2026	912.713	0,07
399.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	5,50%	15/09/2024	405.458	0,03
1.575.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	5,50%	15/01/2028	1.604.705	0,12
320.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00%	01/03/2027	330.240	0,02
445.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00%	31/12/2030	463.828	0,03
1.240.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	7,50%	01/10/2025	1.361.917	0,10
80.000	Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp**	5,00%	15/01/2028	84.500	0,01
75.000	Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp**	5,38%	01/02/2027	78.324	0,01
70.000	Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp*	5,88%	15/04/2026	73.715	0,01
70.000	Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp**	6,50%	15/07/2027	76.080	0,01
70.000	Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp**	6,88%	15/01/2029	79.004	0,01
1.335.000	Taylor Morrison Communities Inc**	5,75%	15/01/2028	1.511.741	0,11
625.000	Taylor Morrison Communities Inc**	5,88%	15/06/2027	709.041	0,05
325.000	Taylor Morrison Communities Inc/Taylor Morrison Holdings II Inc**	5,63%	01/03/2024	353.233	0,03
1.370.000	Team Health Holdings Inc**	6,38%	01/02/2025	1.305.788	0,10
1.285.000	TechnipFMC Plc**	6,50%	01/02/2026	1.387.835	0,10
5.610.000	Tenet Healthcare Corp**	6,13%	01/10/2028	5.994.229	0,44
670.000	Tenet Healthcare Corp*	6,75%	15/06/2023	731.975	0,05
980.000	Terex Corp**	5,00%	15/05/2029	1.022.875	0,08
715.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*	3,15%	01/10/2026	681.038	0,05
525.000	T-Mobile USA Inc**	2,63%	15/02/2029	519.094	0,04
4.175.000	T-Mobile USA Inc**	2,88%	15/02/2031	4.148.906	0,30
4.015.000	T-Mobile USA Inc*	4,50%	15/04/2050	4.785.812	0,35
345.000	Toll Brothers Finance Corp*	4,35%	15/02/2028	379.769	0,03
1.790.000	TransDigm Inc*	5,50%	15/11/2027	1.868.313	0,14
1.780.000	TransDigm Inc**	6,25%	15/03/2026	1.880.125	0,14
955.000	TransDigm Inc*	6,38%	15/06/2026	990.545	0,07
2.045.000	TransDigm Inc*	7,50%	15/03/2027	2.178.130	0,16
1.060.000	Trivium Packaging Finance BV*	8,50%	15/08/2027	1.155.146	0,08

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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 48,62% (31 de diciembre de 2020: 50,01%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
855.000	Tronox Inc**	4,63%	15/03/2029	864.610	0,06
289.000	Truist Financial Corp*	5,05%	29/12/2049	299.115	0,02
220.000	Truist Financial Corp**	5,10%	29/12/2049	247.775	0,02
200.000	UBS Group AG*	4,38%	29/12/2049	204.840	0,02
1.516.000	UBS Group AG*	6,88%	29/12/2049	1.730.029	0,13
481.000	UniCredit SpA**	8,00%	29/12/2049	535.113	0,04
630.000	Unigel Luxembourg SA*	8,75%	01/10/2026	683.903	0,05
1.260.936	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust**	5,88%	15/10/2027	1.401.747	0,10
126.165	United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust**	4,88%	15/01/2026	133.990	0,01
4.105.000	United Airlines Inc**	4,38%	15/04/2026	4.254.545	0,31
560.000	United Airlines Inc**	4,63%	15/04/2029	580.300	0,04
500.000	United Rentals North America Inc*	5,25%	15/01/2030	548.360	0,04
830.000	Uniti Group LP/Uniti Fiber Holdings Inc/CSL Capital LLC**	7,13%	15/12/2024	859.050	0,06
1.820.000	Uniti Group LP/Uniti Fiber Holdings Inc/CSL Capital LLC**	7,88%	15/02/2025	1.954.007	0,14
3.545.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC**	6,50%	15/02/2029	3.558.808	0,26
970.000	USA Compression Partners LP/USA Compression Finance Corp**	6,88%	01/04/2026	1.018.432	0,07
210.000	USA Compression Partners LP/USA Compression Finance Corp**	6,88%	01/09/2027	224.759	0,02
1.430.000	ViacomCBS Inc**	4,95%	15/01/2031	1.725.352	0,13
2.645.000	Viatrix Inc**	4,00%	22/06/2050	2.802.021	0,21
434.000	VICI Properties LP/VICI Note Co Inc**	4,25%	01/12/2026	451.998	0,03
415.000	Virgin Media Finance Plc**	5,00%	15/07/2030	419.822	0,03
2.530.000	Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC*	5,00%	15/07/2028	2.589.721	0,19
785.000	Vistra Operations Co LLC**	4,38%	01/05/2029	789.906	0,06
3.445.000	Vistra Operations Co LLC**	5,00%	31/07/2027	3.541.047	0,26
405.000	Volcan Compania Minera SAA*	4,38%	11/02/2026	402.274	0,03
200.000	Votorantim Cimentos International SA**	7,25%	05/04/2041	272.056	0,02
610.000	Wells Fargo & Co**	3,90%	29/12/2049	631.914	0,05
426.000	Wells Fargo & Co**	5,90%	29/12/2049	459.281	0,03
115.000	Western Midstream Operating LP*	4,35%	01/02/2025	121.663	0,01
2.220.000	Western Midstream Operating LP*	5,30%	01/02/2030	2.492.771	0,18
625.000	Western Midstream Operating LP**	5,30%	01/03/2048	668.197	0,05
855.000	White Capital Buyer LLC**	6,88%	15/10/2028	916.248	0,07
65.000	William Carter Co**	5,63%	15/03/2027	68.578	0,01
1.405.000	Wyndham Hotels & Resorts Inc**	4,38%	15/08/2028	1.462.956	0,11
2.095.000	Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp**	5,25%	15/05/2027	2.256.210	0,17
2.541.000	Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp**	5,50%	01/03/2025	2.742.476	0,20
1.350.000	Wynn Macau Ltd*	5,50%	15/01/2026	1.416.778	0,10
Total dólar estadounidense				629.444.684	46,18
Total bonos de empresa				662.682.929	48,62

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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 del Estado 10,66% (31 de diciembre de 2020: 8,51%)					
Peso colombiano					
614.000.000	Colombian TES*	5,75%	03/11/2027	157.547	0,01
5.865.800.000	Colombian TES*	6,00%	28/04/2028	1.509.722	0,11
4.141.500.000	Colombian TES*	7,00%	30/06/2032	1.082.534	0,08
3.618.000.000	Colombian TES*	7,25%	18/10/2034	950.403	0,07
Total peso colombiano				3.700.206	0,27
Rupia indonesia					
33.706.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,13%	15/05/2028	2.321.931	0,17
12.889.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00%	15/09/2030	920.808	0,07
29.901.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,25%	15/05/2029	2.302.418	0,17
Total rupia indonesia				5.545.157	0,41
Peso mexicano					
13.160.000	Mexican Bonos*	7,75%	29/05/2031	698.190	0,05
7.140.000	Mexican Bonos*	7,75%	23/11/2034	378.722	0,03
12.960.000	Mexican Bonos*	7,75%	13/11/2042	669.700	0,05
37.410.000	Mexican Bonos*	8,50%	31/05/2029	2.069.422	0,15
Total peso mexicano				3.816.034	0,28
Sol peruano					
73.000	Peruvian Government International Bond*	6,95%	12/08/2031	21.426	0,00
Total sol peruano				21.426	0,00
Rublo ruso					
156.061.000	Russian Federal Bond - OFZ*	7,05%	19/01/2028	2.151.972	0,16
32.881.000	Russian Federal Bond - OFZ*	7,25%	10/05/2034	456.512	0,03
22.998.000	Russian Federal Bond - OFZ*	7,70%	23/03/2033	330.266	0,02
68.516.000	Russian Federal Bond - OFZ*	8,50%	17/09/2031	1.035.003	0,08
Total rublo ruso				3.973.753	0,29
Rand sudafricano					
15.963.990	Republic of South Africa Government Bond*	8,00%	31/01/2030	1.059.209	0,08
26.084.538	Republic of South Africa Government Bond*	8,25%	31/03/2032	1.666.703	0,12
7.770.492	Republic of South Africa Government Bond*	8,50%	31/01/2037	467.167	0,04
9.812.463	Republic of South Africa Government Bond*	9,00%	31/01/2040	602.422	0,04
Total rand sudafricano				3.795.501	0,28

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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 del Estado 10,66% (31 de diciembre de 2020: 8,51%) (cont.)					
Lira turca					
17.719.560	Turkey Government Bond*	11,70%	13/11/2030	1.574.619	0,12
9.265.311	Turkey Government Bond*	12,40%	08/03/2028	876.671	0,06
Total lira turca				2.451.290	0,18
Dólar estadounidense					
2.095.000	Angolan Government International Bond*	9,38%	08/05/2048	2.194.732	0,16
265.000	Bahrain Government International Bond*	5,45%	16/09/2032	263.898	0,02
350.000	Costa Rica Government International Bond*	7,00%	04/04/2044	363.129	0,03
195.000	Dominican Republic International Bond*	5,88%	30/01/2060	194.805	0,01
1.650.000	Dominican Republic International Bond*	6,85%	27/01/2045	1.870.688	0,14
420.000	Ecuador Government International Bond*	0,50%	31/07/2030	360.154	0,03
1.675.000	Egypt Government International Bond*	7,50%	16/02/2061	1.575.254	0,12
1.520.000	Egypt Government International Bond*	8,50%	31/01/2047	1.589.046	0,12
200.000	El Salvador Government International Bond*	9,50%	15/07/2052	197.500	0,01
440.000	Finance Department Government of Sharjah*	4,00%	28/07/2050	404.854	0,03
710.000	Ghana Government International Bond*	7,75%	07/04/2029	727.395	0,05
1.385.000	Ghana Government International Bond**	10,75%	14/10/2030	1.753.756	0,13
435.000	Indonesia Government International Bond*	5,25%	17/01/2042	543.307	0,04
559.195	Ivory Coast Government International Bond*	5,75%	31/12/2032	562.097	0,04
1.125.000	Ivory Coast Government International Bond*	6,13%	15/06/2033	1.184.090	0,09
860.000	Kenya Government International Bond**	6,88%	24/06/2024	947.969	0,07
970.000	Mongolia Government International Bond*	5,13%	07/04/2026	1.038.023	0,08
1.030.000	Nigeria Government International Bond*	7,88%	16/02/2032	1.112.467	0,08
610.000	Oman Government International Bond*	6,75%	17/01/2048	608.856	0,04
1.235.000	Oman Government International Bond*	7,00%	25/01/2051	1.260.206	0,09
360.000	Republic of Armenia International Bond*	3,60%	02/02/2031	341.327	0,03
1.660.000	Republic of South Africa Government International Bond*	5,65%	27/09/2047	1.696.769	0,12
465.000	Romanian Government International Bond*	5,13%	15/06/2048	570.836	0,04
380.000	Senegal Government International Bond*	6,25%	23/05/2033	401.714	0,03
105.000	Sri Lanka Government International Bond*	7,85%	14/03/2029	67.200	0,00
710.000	Turkey Government International Bond*	5,88%	26/06/2031	691.540	0,05
295.000	Turkey Government International Bond*	5,95%	15/01/2031	289.895	0,02
2.470.000	Ukraine Government International Bond*	7,25%	15/03/2033	2.579.547	0,19
12.969.435	United States Treasury Inflation Indexed Bonds*	0,13%	15/01/2030	14.247.981	1,05
9.094.169	United States Treasury Inflation Indexed Bonds*	0,25%	15/02/2050	10.314.860	0,76
20.337.768	United States Treasury Inflation Indexed Bonds*	0,50%	15/01/2028	22.814.556	1,67
5.015.462	United States Treasury Inflation Indexed Bonds*	1,00%	15/02/2046	6.566.048	0,48
12.064.174	United States Treasury Inflation Indexed Bonds*	1,00%	15/02/2048	16.119.532	1,18

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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 del Estado 10,66% (31 de diciembre de 2020: 8,51%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
18.530.000	United States Treasury Note/Bond [†]	1,25%	31/03/2028	18.606.002	1,37
4.835.000	United States Treasury Note/Bond [†]	1,88%	15/02/2051	4.615.914	0,34
3.055.000	United States Treasury Note/Bond [†]	2,00%	15/02/2050	3.002.254	0,22
3.136.300	Venezuela Government International Bond [†]	8,25%	13/10/2024	330.880	0,02
Total dólar estadounidense				122.009.081	8,95
Total bonos del Estado				145.312.448	10,66
Valores respaldados por hipotecas 15,15% (31 de diciembre de 2020: 24,35%)					
Dólar estadounidense					
18.895.000	Fannie Mae Pool	2,00%	01/07/2050	19.079.522	1,40
98.460.000	Fannie Mae Pool	2,50%	01/07/2051	101.844.563	7,47
32.815.000	Fannie Mae Pool	3,00%	01/07/2051	34.207.715	2,51
49.630.000	Ginnie Mae	2,50%	01/07/2051	51.363.173	3,77
Total valores respaldados por hipotecas **				206.494.973	15,15
Bonos emitidos por organismos municipales 1,40% (31 de diciembre de 2020: 3,01%)					
Dólar estadounidense					
565.000	Bay Area Toll Authority	7,04%	01/04/2050	982.151	0,07
845.000	California State University	2,98%	01/11/2051	866.813	0,06
875.000	Central Texas Turnpike System	3,03%	15/08/2041	883.946	0,07
265.000	City of Atlantic City NJ	4,29%	01/09/2026	288.396	0,02
845.000	City of New York NY	2,41%	01/08/2032	876.511	0,07
845.000	Commonwealth Financing Authority	3,53%	01/06/2042	869.039	0,06
845.000	County of Clark NV	3,23%	01/07/2044	881.175	0,07
705.000	Dallas Area Rapid Transit	2,82%	01/12/2042	716.163	0,05
795.000	Foothill-Eastern Transportation Corridor Agency	3,92%	15/01/2053	843.053	0,06
845.000	Grand Parkway Transportation Corp	3,24%	01/10/2052	864.662	0,06
845.000	Highland Local School District/Medina County	3,19%	01/12/2049	875.374	0,07
845.000	JobsOhio Beverage System	2,83%	01/01/2038	897.652	0,07
460.000	Los Angeles Community College District	6,75%	01/08/2049	782.162	0,06
400.000	Massachusetts Educational Financing Authority	4,08%	01/07/2027	449.584	0,03
725.000	Michigan Finance Authority	3,38%	01/12/2040	793.543	0,06
225.000	New Jersey Housing & Mortgage Finance Agency	3,80%	01/10/2032	245.031	0,02
845.000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue	3,50%	01/11/2032	940.006	0,07
1.125.000	New York State Dormitory Authority	2,69%	01/07/2040	1.178.570	0,09
840.000	Ohio Turnpike & Infrastructure Commission	3,22%	15/02/2048	863.864	0,06
845.000	Ohio University	2,91%	01/12/2043	849.367	0,06
705.000	Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue	3,01%	15/05/2050	726.929	0,05

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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 emitidos por organismos municipales 1,40% (31 de diciembre de 2020: 3,01%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
565.000	State of California	7,63%	01/03/2040	952.851	0,07
530.000	Texas Private Activity Bond Surface Transportation Corp	3,92%	31/12/2049	593.287	0,04
845.000	Utah Transit Authority	2,77%	15/12/2038	861.158	0,06
Total emitidos por organismos municipales †				19.081.287	1,40
Préstamos a plazo^ 7,48% (31 de diciembre de 2020: 7,64%)					
Dólar estadounidense					
730.000	AAAdvantage Loyalty IP Ltd	5,50%	20/04/2028	761.985	0,06
330.770	Agiliti Health Inc	2,88%	04/01/2026	329.323	0,02
169.164	Agiliti Health Inc	3,50%	04/01/2026	169.376	0,01
679.544	AI Convoy (Luxembourg) Sarl	4,50%	18/01/2027	680.091	0,05
1.022.517	Alliant Holdings Intermediate LLC	3,35%	09/05/2025	1.012.875	0,07
382.069	Altice Financing SA	2,93%	15/07/2025	376.145	0,03
2.168.999	Altice France SA	4,15%	14/08/2026	2.168.880	0,16
453.863	Altium Packaging LLC	3,25%	03/02/2028	451.949	0,03
684.988	American Airlines Inc	0,00%	28/04/2023	669.747	0,05
164.988	American Airlines Inc	0,00%	15/12/2023	161.339	0,01
1.928.890	Applied Systems Inc	3,75%	19/09/2024	1.927.211	0,14
707.239	APX Group Inc	7,25%	31/12/2025	710.334	0,05
576.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/Aru Finance Corp	10,00%	01/11/2025	637.920	0,05
821.130	AssuredPartners Inc	3,60%	12/02/2027	817.882	0,06
495.000	Asurion LLC	3,10%	03/11/2023	492.990	0,04
922.938	Asurion LLC	3,10%	03/11/2024	914.285	0,07
44.888	Asurion LLC	3,35%	31/07/2027	44.429	0,00
1.428.238	athenahealth Inc	4,41%	11/02/2026	1.434.044	0,11
803.208	Aveanna Healthcare LLC B Term Loan	0,00%	30/06/2028	802.204	0,06
186.792	Aveanna Healthcare LLC Delayed Draw Term Loan	0,00%	30/06/2028	186.559	0,01
792.059	Aveanna Healthcare LLC	4,34%	18/03/2024	794.039	0,06
6.817	Aveanna Healthcare LLC	7,25%	18/03/2024	6.881	0,00
666.051	Azalea TopCo Inc	3,69%	24/07/2026	663.137	0,05
342.413	Banijay Entertainment SAS	3,84%	01/03/2025	341.699	0,02
148.269	Barracuda Networks Inc	3,90%	12/02/2025	148.871	0,01
634.860	Bausch Health Cos Inc	3,10%	02/06/2025	632.837	0,05
599.756	BCP Renaissance Parent LLC	4,50%	31/10/2024	590.544	0,04
730.000	Bella Holding Co LLC	4,50%	10/05/2028	731.263	0,05
120.000	Berlin Packaging LLC	0,00%	11/03/2028	119.655	0,01
372.163	Berlin Packaging LLC	3,10%	07/11/2025	369.575	0,03
467.683	Brookfield WEC Holdings Inc	3,25%	01/08/2025	463.753	0,03

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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
Préstamos a plazo^ 7,48% (31 de diciembre de 2020: 7,64%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
450.450	BY Crown Parent LLC	4,00%	02/02/2026	451.013	0,03
442.531	Caesars Resort Collection LLC	2,85%	23/12/2024	439.271	0,03
511.138	Caesars Resort Collection LLC	4,60%	21/07/2025	513.374	0,04
313.425	Camelot US Acquisition 1 Co	4,00%	30/10/2026	314.046	0,02
688.050	Carnival Corp	0,00%	30/06/2025	705.970	0,05
293.531	Change Healthcare Holdings LLC	3,50%	01/03/2024	293.547	0,02
516.865	Circor International Inc	4,25%	11/12/2024	514.981	0,04
483.788	Citadel Securities LP	2,60%	02/02/2028	479.404	0,03
471.473	Clarios Global LP	3,35%	30/04/2026	468.085	0,03
296.231	Commscope Inc	3,35%	06/04/2026	295.359	0,02
214.201	Consolidated Communications Inc	4,25%	02/10/2027	214.888	0,02
437.640	ConvergeOne Holdings Corp	5,10%	04/01/2026	433.761	0,03
487.338	Cornerstone Building Brands Inc	3,75%	12/04/2028	488.008	0,04
509.537	Covia Holdings LLC	0,00%	31/07/2026	502.477	0,04
394.283	CPG International LLC	3,25%	05/05/2024	394.740	0,03
985.000	CQP Holdco LP	4,25%	05/06/2028	982.291	0,07
373.547	Creative Artists Agency LLC	3,85%	27/11/2026	372.761	0,03
277.745	Crosby US Acquisition Corp	4,84%	26/06/2026	277.094	0,02
492.435	Cytxera DC Holdings Inc	4,00%	01/05/2024	480.526	0,04
490.000	Cytxera DC Holdings Inc	8,25%	01/05/2025	486.937	0,04
388.359	Dealer Tire LLC	4,35%	12/12/2025	389.233	0,03
1.168.200	Deerfield Dakota Holding LLC	4,75%	09/04/2027	1.175.291	0,09
344.643	Diamond (BC) BV	3,19%	06/09/2024	343.312	0,03
881.111	Dun & Bradstreet Corp	3,35%	06/02/2026	877.944	0,06
513.930	Eastern Power LLC	4,75%	02/10/2025	460.417	0,03
547.346	Edelman Financial Engines Center LLC	4,50%	07/04/2028	548.638	0,04
474.801	Edgewater Generation LLC	3,85%	13/12/2025	453.917	0,03
795.902	EG Group Ltd	4,15%	07/02/2025	791.640	0,06
184.694	EG Group Ltd	4,75%	31/03/2026	185.069	0,01
250.872	Emerald Expositions Holding Inc	2,60%	22/05/2024	242.523	0,02
486.849	Endurance International Group Holdings Inc	4,25%	10/02/2028	485.427	0,04
418.937	Ensemble RCM LLC	0,00%	03/08/2026	419.722	0,03
1.206.906	Envision Healthcare Corp	3,85%	10/10/2025	1.037.185	0,08
903.175	Epicor Software Corp	4,00%	30/07/2027	903.261	0,07
341.188	EyeCare Partners LLC	3,85%	18/02/2027	338.694	0,02
478.774	Filtration Group Corp	3,10%	31/03/2025	475.532	0,03
972.563	First Brands Group LLC	6,00%	30/03/2027	985.532	0,07
403.500	Flexera Software LLC	0,00%	26/02/2025	404.870	0,03

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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
Préstamos a plazo^ 7,48% (31 de diciembre de 2020: 7,64%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
68.000	Flexera Software LLC	0,00%	26/01/2028	68.231	0,00
400.627	Flexera Software LLC	4,50%	03/03/2028	401.987	0,03
410.000	Formula One Management Ltd	3,50%	01/02/2024	408.815	0,03
208.535	Forterra Finance LLC	4,00%	25/10/2023	208.835	0,02
512.425	Gainwell Acquisition Corp	4,75%	01/10/2027	514.987	0,04
1.320.549	Garda World Security Corp	4,35%	30/10/2026	1.328.565	0,10
436.690	Golden Entertainment Inc	3,75%	21/10/2024	435.326	0,03
889.263	Graham Packaging Co Inc	3,75%	04/08/2027	889.516	0,07
1.947.917	Granite Generation LLC	4,75%	09/11/2026	1.905.306	0,14
324.978	Granite US Holdings Corp	4,15%	30/09/2026	326.603	0,02
1.457.675	Great Outdoors Group LLC	5,00%	06/03/2028	1.464.737	0,11
483.788	Greeneden US Holdings I LLC	4,75%	01/12/2027	485.517	0,04
207.072	GTT Communications BV	6,00%	28/12/2021	210.696	0,02
237.039	GTT Communications BV Delayed Draw Term Loan	6,00%	28/12/2021	241.187	0,02
535.091	GTT Communications Inc	2,90%	31/05/2025	425.954	0,03
495.815	Heartland Dental LLC	3,60%	30/04/2025	490.996	0,04
506.017	Hercules Achievement Inc	4,50%	16/12/2024	495.527	0,04
148.040	Hertz Corp	3,50%	30/06/2023	148.179	0,01
255.633	Hertz Corp	8,25%	31/12/2021	257.179	0,02
936.051	Hub International Ltd	2,93%	25/04/2025	926.775	0,07
883.314	Hub International Ltd	4,00%	25/04/2025	884.489	0,06
880.337	Hyland Software Inc	4,25%	01/07/2024	882.996	0,06
1.782.539	ICON Luxembourg Sarl B Term Loan	0,00%	16/06/2028	1.787.414	0,13
197.461	ICON Luxembourg Sarl B Term Loan USD	0,00%	16/06/2028	198.001	0,01
730.000	Ingram Micro Inc	0,00%	30/03/2028	732.168	0,05
307.032	Intelsat Jackson Holdings SA	6,50%	13/07/2022	309.720	0,02
640.000	Intelsat Jackson Holdings SA	8,00%	27/11/2023	651.734	0,05
220.367	Intrado Corp	4,50%	10/10/2024	214.135	0,02
527.454	Iridium Satellite LLC	3,75%	04/11/2026	529.029	0,04
179.550	Ivanti Software Inc	4,75%	01/12/2027	179.027	0,01
563.588	Ivanti Software Inc	5,75%	01/12/2027	565.270	0,04
387.847	Kestrel Acquisition LLC	5,25%	02/06/2025	328.894	0,02
744.316	Learning Care Group (US) No 2 Inc	4,25%	13/03/2025	733.255	0,05
487.387	Life Time Inc	5,75%	16/12/2024	490.433	0,04
437.023	LifePoint Health Inc	3,85%	16/11/2025	436.521	0,03
341.563	Loire UK Midco 3 Ltd	3,10%	21/04/2027	336.653	0,02
419.557	Lonestar II Generation Holdings LLC B Initial Term Loan	5,10%	20/04/2026	413.658	0,03
54.842	Lonestar II Generation Holdings LLC C Initial Term Loan	5,10%	20/04/2026	54.071	0,00

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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
Préstamos a plazo^ 7,48% (31 de diciembre de 2020: 7,64%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
987.209	Lower Cadence Holdings LLC	0,00%	22/05/2026	982.362	0,07
627.812	Lucid Energy Group II Borrower LLC	4,00%	17/02/2025	623.213	0,05
702.781	Lumen Technologies Inc	2,35%	15/03/2027	694.260	0,05
492.122	Mauser Packaging Solutions Holding Co	3,35%	03/04/2024	481.165	0,04
895.633	McAfee LLC	3,85%	30/09/2024	896.811	0,07
511.411	Medallion Midland Acquisition LLC	4,25%	30/10/2024	508.726	0,04
737.531	MediaOcean LLC	4,10%	18/08/2025	739.375	0,05
541.748	MHI Holdings LLC	5,10%	21/09/2026	544.457	0,04
798.706	MPH Acquisition Holdings LLC	0,00%	07/06/2023	797.392	0,06
310.716	MRC Global (US) Inc	3,10%	20/09/2024	308.905	0,02
440.257	MTN Infrastructure TopCo Inc	4,00%	15/11/2024	440.655	0,03
400.148	Nautilus Power LLC	5,25%	16/05/2024	378.240	0,03
523.688	Orion Advisor Solutions Inc	0,00%	24/09/2027	525.324	0,04
243.738	Ortho-Clinical Diagnostics Inc	3,09%	30/06/2025	243.826	0,02
134.663	Packaging Coordinators Midco Inc	4,25%	30/11/2027	134.965	0,01
460.330	Parexel International Corp	2,85%	27/09/2024	458.352	0,03
621.727	Peraton Corp	0,00%	01/02/2028	624.618	0,05
974.117	Peraton Corp	4,50%	01/02/2028	978.646	0,07
488.775	Petco Health and Wellness Co Inc	4,00%	03/03/2028	488.340	0,04
389.000	PetVet Care Centers LLC	3,35%	14/02/2025	386.894	0,03
331.625	PetVet Care Centers LLC	4,25%	14/02/2025	333.031	0,02
728.175	Playtika Holding Corp	2,85%	13/03/2028	725.859	0,05
740.000	Polaris Newco LLC	4,50%	02/06/2028	743.101	0,05
1.015.853	Prairie ECI Acquiror LP	4,85%	11/03/2026	990.879	0,07
678.150	Presidio Holdings Inc	3,69%	22/01/2027	678.893	0,05
1.384.737	Prime Security Services Borrower LLC	3,50%	23/09/2026	1.385.063	0,10
376.671	Pro Mach Group Inc	4,50%	07/03/2025	377.260	0,03
966.731	Project Alpha Intermediate Holding Inc	4,11%	26/04/2024	969.317	0,07
1.940.138	Rackspace Technology Global Inc	3,50%	15/02/2028	1.932.028	0,14
601.975	Radiate HoldCo LLC	4,25%	25/09/2026	603.281	0,04
528.252	Redstone Holdco 2 LP	5,50%	27/04/2028	528.032	0,04
327.935	Scientific Games International Inc	2,85%	14/08/2024	325.977	0,02
563.407	SCS Holdings I Inc	3,60%	01/07/2026	563.258	0,04
370.301	Seaworld Parks & Entertainment Inc	3,75%	01/04/2024	368.218	0,03
507.398	Sedgwick Claims Management Services Inc	3,35%	31/12/2025	502.578	0,04
465.500	Sedgwick Claims Management Services Inc	3,85%	03/09/2026	465.339	0,03
778.285	Select Medical Corp	2,36%	06/03/2025	772.452	0,06
405.000	SkyMiles IP Ltd	4,75%	20/10/2027	428.314	0,03

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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
Préstamos a plazo^ 7,48% (31 de diciembre de 2020: 7,64%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
410.709	Solenis Holdings LLC	4,14%	26/06/2025	411.149	0,03
527.350	Sophia LP	3,90%	07/10/2027	528.449	0,04
1.201.980	Sunshine Luxembourg VII Sarl	0,00%	01/10/2026	1.207.912	0,09
259.350	Sunshine Luxembourg VII Sarl	4,50%	01/10/2026	260.630	0,02
299.600	Talen Energy Supply LLC	3,85%	08/07/2026	278.161	0,02
1.246.408	Team Health Holdings Inc	3,75%	06/02/2024	1.214.207	0,09
883.325	Tech Data Corp	5,60%	30/06/2025	889.212	0,07
614.949	Tempo Acquisition LLC	3,35%	02/11/2026	616.486	0,05
388.242	Tenneco Inc	3,10%	01/10/2025	384.942	0,03
1.177.135	TIBCO Software Inc	3,86%	30/06/2026	1.175.663	0,09
376.839	TMS International Corp	3,75%	14/08/2024	376.368	0,03
78.800	TransDigm Inc	2,35%	30/05/2025	77.780	0,01
608.886	TransDigm Inc	2,35%	09/12/2025	600.593	0,04
490.581	Traverse Midstream Partners LLC	6,50%	27/09/2024	493.650	0,04
2.895	Tricorbraun Holdings Inc	3,27%	03/03/2028	2.878	0,00
386.159	Tricorbraun Holdings Inc	3,75%	03/03/2028	383.844	0,03
654.305	Trident TPI Holdings Inc	4,00%	17/10/2024	652.941	0,05
635.618	Uber Technologies Inc	3,60%	25/02/2027	636.511	0,05
482.905	UKG Inc	4,00%	04/05/2026	484.091	0,04
733.163	United AirLines Inc	4,50%	21/04/2028	743.804	0,05
639.366	Univision Communications Inc	3,75%	15/03/2024	639.567	0,05
1.429.955	Verscend Holding Corp	4,10%	27/08/2025	1.435.575	0,11
197.500	VS Buyer LLC	3,10%	28/02/2027	197.192	0,01
408.096	Wand Newco 3 Inc	3,10%	05/02/2026	403.797	0,03
341.732	Waystar Technologies Inc	4,10%	22/10/2026	342.800	0,02
487.550	White Cap Buyer LLC	4,50%	19/10/2027	489.017	0,04
317.065	WideOpenWest Finance LLC	4,25%	18/08/2023	317.131	0,02
442.745	William Morris Endeavor Entertainment LLC	2,86%	18/05/2025	435.690	0,03
667.255	Wilsonart LLC	4,50%	31/12/2026	667.909	0,05
423.125	Zayo Group Holdings Inc	3,10%	09/03/2027	419.192	0,03
583.649	ZoomInfo LLC	3,10%	02/02/2026	584.469	0,04
Total préstamos a plazo †				101.881.964	7,48

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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
Fondos de inversión 2.76% (31 de diciembre de 2020: 2,86%)			
Dólar estadounidense			
945.691	Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund	10.326.950	0,76
486.855	Neuberger Berman European High Yield Bond Fund	5.822.785	0,43
459.982	Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund	5.427.782	0,40
1.094.321	Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund	14.992.197	1,10
861.209	Neuberger Berman Global Monthly Income Fund Ltd	1.046.951	0,07
Total fondos de inversión ¹		37.616.665	2,76
Total inversiones		1.270.339.920	93,21

Contratos de divisas a plazo 0,11% (31 de diciembre de 2020: 0,89%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
5.243.354 BRL	960.145 USD	02/07/2021	Citibank NA	1	84.795	0,01
476.687 BRL	89.100 USD	02/09/2021	Citibank NA	1	5.187	0,00
2.180.110 BRL	423.462 USD	02/09/2021	Goldman Sachs International	2	7.753	0,00
14.134.442 BRL	2.639.096 USD	02/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	156.624	0,01
725.600 BRL	142.742 USD	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.861	0,00
2.759.480.000 CLP	3.759.663 USD	05/08/2021	Citibank NA	1	26.617	0,00
2.759.480.000 CLP	3.756.183 USD	09/07/2021	Citibank NA	1	33.036	0,00
889.089 CNY	137.428 USD	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	184	0,00
10.492.265.000 COP	2.788.924 USD	09/07/2021	Citibank NA	1	19.987	0,00
19.175.964 EGP	1.111.650 USD	25/05/2022	Goldman Sachs International	1	5.451	0,00
1.165 €	1.000 £	19/07/2021	Citibank NA	1	1	0,00
257.942 €	90.456.052 HUF	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	1.181	0,00
352.514 €	1.591.366 PLN	07/07/2021	Goldman Sachs International	1	65	0,00
566.982 €	2.553.652 PLN	07/07/2021	HSBC Bank Plc	1	1.654	0,00
353.199 €	123.349.305 HUF	15/09/2021	HSBC Bank Plc	1	3.343	0,00
224.343 £	259.569 €	19/07/2021	Citibank NA	1	2.001	0,00
752.863 £	1.039.537 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	556	0,00
349.728 £	405.550 €	19/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	2.042	0,00
92.094.271 HUF	258.804 €	15/09/2021	HSBC Bank Plc	1	3.323	0,00
115.486.796 HUF	323.846 €	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	4.994	0,00
1.033.050.000 KRW	914.050 USD	05/08/2021	Citibank NA	1	66	0,00
206.784.713 KZT	479.501 USD	14/07/2021	Goldman Sachs International	1	3.626	0,00
77.707.343 KZT	178.576 USD	24/09/2021	Goldman Sachs International	1	247	0,00
32.441.565 KZT	75.349 USD	14/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	447	0,00
25.204.670 MXN	1.250.539 USD	15/09/2021	Citibank NA	2	3.206	0,00
87.770.701 MXN	4.396.976 USD	09/07/2021	Citibank NA	1	7.415	0,00
1.347.096 PEN	347.297 USD	16/07/2021	Citibank NA	1	4.609	0,00

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,11% (31 de diciembre de 2020: 0,89%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
909.166 PLN	197.895 €	06/07/2021	Citibank NA	1	4.117	0,00
9.657.714 PLN	2.118.939 €	06/07/2021	Goldman Sachs International	3	23.835	0,00
1.047.159 PLN	231.876 €	07/07/2021	Goldman Sachs International	1	60	0,00
3.246.539 PLN	711.104 €	06/07/2021	HSBC Bank Plc	2	9.434	0,00
1.559.959 PLN	343.095 €	07/07/2021	HSBC Bank Plc	1	2.855	0,00
775.699 RON	155.496 €	06/10/2021	Citibank NA	1	1.277	0,00
992.646 RON	199.247 €	06/10/2021	Goldman Sachs International	1	1.323	0,00
2.719.342 RON	546.083 €	06/10/2021	JPMorgan Chase Bank	2	3.328	0,00
325.427.957 RUB	4.409.473 USD	09/07/2021	Citibank NA	1	40.972	0,01
2.625.029 RUB	34.588 USD	16/07/2021	Citibank NA	1	1.276	0,00
44.911.032 RUB	579.631 USD	16/07/2021	HSBC Bank Plc	1	33.964	0,00
18.116.186 RUB	237.340 USD	16/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	10.171	0,00
21.735.134 UAH	744.354 USD	22/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	47.304	0,01
2.067.482 USD	29.385.000 ZAR	09/07/2021	Citibank NA	1	11.336	0,00
641.903 USD	457.044 £	19/07/2021	Citibank NA	1	10.488	0,00
283.692 USD	237.094 €	06/07/2021	Citibank NA	1	2.498	0,00
1.972.568 USD	9.781.306 BRL	02/07/2021	Citibank NA	2	23.266	0,00
27.256.550 USD	22.749.045 €	19/07/2021	Citibank NA	1	268.747	0,02
1.833.647 USD	136.405.000 INR	09/07/2021	Citibank NA	1	123	0,00
2.830.889 USD	10.492.265.000 COP	09/07/2021	Citibank NA	1	21.978	0,00
4.501.078 USD	325.427.957 RUB	09/07/2021	Citibank NA	1	50.633	0,01
586.702 USD	487.864 €	06/07/2021	Deutsche Bank AG	3	8.095	0,00
794.750 USD	654.241 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	4	18.606	0,00
700.249 USD	21.823.271 THB	01/07/2021	Goldman Sachs International	1	19.336	0,00
421.934 USD	2.101.442 BRL	02/09/2021	Goldman Sachs International	1	6.280	0,00
29.840 USD	107.596 PEN	16/07/2021	Goldman Sachs International	1	1.732	0,00
354.507 USD	4.987.858 ZAR	06/07/2021	Goldman Sachs International	1	5.362	0,00
267.429 USD	3.894.031.482 IDR	27/07/2021	Goldman Sachs International	1	340	0,00
4.423.126 USD	87.770.701 MXN	09/07/2021	Goldman Sachs International	1	18.735	0,00
57.985 USD	41.136 £	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	1.156	0,00
139.228 USD	889.089 CNY	02/07/2021	HSBC Bank Plc	1	1.616	0,00
6.270 USD	52.924 NOK	19/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	120	0,00
1.862.793 USD	1.563.853 €	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	6.927	0,00
678.108 USD	907.999 SGD	12/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	2.629	0,00
2.760.385 USD	2.264.895 €	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	74.218	0,01
145.056 USD	725.600 BRL	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	452	0,00
785.021 USD	21.789.823 TWD	09/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	4.052	0,00
217.263 USD	3.074.660 ZAR	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	2.040	0,00

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,11% (31 de diciembre de 2020: 0,89%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
192.885 USD	2.735.703 ZAR	06/07/2021	Morgan Stanley	1	1.388	0,00
338.459 USD	283.491 €	19/07/2021	Royal Bank Of Canada	2	2.146	0,00
10.026.407 USD	8.262.660 €	19/07/2021	UBS AG	1	224.192	0,02
6.741.973 ZAR	466.772 USD	06/07/2021	Goldman Sachs International	2	5.159	0,00
3.736.140 ZAR	255.897 USD	06/07/2021	Morgan Stanley	1	5.629	0,00
Clases AUD con cobertura						
33.309 USD	43.324 AUD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	780	0,00
83.577 USD	107.977 AUD	19/07/2021	UBS AG	2	2.506	0,00
32.814 USD	42.678 AUD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	771	0,00
Clases EUR con cobertura						
109 €	129 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	0	0,00
955.943 USD	788.609 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	28	20.394	0,00
Clases GBP con cobertura						
1.158.795 £	1.595.089 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	5.808	0,00
1.182.543 £	1.627.863 USD	19/07/2021	UBS AG	3	5.842	0,00
1.141.500 £	1.570.750 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	6.254	0,00
641.549 USD	453.390 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	7	15.183	0,00
Clases HKD con cobertura						
88.022 HKD	11.310 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	25	0,00
87.609 HKD	11.281 USD	19/07/2021	UBS AG	1	1	0,00
1.054.561 HKD	135.759 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	41	0,00
361.869 USD	2.809.457 HKD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	84	0,00
361.829 USD	2.809.457 HKD	19/07/2021	UBS AG	1	45	0,00
358.590 USD	2.784.203 HKD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	58	0,00
Clases JPY con cobertura						
162.650.466 ¥	1.465.151 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	505	0,00
1.491.926 USD	162.363.920 ¥	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	28.852	0,00
1.490.399 USD	162.363.920 ¥	19/07/2021	UBS AG	1	27.325	0,00
2.470.231 USD	269.170.577 ¥	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	44.715	0,01
Clases SGD con cobertura						
653.737 SGD	485.982 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	9	336	0,00
938.315 USD	1.250.230 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	45	8.260	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					1.527.251	0,11

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de futuros 0,03% (31 de diciembre de 2020: 0,11%)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
165	Euro-BOBL Future September 2021	13.697	0,00
41	United Kingdom Long Gilt Future September 2021	46.444	0,00
101	US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2021	381.923	0,03
Plusvalía latente total sobre contratos de futuros *		442.064	0,03

Contratos de swap de tipos de interés 0,01% (31 de diciembre de 2020: 0,02%)

Importe notional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar) [#]	Tipo fijo	Tipo variable	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto	
BRL	2.099.808	02/01/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	9,08%	1D BROIS	85.887	0,01
BRL	1.102.672	02/01/2025	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	9,55%	1D BROIS	56.700	0,00
BRL	1.391.591	03/01/2022	Morgan Stanley	(Pagar)	5,98%	1D BROIS	15.250	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de swap de tipos de interés^{oo}						157.837	0,01	

Recibir – El Fondo recibe un tipo variable y paga un tipo fijo.

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

¹Swap liquidada centralmente.

Contratos de swap de rentabilidad total 0,06% (31 de diciembre de 2020: 0,09%)

Importe notional	Fecha de extinción	Tipo variable	Entidad de referencia	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto	
USD	84.999.738	20/09/2021	0,13 ¹	iBoxx USD Liquid High Yield Index ²	561.258	0,04
USD	35.599.890	20/09/2021	0,13 ¹	iBoxx USD Liquid High Yield Index ⁴	152.499	0,01
USD	11.509.375	15/02/2029	0,75 ³	Goldman Sachs Basket SDHY ⁴	140.270	0,01
USD	23.280.000	04/02/2028	0,64 ³	JPMorgan Bond Basket ²	15.898	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de swap de rentabilidad total^{oo}				869.925	0,06	

¹ El LIBOR a 3 meses es la referencia para este contrato de swap de rentabilidad total.

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

³ El tipo de interés efectivo de los fondos de la Fed a un día es la referencia para este contrato de swap de rentabilidad total.

⁴ La contraparte en este contrato de swap de rentabilidad total es Goldman Sachs International.

Contratos de credit default swap 0,17% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)

Importe notional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Obligación referenciada	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto	
EUR	17.016.848	20/06/2028	ICE Clear U.S. ¹	Selling default protection on iTraxx Europe Crossover	2.241.283	0,17
Total valor razonable en contratos de credit default swap^{oo}				2.241.283	0,17	

¹Swap liquidada centralmente.

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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	1.275.578.280	93,59

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,53%) (31 de diciembre de 2020: (0,11%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patri- monio neto
4.537.952 BRL	921.529 USD	03/08/2021	Citibank NA	1	(20.246)	(0,00)
4.537.952 BRL	907.191 USD	02/07/2021	Citibank NA	1	(2.829)	(0,00)
1.431.002 BRL	286.075 USD	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(892)	(0,00)
272.009.482 CLP	378.895 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(6.074)	(0,00)
242.709.961 CLP	339.099 USD	15/09/2021	HSBC Bank Plc	1	(6.436)	(0,00)
10.492.265.000 COP	2.827.075 USD	05/08/2021	Citibank NA	1	(22.045)	(0,00)
3.306.285.071 COP	917.251 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(35.555)	(0,01)
2.713.966 €	3.252.526 USD	19/07/2021	Citibank NA	6	(32.876)	(0,01)
633.446 €	552.514 £	19/07/2021	Citibank NA	2	(11.835)	(0,00)
326.579 €	388.546 USD	06/07/2021	Citibank NA	1	(1.223)	(0,00)
1.226.714 €	5.552.118 PLN	15/09/2021	Goldman Sachs International	2	(1.676)	(0,00)
8.100.000 €	9.804.240 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(194.992)	(0,02)
1.288.384 €	5.841.989 PLN	06/07/2021	Goldman Sachs International	2	(6.555)	(0,00)
253.536 €	219.107 £	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(1.924)	(0,00)
20.571 €	24.469 USD	06/07/2021	Goldman Sachs International	1	(73)	(0,00)
1.750.384 €	7.971.430 PLN	06/07/2021	HSBC Bank Plc	3	(17.987)	(0,00)
60.587 €	72.412 USD	19/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(536)	(0,00)
2.642.703 €	3.158.539 USD	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	5	(24.292)	(0,00)
9.651.794 €	11.722.297 USD	19/07/2021	Royal Bank Of Canada	1	(272.114)	(0,02)
427.033 £	604.340 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(14.385)	(0,00)
4.184.825 HUF	11.972 €	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(101)	(0,00)
3.512.997 ILS	1.081.532 USD	10/09/2021	Goldman Sachs International	1	(2.561)	(0,00)
136.405.000 INR	1.828.118 USD	05/08/2021	Citibank NA	1	(693)	(0,00)
136.405.000 INR	1.860.868 USD	09/07/2021	Citibank NA	1	(27.345)	(0,00)
50.864.346 INR	687.681 USD	24/09/2021	Goldman Sachs International	1	(10.581)	(0,00)
45.868 ¥	421 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(8)	(0,00)
1.033.050.000 KRW	920.386 USD	09/07/2021	Citibank NA	1	(6.166)	(0,00)
1.338.983.104 KRW	1.203.868 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(18.961)	(0,00)
87.770.701 MXN	4.408.294 USD	05/08/2021	Goldman Sachs International	1	(18.753)	(0,00)
5.726.368 MXN	286.488 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(1.643)	(0,00)
2.985.089 MYR	728.693 USD	08/07/2021	Morgan Stanley	1	(10.210)	(0,00)
1.570.454 PEN	416.169 USD	16/07/2021	Goldman Sachs International	1	(5.914)	(0,00)
15.232.839 PHP	311.982 USD	26/07/2021	Goldman Sachs International	1	(746)	(0,00)

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
18.891.757 PHP	386.785 USD	26/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(790)	(0,00)
5.610.281 PLN	1.254.900 €	30/09/2021	Goldman Sachs International	1	(16.971)	(0,00)
1.537.900 PLN	344.007 €	07/07/2021	HSBC Bank Plc	1	(4.021)	(0,00)
325.427.957 RUB	4.483.621 USD	05/08/2021	Citibank NA	1	(49.937)	(0,01)
907.992 SGD	685.939 USD	12/07/2021	Goldman Sachs International	1	(10.466)	(0,00)
21.823.271 THB	685.774 USD	01/07/2021	Goldman Sachs International	3	(4.861)	(0,00)
10.811.125 TWD	391.340 USD	09/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(3.859)	(0,00)
3.759.356 USD	2.759.480.000 CLP	09/07/2021	Citibank NA	1	(29.863)	(0,00)
914.139 USD	1.033.050.000 KRW	09/07/2021	Citibank NA	1	(81)	(0,00)
5.454.160 USD	3.956.788 £	19/07/2021	Citibank NA	1	(12.218)	(0,00)
542.678 USD	15.161.346 TWD	09/07/2021	Goldman Sachs International	1	(720)	(0,00)
212.682 USD	3.083.339 ZAR	01/10/2021	Goldman Sachs International	1	(682)	(0,00)
930.285 USD	13.528.996 ZAR	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(16.731)	(0,00)
271.612 USD	1.431.002 BRL	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(13.571)	(0,00)
477.287 USD	35.068.645 RUB	16/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(1.837)	(0,00)
276.363 USD	372.264 SGD	12/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(572)	(0,00)
90.065 USD	2.547.941 UAH	22/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(2.738)	(0,00)
675.365 USD	3.434.166 BRL	02/09/2021	Standard Chartered Bank	1	(3.895)	(0,00)
306.347 USD	2.815.240 TRY	22/09/2021	Standard Chartered Bank	1	(4.291)	(0,00)
29.385.000 ZAR	2.110.645 USD	09/07/2021	Citibank NA	1	(54.499)	(0,01)
29.385.000 ZAR	2.060.338 USD	05/08/2021	Citibank NA	1	(11.342)	(0,00)
3.945.799 ZAR	277.447 USD	06/07/2021	Citibank NA	1	(1.246)	(0,00)
1.234.145 ZAR	86.709 USD	06/07/2021	HSBC Bank Plc	1	(320)	(0,00)
5.285.158 ZAR	375.048 USD	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(5.092)	(0,00)
3.384.002 ZAR	243.714 USD	06/07/2021	UBS AG	1	(6.837)	(0,00)
Clases AUD con cobertura						
4.307.461 AUD	3.311.175 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	(77.073)	(0,01)
4.157.900 AUD	3.196.498 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(74.689)	(0,00)
4.621.829 AUD	3.556.717 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	7	(86.583)	(0,01)
Clases EUR con cobertura						
6.276.718 €	7.527.070 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	(80.831)	(0,01)
6.271.767 €	7.516.674 USD	19/07/2021	UBS AG	3	(76.309)	(0,01)
6.691.020 €	8.025.943 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	41	(88.206)	(0,01)
22.603 USD	19.054 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(1)	(0,00)
Clases GBP con cobertura						
261.642 £	370.160 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	5	(8.697)	(0,00)
139.344 USD	101.092 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	(317)	(0,00)
Clases HKD con cobertura						
7.876.473 HKD	1.014.519 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(237)	(0,00)

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (0,53%) (31 de diciembre de 2020: (0,11%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases HKD con cobertura (cont.)						
7.876.473 HKD	1.014.410 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(127)	(0,00)
8.893.141 HKD	1.145.377 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	9	(175)	(0,00)
37.772 USD	293.726 HKD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	(52)	(0,00)
Clases JPY con cobertura						
9.660.936.939 ¥	88.763.846 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(1.708.408)	(0,12)
9.669.511.502 ¥	88.752.213 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(1.619.508)	(0,12)
12.133.681.673 ¥	111.482.847 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	9	(2.145.319)	(0,16)
Clases SGD con cobertura						
13.311.602 SGD	9.956.972 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	4	(54.385)	(0,00)
12.849.446 SGD	9.609.894 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(51.107)	(0,00)
15.468.064 SGD	11.576.460 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	51	(69.667)	(0,00)
9 USD	13 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(0)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					(7.177.358)	(0,53)

Contratos de futuros (0,35%) (31 de diciembre de 2020: (0,02%))

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(108)	Euro-BOBL Future September 2021	(11.527)	(0,00)
(70)	Euro-Bund Future September 2021	(77.202)	(0,00)
(13)	United Kingdom Long Gilt Future September 2021	(14.726)	(0,00)
(1.183)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2021	(650.425)	(0,05)
(1.057)	US Treasury 10-Year Ultra Future September 2021	(2.315.003)	(0,17)
119	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2021	(44.431)	(0,00)
(210)	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2021	(1.737.876)	(0,13)
Minusvalía latente total sobre contratos de futuros *		(4.851.190)	(0,35)

Contratos de swaps de tipos de interés (0,01%) (31 de diciembre de 2020: (0,00%))

Importe notional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar)#	Tipo fijo	Tipo variable	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto	
BRL	7.748.256	02/01/2025	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	6,28%	1D BROIS	(6.220)	(0,00)
BRL	6.266.079	02/01/2025	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	6,17%	1D BROIS	(56.832)	(0,00)
BRL	3.860.376	04/01/2027	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	6,17%	1D BROIS	(57.887)	(0,01)
Minusvalía latente total sobre contratos de swap de tipos de interés∞						(120.939)	(0,01)	

Recibir – El Fondo recibe un tipo variable y paga un tipo fijo.

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

¹Swap liquidada centralmente.

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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	(12.149.487)	(0,89)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	1.263.428.793	92,70
Otro activo neto	99.534.900	7,30
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	1.362.963.693	100,00

^ Puede que los préstamos a plazo con cupón del 0,00% no se hayan liquidado a 30 de junio de 2021, por lo que no tienen tipos de interés efectivos. Los tipos de interés no tienen efecto hasta la liquidación.

Análisis de la cartera	USD	% de los Activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	360.536.849	22,46
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	751.223.155	46,80
† Otros valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario	120.963.251	7,53
μ Fondos de inversión	37.616.665	2,34
± Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	(4.409.126)	(0,27)
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(2.502.001)	(0,16)
Total inversiones	1.263.428.793	78,70

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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 período 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 período. Como mínimo, se presentan las 20 compras y las 20 ventas más importantes, siempre que se disponga de dicha información.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
442.980.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/03/2051	465.916.761
435.680.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/02/2051	458.347.708
420.140.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/06/2051	435.601.951
413.000.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/05/2051	424.052.204
403.060.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/07/2051	416.139.612
396.420.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/04/2051	410.779.484
349.440.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/02/2051	361.613.983
234.440.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/03/2051	246.011.342
232.100.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/02/2051	244.679.063
229.320.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/03/2051	236.248.852
224.040.000	Ginnie Mae II Pool, 2.50%, 01/06/2051	232.405.231
221.920.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/05/2051	229.380.848
211.840.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/04/2051	218.719.006
198.520.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/07/2051	205.185.245
146.329.859	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0.50%, 15/01/2028	166.062.558
131.260.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/07/2051	137.031.552
128.860.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/06/2051	134.758.605
121.040.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/04/2051	122.041.590
95.700.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/02/2036	99.685.512
87.540.000	Ginnie Mae, 2.00%, 01/03/2051	90.573.033
87.520.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/05/2051	87.711.347
82.880.000	Ginnie Mae, 2.00%, 01/02/2051	86.103.764
77.380.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/05/2051	80.848.523

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

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
442.980.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/03/2051	460.434.005
435.680.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/02/2051	459.002.350
420.140.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/06/2051	434.702.065
413.000.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/05/2051	429.215.980
399.540.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/01/2051	421.069.478
396.420.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/04/2051	407.704.823
349.440.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/02/2051	360.659.030
306.800.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/01/2051	318.134.547
232.100.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/02/2051	243.973.773
234.440.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/03/2051	242.854.676
229.320.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/03/2051	233.222.672
224.040.000	Ginnie Mae II Pool, 2.50%, 01/06/2051	231.986.732
221.920.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/05/2051	230.644.286
211.840.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/04/2051	219.304.628
128.860.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 15/06/2045	134.546.124
121.040.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/04/2051	121.341.484
113.300.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/01/2036	118.139.655
95.700.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/02/2036	99.889.446
86.868.144	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0.63%, 15/01/2026	96.756.182
87.540.000	Ginnie Mae, 2.00%, 01/03/2051	89.329.559
87.520.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/05/2051	88.318.319
82.880.000	Ginnie Mae, 2.00%, 01/02/2051	85.994.310
77.380.000	Fannie Mae Pool, 3.00%, 01/05/2051	81.051.737
73.620.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/03/2036	76.623.338
67.479.156	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0.50%, 15/01/2028	75.782.255

Neuberger Berman Global Bond Absolute Return Fund

Balance

	Nota	A 31 de diciembre de 2020* USD
Activo circulante		
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	172.042
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		255
Ingresos a percibir y otros activos		4.025
Activos totales		176.322
Pasivo circulante		
Descubierto bancario	3	100.265
Gastos devengados		18.003
Otras cuentas por pagar		58.054
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		176.322
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		–

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global Bond Absolute Return Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos		
Ingresos por intereses		1.898.795
Ingresos por dividendos		102.169
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(12.592.006)
		(10.591.042)
Gastos		
Comisión de gestión	5	411.694
Comisión de distribución	5	1.044
Comisión de administración	5	99.804
Comisión de compromiso	16	7.051
Comisión de depósito	5	6.065
Comisión del Depositario	5	5.178
Honorarios profesionales	7	28.153
Honorarios de los Consejeros	6	2.375
Costes de transacciones	7	63.792
Honorarios de auditoría	7	8.831
Reembolso de IVA		(399)
Otros gastos	7	12.826
Gastos no asumidos	5	(105.603)
Gastos totales		540.811
Costes financieros		
Gastos por intereses		803
Repartos de dividendos abonados	1	50.930
		51.733
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		(11.183.586)

*La Cartera se liquidó el 30 de noviembre de 2020.

Los ingresos y gastos se derivaron exclusivamente de actividades interrumpidas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global Bond Absolute Return Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	134.523.753
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	(11.183.586)
Suscripciones	26.582.646
Reembolsos	(119.571.658)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	30.351.155

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund

Informe del Gestor de inversiones

Durante el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 (el "periodo analizado"), la rentabilidad total de la Clase de Acumulación USD I se situó en el 1,02%. En el mismo periodo, el índice de referencia, el ICE BofA US 3-Month Treasury Bill (rentabilidad total en USD), obtuvo una rentabilidad del 0,02%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Los bonos de mercados emergentes ("ME") en monedas fuertes se enfrentaron a un contexto volátil en la primera mitad del año al verse favorecidos los activos de riesgo por la sólida recuperación económica y las continuas campañas de vacunación mundial, a pesar de la presión que ejerció el "reflation trade" en los mercados de renta fija. Los valores del Tesoro fueron objeto de bruscas ventas masivas que llevaron las rentabilidades a 10 años a un máximo del 1,74% al final de marzo; esto quedó parcialmente contrarrestado a finales del segundo trimestre, a pesar del giro "hawkish" que adoptó la Reserva Federal estadounidense (la "Fed") a mediados de junio. Los precios del petróleo tuvieron un buen comportamiento durante todo el periodo analizado, mientras que los metales preciosos atravesaron dificultades, en ambos casos como consecuencia del sentimiento económico positivo. El dólar estadounidense avanzó en gran medida en consonancia con las rentabilidades de los bonos del Tesoro, aunque experimentó un gran salto tras la reunión de la Fed del mes de junio. De media, los diferenciales de los bonos en monedas fuertes de ME se contrajeron en el periodo analizado.

En este entorno, los bonos de menor duración y los bonos de ME con calificación de alta rentabilidad batieron al conjunto del mercado de bonos de ME en monedas fuertes. Por lo que respecta específicamente a la deuda corporativa, el sector de los metales y la minería fue el que mejor se comportó, mientras que el sector de suministros públicos y el inmobiliario se situaron a la zaga en el primer semestre de 2021.

La Cartera se anotó una rentabilidad positiva gracias a que la aportación negativa realizada por el conjunto de las rentabilidades de los bonos del Tesoro de EE. UU. se vio compensada con creces por los resultados positivos de los diferenciales. La exposición a deuda soberana de Sri Lanka fue lo que más contribuyó a la rentabilidad, debido a la mejora de las perspectivas de crecimiento doméstico y a la ayuda financiera bilateral de la que se beneficia. La exposición a deuda corporativa en Brasil también realizó una de las mayores contribuciones a la rentabilidad, en particular las posiciones en sectores industriales y relacionados con las materias primas, así como las posiciones en Turquía, los EAU y la India. Por otra parte, el posicionamiento en China fue lo que más lastró la rentabilidad durante el periodo analizado, impulsado por las posiciones en Huarong, que experimentó una presión de precios a consecuencia de la preocupación por el retraso en la publicación del informe anual y por el nivel de ayudas públicas que percibe la empresa.

Las expectativas de crecimiento mundial para el resto de 2021 siguen siendo alentadoras, siendo probable que los ME se beneficien de la incesante recuperación cíclica, tal como reflejan tanto los datos de manufacturas como los precios de las materias primas. La aceleración de la vacunación prevista para el segundo semestre del año en el mundo emergente probablemente también favorecerá a la dinámica del crecimiento doméstico. Prevemos un rebote del EBITDA de la deuda corporativa de ME y una mejora de las métricas de apalancamiento de las empresas. Un aumento exagerado de los tipos de interés estadounidenses podría suponer un riesgo de cola para esta clase de activos, aunque nuestra hipótesis central es que los tipos subirán gradualmente en los próximos trimestres, lo cual no creemos que trastoque excesivamente las condiciones de financiación ni los resultados de los diferenciales de ME. Creemos que las valoraciones de la deuda soberana y corporativa en monedas fuertes se han situado dentro de una gama de valor razonable, pero todavía atractiva en comparación con los mercados desarrollados.

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		6.178.515.312	5.769.974.797
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	241.313.245	338.863.980
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		20.525	3.253
Cuentas a percibir por acciones emitidas		41.669.745	12.886.596
Ingresos a percibir y otros activos		74.280.803	68.748.284
Activos totales		6.535.799.630	6.190.476.910
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		86.031.501	6.117.658
Descubierto bancario	3	4.319	2.642
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		8.845.303	6.659.741
Gastos devengados		3.929.028	3.621.458
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		64.210.079	-
Otras cuentas por pagar		136.781	205.838
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		163.157.011	16.607.337
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		6.372.642.619	6.173.869.573

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		125.817.200	121.904.782
Ingresos por dividendos		–	37.500
Ingresos por préstamo de valores	15	68.701	10.113
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(186.755.710)	(270.865.025)
		(60.869.809)	(148.912.630)
Gastos			
Comisión de gestión	5	17.454.710	15.378.965
Comisión de distribución	5	622.570	600.943
Comisión de administración	5	2.076.501	2.680.773
Comisión de compromiso	16	448.082	308.190
Comisión de depósito	5	236.317	250.778
Comisión del Depositario	5	150.427	270.585
Honorarios profesionales	7	225.592	164.504
Honorarios de los Consejeros	6	2.413	2.375
Costes de transacciones	7	84.066	69.467
Honorarios de auditoría	7	15.023	14.687
Reembolso de IVA		(28.518)	(17.986)
Otros gastos	7	22.150	72.149
Gastos totales		21.309.333	19.795.430
Costes financieros			
Gastos por intereses		615	978
Repartos de dividendos abonados	1	30.087.261	33.088.399
		30.087.876	33.089.377
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		(112.267.018)	(201.797.437)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	6.173.869.573	5.893.213.219
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	(112.267.018)	(201.797.437)
Suscripciones	1.700.999.584	1.521.365.025
Reembolsos	(1.389.959.520)	(1.781.752.193)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	6.372.642.619	5.431.028.614

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

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 de empresa 70,64% (31 de diciembre de 2020: 67,32%)					
Euro					
15.300.000	NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance Plc*	7,13%	19/07/2024	18.916.853	0,30
9.091.000	Novolipetsk Steel Via Steel Funding DAC*	1,45%	02/06/2026	10.788.788	0,17
2.000.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	2,88%	25/10/2025	2.542.463	0,04
10.000.000	Petroleos Mexicanos*	1,88%	21/04/2022	11.884.624	0,19
10.000.000	Petroleos Mexicanos*	3,75%	21/02/2024	12.222.320	0,19
14.243.000	Petroleos Mexicanos*	5,13%	15/03/2023	17.766.751	0,28
Total euro				74.121.799	1,17
Dólar estadounidense					
128.200.000	1MDB Energy Ltd**	5,99%	11/05/2022	132.678.435	2,08
11.000.000	1MDB Global Investments Ltd**	4,40%	09/03/2023	11.093.295	0,17
6.777.000	ABJA Investment Co Pte Ltd*	5,95%	31/07/2024	7.338.474	0,12
21.654.000	ABQ Finance Ltd*	1,88%	08/09/2025	21.605.258	0,34
11.556.000	ABQ Finance Ltd*	2,00%	06/07/2026	11.460.663	0,18
13.043.000	ABQ Finance Ltd*	3,13%	24/09/2024	13.659.608	0,21
6.100.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd*	3,38%	24/07/2024	6.348.466	0,10
5.000.000	ADCB Finance Cayman Ltd*	4,50%	06/03/2023	5.274.603	0,08
7.000.000	Africa Finance Corp*	3,88%	13/04/2024	7.419.548	0,12
6.009.000	African Export-Import Bank*	2,63%	17/05/2026	6.080.144	0,10
3.000.000	African Export-Import Bank*	4,13%	20/06/2024	3.202.957	0,05
300.000	African Export-Import Bank*	5,25%	11/10/2023	324.980	0,01
809.000	Akbank TAS*	5,00%	24/10/2022	831.716	0,01
8.000.000	AKCB Finance Ltd*	4,75%	09/10/2023	8.644.491	0,14
5.000.000	Alfa SAB de CV**	5,25%	25/03/2024	5.459.600	0,09
881.000	Alpek SAB de CV**	5,38%	08/08/2023	956.515	0,02
18.012.000	APICORP Sukuk Ltd*	3,14%	01/11/2022	18.643.095	0,29
26.613.000	Arab Petroleum Investments Corp*	4,13%	18/09/2023	28.546.507	0,45
2.000.000	Arabian Centres Sukuk II Ltd*	5,63%	07/10/2026	2.129.060	0,03
19.700.000	Azure Orbit IV International Finance Ltd*	3,75%	25/01/2023	20.413.363	0,32
9.872.000	Azure Power Energy Ltd*	5,50%	03/11/2022	10.032.677	0,16
2.352.000	Baidu Inc**	1,72%	09/04/2026	2.376.031	0,04
17.428.000	Banco Bradesco SA*	3,20%	27/01/2025	17.953.367	0,28
19.182.000	Banco BTG Pactual SA*	2,75%	11/01/2026	18.717.028	0,29
14.616.000	Banco BTG Pactual SA*	4,50%	10/01/2025	15.327.799	0,24
5.000.000	Banco BTG Pactual SA*	5,50%	31/01/2023	5.275.200	0,08
10.287.000	Banco BTG Pactual SA*	5,75%	28/09/2022	10.778.204	0,17

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

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 70,64% (31 de diciembre de 2020: 67,32%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
10.000.000	Banco de Bogota SA ⁺	6,25%	12/05/2026	10.962.850	0,17
15.000.000	Banco de Credito del Peru ^{**}	2,70%	11/01/2025	15.536.250	0,24
8.861.000	Banco del Estado de Chile ⁺	2,70%	09/01/2025	9.237.681	0,14
13.000.000	Banco do Brasil SA ⁺	3,88%	10/10/2022	13.390.910	0,21
15.515.000	Banco do Brasil SA ⁺	4,88%	19/04/2023	16.427.515	0,26
14.600.000	Banco Inbursa SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Inbursa ⁺	4,13%	06/06/2024	15.702.227	0,25
1.820.000	Banco Internacional del Peru SAA Interbank ^{**}	3,38%	18/01/2023	1.854.289	0,03
6.097.000	Banco Santander Chile ^{**}	2,70%	10/01/2025	6.372.341	0,10
29.676.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand ^{**}	5,38%	17/04/2025	33.708.672	0,53
13.524.000	Banco Votorantim SA ^{**}	4,50%	24/09/2024	14.298.046	0,22
8.000.000	Bancolombia SA ⁺	3,00%	29/01/2025	8.226.000	0,13
4.854.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT ⁺	4,75%	13/05/2025	5.411.271	0,08
13.512.000	Bank Muscat SAOG ⁺	4,75%	17/03/2026	14.038.268	0,22
11.000.000	Bank Muscat SAOG ⁺	4,88%	14/03/2023	11.412.190	0,18
3.132.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT ⁺	3,75%	30/03/2026	3.195.494	0,05
14.479.000	BBK BSC ⁺	5,50%	09/07/2024	15.359.999	0,24
28.127.000	BBVA Bancomer SA ⁺	6,75%	30/09/2022	29.922.065	0,47
18.000.000	Bharti Airtel International Netherlands BV ⁺	5,35%	20/05/2024	19.841.154	0,31
13.807.000	Black Sea Trade & Development Bank ⁺	3,50%	25/06/2024	14.579.108	0,23
3.988.000	Blossom Joy Ltd ⁺	3,10%	29/12/2049	4.076.080	0,06
9.685.000	BOC Aviation Ltd ⁺	1,75%	21/01/2026	9.591.390	0,15
6.600.000	BOC Aviation Ltd ⁺	2,75%	02/12/2023	6.818.861	0,11
3.230.000	BOC Aviation Ltd ⁺	3,25%	29/04/2025	3.403.615	0,05
5.000.000	BOC Aviation Ltd ⁺	4,00%	25/01/2024	5.315.074	0,08
1.770.000	BOC Aviation USA Corp ⁺	1,63%	29/04/2024	1.785.888	0,03
3.350.000	BOC Aviation USA Corp ⁺	1,63%	29/04/2024	3.378.617	0,05
5.432.000	Bocom International Holdings Co Ltd ⁺	1,75%	28/06/2026	5.430.379	0,09
6.000.000	Bocom Leasing Management Hong Kong Co Ltd ⁺	4,00%	22/01/2022	6.089.213	0,10
5.000.000	Boubyan Sukuk Ltd ^{**}	2,59%	18/02/2025	5.195.183	0,08
16.500.000	Braskem Finance Ltd ^{**}	6,45%	03/02/2024	18.665.625	0,29
39.936.049	Brazil Loan Trust 1 ⁺	5,48%	24/07/2023	41.573.826	0,65
50.919.400	Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais ⁺	5,33%	15/02/2028	55.285.739	0,87
25.694.000	CBQ Finance Ltd ⁺	2,00%	15/09/2025	25.843.932	0,41
24.069.000	CBQ Finance Ltd ⁺	2,00%	12/05/2026	23.993.784	0,38
7.918.000	CCBL Cayman 1 Corp Ltd ⁺	1,99%	21/07/2025	7.923.670	0,12
24.038.000	CCBL Cayman 1 Corp Ltd ⁺	3,50%	16/05/2024	25.496.554	0,40
3.000.000	CDBL Funding 1 ⁺	1,41%	15/11/2021	3.004.125	0,05
11.821.000	CDBL Funding 1 ⁺	1,50%	04/11/2023	11.834.619	0,19

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

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 70,64% (31 de diciembre de 2020: 67,32%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
1.293.000	CDBL Funding 1 [*]	3,00%	24/04/2023	1.327.307	0,02
1.500.000	CDBL Funding 2 [*]	1,34%	18/07/2021	1.500.238	0,02
12.000.000	CDBL Funding 2 [*]	2,00%	04/03/2026	11.982.698	0,19
25.000.000	CDBL Funding 2 [*]	3,75%	11/03/2022	25.414.253	0,40
3.000.000	Centrais Eletricas Brasileiras SA**	3,63%	04/02/2025	3.096.180	0,05
7.800.000	Central American Bank for Economic Integration [*]	1,14%	09/02/2026	7.779.837	0,12
1.593.000	Champion Path Holdings Ltd [*]	4,50%	27/01/2026	1.652.909	0,03
5.000.000	China Cinda Finance 2015 I Ltd [*]	4,25%	23/04/2025	5.240.822	0,08
3.000.000	China Cinda Finance 2020 I Management Ltd [*]	1,25%	20/01/2024	2.892.649	0,05
32.500.000	China Construction Bank Corp [*]	1,00%	04/08/2023	32.557.945	0,51
13.000.000	China Construction Bank Corp [*]	1,25%	04/08/2025	12.931.784	0,20
3.000.000	China Evergrande Group [*]	8,25%	23/03/2022	2.558.929	0,04
2.709.000	China Hongqiao Group Ltd [*]	6,25%	08/06/2024	2.760.349	0,04
23.271.000	China Huadian Overseas Development 2018 Ltd [*]	3,38%	29/12/2049	23.938.878	0,38
29.108.000	China Huadian Overseas Development Management Co Ltd [*]	4,00%	29/12/2049	30.522.068	0,48
47.383.000	China Minmetals Corp [*]	3,75%	29/12/2049	48.402.597	0,76
3.788.000	China Overseas Grand Oceans Finance IV Cayman Ltd [*]	2,45%	09/02/2026	3.791.633	0,06
13.174.000	Chinalco Capital Holdings Ltd [*]	2,13%	03/06/2026	13.114.601	0,21
6.442.000	Chinalco Capital Holdings Ltd [*]	4,10%	29/12/2049	6.708.541	0,11
20.240.000	Chinalco Capital Holdings Ltd [*]	4,25%	21/04/2022	20.567.496	0,32
4.337.000	CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd [*]	1,75%	10/08/2023	4.364.077	0,07
5.777.000	CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd [*]	2,00%	26/01/2026	5.752.786	0,09
4.000.000	CIFI Holdings Group Co Ltd [*]	5,95%	20/10/2025	4.219.423	0,07
3.800.000	CITIC Securities Finance MTN Co Ltd [*]	2,00%	03/06/2025	3.816.121	0,06
13.000.000	CMB International Leasing Management Ltd [*]	1,88%	12/08/2025	12.889.229	0,20
2.500.000	CMB International Leasing Management Ltd [*]	2,00%	04/02/2026	2.476.338	0,04
9.696.000	Comision Federal de Electricidad*	4,75%	23/02/2027	10.857.678	0,17
41.043.000	Comision Federal de Electricidad*	4,88%	15/01/2024	44.784.275	0,70
18.000.000	Corp Andina de Fomento*	2,38%	12/05/2023	18.605.773	0,29
5.000.000	Country Garden Holdings Co Ltd*	3,13%	22/10/2025	5.014.828	0,08
6.000.000	Country Garden Holdings Co Ltd*	6,15%	17/09/2025	6.578.950	0,10
5.000.000	Country Garden Holdings Co Ltd*	8,00%	27/01/2024	5.254.087	0,08
4.828.000	Credicorp Ltd**	2,75%	17/06/2025	4.912.128	0,08
15.623.000	Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc*	4,70%	29/01/2025	16.166.988	0,25
3.800.000	CSCIF Asia Ltd*	1,75%	04/08/2025	3.770.944	0,06
56.713.000	CSN Resources SA**	7,63%	13/02/2023	59.021.219	0,93
26.040.000	CSN Resources SA**	7,63%	17/04/2026	28.115.128	0,44
2.875.000	Dianjian Haiyu Ltd*	3,50%	29/12/2049	2.910.932	0,05

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

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 70,64% (31 de diciembre de 2020: 67,32%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
13.401.000	Dianjian Haiyu Ltd*	4,30%	29/12/2049	13.950.776	0,22
12.400.000	Dianjian International Finance Ltd*	4,60%	29/12/2049	12.803.282	0,20
17.953.000	DIB Sukuk Ltd*	1,96%	22/06/2026	17.966.593	0,28
7.000.000	DIB Sukuk Ltd*	2,95%	20/02/2025	7.325.537	0,11
24.586.000	DIB Sukuk Ltd*	2,95%	16/01/2026	25.653.087	0,40
23.535.000	DIB Sukuk Ltd*	3,63%	06/02/2023	24.501.035	0,38
12.000.000	DIB Sukuk Ltd*	3,66%	14/02/2022	12.206.274	0,19
21.500.000	DP World Crescent Ltd*	3,91%	31/05/2023	22.624.714	0,36
32.843.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank*	4,88%	23/05/2024	34.581.708	0,54
8.600.000	Eastern Creation II Investment Holdings Ltd*	1,00%	10/09/2023	8.581.535	0,13
2.000.000	Ecopetrol SA*	5,88%	18/09/2023	2.164.450	0,03
16.949.000	EI Sukuk Co Ltd*	1,83%	23/09/2025	17.037.229	0,27
1.000.000	Embraer Netherlands Finance BV**	5,05%	15/06/2025	1.057.400	0,02
7.080.000	Embraer Overseas Ltd**	5,70%	16/09/2023	7.571.352	0,12
29.420.000	Emirates Development Bank PJSC*	1,64%	15/06/2026	29.604.375	0,46
28.200.000	Emirates Development Bank PJSC*	3,52%	06/03/2024	30.086.654	0,47
8.488.000	Emirates NBD Bank PJSC*	1,64%	13/01/2026	8.519.013	0,13
11.462.000	Emirates NBD Bank PJSC*	2,63%	18/02/2025	11.976.841	0,19
7.000.000	Energean Israel Finance Ltd*	4,50%	30/03/2024	7.148.345	0,11
3.766.000	Evraz Plc*	6,75%	31/01/2022	3.885.382	0,06
10.714.000	Fab Sukuk Co Ltd*	1,41%	14/01/2026	10.670.115	0,17
13.000.000	Fab Sukuk Co Ltd*	3,63%	05/03/2023	13.638.459	0,21
20.457.000	Fab Sukuk Co Ltd*	3,88%	22/01/2024	21.972.344	0,34
10.000.000	Falabella SA*	3,75%	30/04/2023	10.419.500	0,16
7.288.000	Far East Horizon Ltd*	2,20%	05/07/2021	7.288.000	0,11
11.700.000	Franshion Brilliant Ltd*	3,20%	09/04/2026	11.757.559	0,18
9.693.000	FS Luxembourg Sarl**	10,00%	15/12/2025	10.856.596	0,17
25.200.000	Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA*	4,95%	19/07/2022	26.207.773	0,41
21.000.000	Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA*	5,15%	11/02/2026	23.609.911	0,37
15.007.000	Genneia SA**	8,75%	20/01/2022	14.574.123	0,23
10.000.000	Geopark Ltd**	5,50%	17/01/2027	10.112.600	0,16
11.500.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd*	5,13%	15/05/2024	12.555.643	0,20
6.002.000	Greenko Dutch BV**	3,85%	29/03/2026	6.156.552	0,10
6.000.000	Greenland Global Investment Ltd*	6,25%	16/12/2022	5.728.128	0,09
7.500.000	Greenland Global Investment Ltd*	6,75%	25/06/2022	6.940.955	0,11
9.004.000	Greenland Global Investment Ltd*	6,75%	26/09/2023	7.431.211	0,12
13.004.000	Grupo Aval Ltd**	4,75%	26/09/2022	13.391.519	0,21
687.000	GTL Trade Finance Inc/Gerdau Holdings Inc*	5,89%	29/04/2024	773.589	0,01

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

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 70,64% (31 de diciembre de 2020: 67,32%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
38.136.000	Gulf International Bank BSC*	2,38%	23/09/2025	38.504.359	0,60
25.000.000	Gulf International Bank BSC*	3,50%	25/03/2022	25.421.734	0,40
2.000.000	Guotai Junan Holdings Ltd*	3,88%	11/03/2022	2.035.000	0,03
10.000.000	Haitong International Securities Group Ltd*	3,13%	18/05/2025	10.413.670	0,16
4.000.000	Hana Bank*	0,85%	02/10/2022	4.017.800	0,06
13.500.000	Harvest Operations Corp*	3,00%	21/09/2022	13.912.567	0,22
2.500.000	Harvest Operations Corp*	4,20%	01/06/2023	2.663.859	0,04
5.000.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS*	4,49%	25/11/2024	5.075.000	0,08
4.000.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS*	5,00%	06/04/2023	4.087.932	0,06
16.367.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS*	5,13%	22/06/2026	16.345.422	0,26
42.000.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS*	5,80%	21/02/2022	42.759.648	0,67
11.750.000	HBIS Group Hong Kong Co Ltd*	3,75%	18/12/2022	11.662.132	0,18
8.962.000	Henan Water Conservancy Investment Group Co Ltd*	2,80%	18/09/2025	8.954.785	0,14
1.351.000	Hengjian International Investment Ltd*	1,88%	23/06/2025	1.342.402	0,02
16.665.000	Hikma Finance USA LLC*	3,25%	09/07/2025	17.372.596	0,27
4.795.000	Horse Gallop Finance Ltd*	1,70%	28/07/2025	4.786.292	0,08
18.569.000	HPHT Finance 19 Ltd*	2,88%	05/11/2024	19.476.782	0,31
2.226.000	HPHT Finance 21 Ltd*	2,00%	19/03/2026	2.259.577	0,04
6.350.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd*	1,32%	07/11/2022	4.876.800	0,08
17.722.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd*	2,03%	27/04/2022	14.532.040	0,23
12.400.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd*	4,00%	29/12/2049	7.734.500	0,12
6.130.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd*	4,50%	29/12/2049	4.155.159	0,07
6.000.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	1,28%	24/02/2023	4.487.430	0,07
2.800.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	2,13%	30/09/2023	2.135.336	0,03
9.600.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	3,25%	13/11/2024	7.106.784	0,11
3.000.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	3,75%	29/05/2024	2.220.825	0,03
10.000.000	Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru**	6,38%	01/06/2028	10.562.500	0,17
5.000.000	Hyundai Capital America**	2,38%	10/02/2023	5.134.290	0,08
10.000.000	Hyundai Capital America**	2,65%	10/02/2025	10.477.406	0,16
15.000.000	Hyundai Capital America**	3,40%	20/06/2024	16.004.765	0,25
769.000	ICBCIL Finance Co Ltd*	1,26%	15/05/2023	765.443	0,01
17.419.000	ICBCIL Finance Co Ltd*	1,75%	25/08/2025	17.465.001	0,27
30.000.000	ICBCIL Finance Co Ltd*	3,65%	05/03/2022	30.481.237	0,48
15.000.000	IHS Netherlands Holdco BV**	7,13%	18/03/2025	15.675.000	0,25
6.000.000	IHS Netherlands Holdco BV**	8,00%	18/09/2027	6.495.130	0,10
12.000.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd*	1,00%	09/09/2023	12.060.207	0,19
6.622.000	Inventive Global Investments Ltd*	1,50%	15/07/2023	6.643.782	0,10
5.800.000	Itau Unibanco Holding SA**	2,90%	24/01/2023	5.939.838	0,09

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

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 70,64% (31 de diciembre de 2020: 67,32%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
5.531.000	Itau Unibanco Holding SA**	3,25%	24/01/2025	5.695.547	0,09
30.672.000	JBS USA Food Co*	7,00%	15/01/2026	32.596.821	0,51
10.000.000	JIC Zhixin Ltd*	3,00%	24/11/2022	10.258.655	0,16
11.000.000	JSW Steel Ltd*	5,95%	18/04/2024	11.751.855	0,18
3.000.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	9,75%	28/09/2023	2.950.519	0,05
2.000.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	10,88%	23/07/2023	1.997.242	0,03
6.000.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	11,25%	09/04/2022	6.128.795	0,10
6.000.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	11,95%	22/10/2022	6.171.750	0,10
3.000.000	Kallpa Generacion SA*	4,13%	16/08/2027	3.086.940	0,05
2.000.000	KazMunayGas National Co JSC*	4,75%	24/04/2025	2.239.854	0,04
5.577.000	Kenbourne Invest SA**	6,88%	26/11/2024	5.927.626	0,09
5.000.000	KOC Holding AS*	5,25%	15/03/2023	5.150.184	0,08
4.000.000	Kookmin Bank*	1,07%	09/06/2022	4.022.740	0,06
6.079.000	Kookmin Bank*	1,38%	06/05/2026	6.087.845	0,10
15.000.000	Korean Air Lines Co Ltd*	2,00%	04/09/2022	15.170.824	0,24
8.873.000	Kuwait Projects Co SPC Ltd*	5,00%	15/03/2023	9.186.736	0,14
15.000.000	Kyobo Life Insurance Co Ltd*	3,95%	29/12/2049	15.316.875	0,24
16.192.000	Leader Goal International Ltd*	4,25%	29/12/2049	16.577.174	0,26
7.451.000	Legend Holdings Corp*	1,38%	02/06/2024	7.465.051	0,12
3.000.000	Levc Finance Ltd*	1,38%	25/03/2024	3.002.979	0,05
32.406.920	Leviathan Bond Ltd*	5,75%	30/06/2023	33.947.271	0,54
19.576.092	Leviathan Bond Ltd*	6,13%	30/06/2025	21.562.730	0,34
29.006.000	Mashreqbank PSC*	4,25%	26/02/2024	31.070.977	0,49
30.500.000	MDGH - GMTN BV*	2,50%	07/11/2024	32.021.515	0,50
5.000.000	MDGH - GMTN BV*	2,75%	11/05/2023	5.200.203	0,08
9.800.000	MDGH - GMTN BV*	3,00%	19/04/2024	10.386.734	0,16
3.000.000	Medco Bell Pte Ltd*	6,38%	30/01/2027	3.098.520	0,05
14.355.000	MEGlobal Canada ULC*	5,00%	18/05/2025	16.133.441	0,25
3.765.000	Meituan*	2,13%	28/10/2025	3.738.376	0,06
8.000.000	Melco Resorts Finance Ltd**	4,88%	06/06/2025	8.198.000	0,13
6.000.000	Melco Resorts Finance Ltd*	5,25%	26/04/2026	6.231.750	0,10
3.818.000	MercadoLibre Inc**	2,38%	14/01/2026	3.847.628	0,06
11.000.000	Metinvest BV*	8,50%	23/04/2026	12.560.482	0,20
12.000.000	MGM China Holdings Ltd**	5,38%	15/05/2024	12.355.260	0,19
7.000.000	MHP SE*	7,75%	10/05/2024	7.619.899	0,12
11.983.000	Minera y Metalurgica del Boleo SAPI de CV*	3,25%	17/04/2024	12.710.120	0,20
29.648.000	Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd*	3,38%	29/12/2049	30.389.200	0,48
12.800.000	Minsheng Hong Kong International Leasing Ltd Via Landmark Funding 2019 Ltd*	4,50%	26/03/2022	12.851.328	0,20

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

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 70,64% (31 de diciembre de 2020: 67,32%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
26.300.000	Minsur SA**	6,25%	07/02/2024	28.193.995	0,44
11.000.000	MTN Mauritius Investments Ltd*	4,76%	11/11/2024	11.738.467	0,18
22.500.000	MTN Mauritius Investments Ltd*	5,37%	13/02/2022	22.980.176	0,36
8.500.000	Muthoot Finance Ltd*	4,40%	02/09/2023	8.767.750	0,14
15.287.000	NBK SPC Ltd*	2,75%	30/05/2022	15.555.057	0,24
6.000.000	Nexa Resources SA**	5,38%	04/05/2027	6.460.380	0,10
16.000.000	Oil & Gas Holding Co BSCC*	7,63%	07/11/2024	17.888.052	0,28
23.127.000	Pampa Energia SA*	7,38%	21/07/2023	22.532.752	0,35
8.000.000	Periama Holdings LLC*	5,95%	19/04/2026	8.661.498	0,14
5.000.000	Perusahaan Gas Negara Tbk PT*	5,13%	16/05/2024	5.550.472	0,09
15.000.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	5,50%	22/11/2021	15.273.000	0,24
28.554.000	Petrobras Global Finance BV*	7,38%	17/01/2027	35.229.211	0,55
9.638.000	Petroleos Mexicanos*	6,50%	13/03/2027	10.184.956	0,16
6.000.000	Petroleos Mexicanos**	6,88%	04/08/2026	6.564.900	0,10
7.733.000	Petropavlovsk 2016 Ltd*	8,13%	14/11/2022	8.032.328	0,13
9.002.000	Philippine National Bank*	3,28%	27/09/2024	9.450.473	0,15
4.763.000	Powerchina Real Estate Group Ltd*	4,50%	06/12/2021	4.818.495	0,08
6.571.000	Powerchina Roadbridge Group British Virgin Islands Ltd*	3,08%	29/12/2049	6.573.957	0,10
6.245.000	Qatar Petroleum Development Co*	1,38%	12/09/2026	6.239.067	0,10
7.744.000	QIB Sukuk Ltd*	1,95%	27/10/2025	7.837.960	0,12
9.975.000	QIB Sukuk Ltd*	3,25%	23/05/2022	10.176.444	0,16
35.492.000	QIB Sukuk Ltd†	3,98%	26/03/2024	38.074.783	0,60
10.646.000	QIIB Senior Sukuk Ltd†	4,26%	05/03/2024	11.483.576	0,18
39.035.000	QNB Finance Ltd†	2,63%	12/05/2025	40.907.665	0,64
34.444.000	QNB Finance Ltd*	3,50%	28/03/2024	36.719.668	0,58
19.000.000	QNB Finansbank AS*	4,88%	19/05/2022	19.397.931	0,30
30.157.000	QNB Finansbank AS*	6,88%	07/09/2024	32.742.963	0,51
9.157.000	Rakfunding Cayman Ltd*	4,13%	09/04/2024	9.810.778	0,15
26.000.000	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co Ltd 3**	6,33%	30/09/2027	29.911.700	0,47
14.990.000	REC Ltd*	3,38%	25/07/2024	15.589.721	0,24
20.769.000	REC Ltd*	3,50%	12/12/2024	21.772.119	0,34
6.000.000	REC Ltd*	4,75%	19/05/2023	6.327.919	0,10
5.000.000	REC Ltd*	5,25%	13/11/2023	5.395.693	0,08
7.500.000	Republic of Angola Via Avenir II BV*	4,66%	07/12/2023	7.395.000	0,12
8.571.429	Republic of Angola Via Avenir Issuer II Ireland DAC*	6,93%	19/02/2027	8.014.286	0,13
3.963.000	RKPF Overseas 2019 A Ltd*	6,70%	30/09/2024	4.216.810	0,07
25.000.000	Rongshi International Finance Ltd*	3,25%	21/05/2024	26.467.200	0,42
5.000.000	Rusal Capital DAC*	5,13%	02/02/2022	5.066.100	0,08

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

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 70,64% (31 de diciembre de 2020: 67,32%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
19.800.000	SA Global Sukuk Ltd*	1,60%	17/06/2026	19.783.779	0,31
3.000.000	SABIC Capital II BV*	4,00%	10/10/2023	3.217.418	0,05
10.000.000	Saka Energi Indonesia PT*	4,45%	05/05/2024	9.507.400	0,15
23.541.000	Samba Funding Ltd*	2,75%	02/10/2024	24.566.795	0,39
910.000	Sands China Ltd**	3,80%	08/01/2026	975.265	0,02
9.980.000	Sands China Ltd*	4,60%	08/08/2023	10.631.844	0,17
5.000.000	Sands China Ltd*	5,13%	08/08/2025	5.598.950	0,09
22.000.000	Sasol Financing International Ltd*	4,50%	14/11/2022	22.596.200	0,35
34.500.000	Sasol Financing USA LLC*	5,88%	27/03/2024	36.932.768	0,58
3.000.000	Saudi Arabian Oil Co*	1,25%	24/11/2023	3.033.102	0,05
4.000.000	Saudi Arabian Oil Co*	1,63%	24/11/2025	4.036.152	0,06
6.700.000	Saudi Arabian Oil Co*	2,75%	16/04/2022	6.817.841	0,11
50.000.000	Saudi Arabian Oil Co*	2,88%	16/04/2024	52.616.847	0,83
29.944.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 4*	4,22%	27/01/2024	32.413.419	0,51
24.423.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 5*	1,74%	17/09/2025	24.734.593	0,39
5.000.000	Severstal OAO Via Steel Capital SA*	5,90%	17/10/2022	5.306.359	0,08
1.000.000	Shimao Group Holdings Ltd*	5,60%	15/07/2026	1.047.692	0,02
5.000.000	Shimao Group Holdings Ltd*	6,13%	21/02/2024	5.152.367	0,08
10.700.000	Shinhan Bank Co Ltd*	3,88%	07/12/2026	10.828.252	0,17
9.615.000	Shinhan Financial Group Co Ltd*	1,35%	10/01/2026	9.610.307	0,15
12.000.000	Shriram Transport Finance Co Ltd*	4,40%	13/03/2024	12.057.000	0,19
3.000.000	SIHC International Capital Ltd*	3,95%	26/09/2021	3.016.042	0,05
9.400.000	Sinopec Group Overseas Development 2012 Ltd**	3,90%	17/05/2022	9.651.356	0,15
1.400.000	Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd**	4,38%	10/04/2024	1.527.774	0,02
2.000.000	Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd*	3,00%	12/04/2022	2.035.868	0,03
36.866.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd**	1,45%	08/01/2026	36.932.323	0,58
23.800.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*	2,15%	13/05/2025	24.374.463	0,38
27.104.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*	2,50%	08/08/2024	28.202.724	0,44
7.000.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*	2,50%	12/11/2024	7.345.114	0,12
31.000.000	Southern Gas Corridor CJSC*	6,88%	24/03/2026	37.138.310	0,58
4.702.000	Spic 2018 Usd Senior Perpetual Bond Co Ltd*	5,80%	29/12/2049	4.890.025	0,08
9.717.000	State Agency of Roads of Ukraine*	6,25%	24/06/2028	9.734.928	0,15
62.930.000	State Oil Co of the Azerbaijan Republic*	4,75%	13/03/2023	66.622.775	1,05
12.500.000	Studio City Finance Ltd*	6,00%	15/07/2025	13.159.375	0,21
9.837.000	Sunac China Holdings Ltd*	5,95%	26/04/2024	9.695.627	0,15
6.766.000	Sunac China Holdings Ltd*	6,50%	09/07/2023	6.899.458	0,11
3.000.000	Sunac China Holdings Ltd*	6,50%	10/01/2025	2.941.435	0,05
9.131.000	Sunac China Holdings Ltd*	6,50%	26/01/2026	8.802.042	0,14

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

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 70,64% (31 de diciembre de 2020: 67,32%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
1.783.000	Sunac China Holdings Ltd*	6,65%	03/08/2024	1.787.258	0,03
25.000.000	Sunac China Holdings Ltd*	7,35%	19/07/2021	25.024.257	0,39
14.159.000	Sunac China Holdings Ltd*	7,50%	01/02/2024	14.479.032	0,23
9.000.000	Sunac China Holdings Ltd*	7,95%	11/10/2023	9.272.272	0,15
8.500.000	SURA Asset Management SA**	4,88%	17/04/2024	9.201.250	0,14
35.040.000	Tecpetrol SA**	4,88%	12/12/2022	34.838.870	0,55
1.800.000	Tencent Holdings Ltd*	1,81%	26/01/2026	1.830.597	0,03
26.717.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd**	2,63%	15/08/2025	27.399.804	0,43
8.000.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV**	7,13%	31/01/2025	8.830.600	0,14
17.000.000	Trust Fibra Uno**	5,25%	15/12/2024	18.913.860	0,30
8.035.000	Trust Fibra Uno*	5,25%	30/01/2026	9.059.463	0,14
2.000.000	Tullow Oil Plc**	7,00%	01/03/2025	1.783.000	0,03
1.669.000	Tullow Oil Plc*	10,25%	15/05/2026	1.755.780	0,03
13.000.000	Turkiye Garanti Bankasi AS*	5,25%	13/09/2022	13.436.150	0,21
2.000.000	Turkiye Petrol Rafinerileri AS*	4,50%	18/10/2024	2.003.602	0,03
3.654.000	Turkiye Sinai Kalkinma Bankasi AS*	6,00%	23/01/2025	3.713.701	0,06
5.000.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*	5,50%	27/10/2021	5.049.932	0,08
10.000.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*	5,63%	30/05/2022	10.213.086	0,16
13.201.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*	6,50%	08/01/2026	13.493.253	0,21
3.166.667	Ukreximbank Via Biz Finance Plc*	9,63%	27/04/2022	3.262.047	0,05
11.858.000	Unigel Luxembourg SA*	8,75%	01/10/2026	12.872.570	0,20
10.100.000	United Bank for Africa Plc*	7,75%	08/06/2022	10.426.401	0,16
24.000.000	Unity 1 Sukuk Ltd*	3,86%	30/11/2021	24.266.433	0,38
13.000.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	13,88%	21/01/2024	14.272.635	0,22
13.000.000	Vedanta Resources Ltd*	6,38%	30/07/2022	12.855.505	0,20
6.500.000	Vedanta Resources Ltd*	7,13%	31/05/2023	6.032.065	0,09
18.941.000	VEON Holdings BV**	4,00%	09/04/2025	20.013.724	0,31
9.000.000	VEON Holdings BV**	5,95%	13/02/2023	9.588.285	0,15
14.194.000	VEON Holdings BV*	7,25%	26/04/2023	15.435.294	0,24
2.000.000	VF Ukraine PAT via VFU Funding Plc*	6,20%	11/02/2025	2.085.015	0,03
5.800.000	Vigorous Champion International Ltd*	2,75%	02/06/2025	5.932.294	0,09
5.476.000	Volcan Compania Minera SAA*	4,38%	11/02/2026	5.439.147	0,09
15.488.000	Volcan Compania Minera SAA**	5,38%	02/02/2022	15.696.468	0,25
3.000.000	Weibo Corp*	3,50%	05/07/2024	3.167.070	0,05
8.000.000	Weichai International Hong Kong Energy Group Co Ltd*	3,75%	29/12/2049	8.149.850	0,13
8.000.000	Wynn Macau Ltd*	4,88%	01/10/2024	8.104.640	0,13
3.000.000	Xi Yang Overseas Ltd*	4,30%	05/06/2024	3.179.684	0,05
9.800.000	Xingsheng BVI Co Ltd*	3,38%	25/07/2022	9.976.963	0,16

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

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 70,64% (31 de diciembre de 2020: 67,32%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
29.654.000	XP Inc**	3,25%	01/07/2026	29.357.460	0,46
6.000.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS*	5,75%	24/02/2022	6.120.062	0,10
29.196.000	YPF SA*	8,50%	23/03/2025	26.094.071	0,41
5.829.000	Yunda Holding Investment Ltd*	2,25%	19/08/2025	5.739.125	0,09
3.000.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd*	6,00%	25/10/2023	2.616.630	0,04
12.844.000	Zhejiang Seaport International Co Ltd*	1,98%	17/03/2026	12.896.436	0,20
Total dólar estadounidense				4.427.193.773	69,47
Total bonos de empresa				4.501.315.572	70,64
Bonos del Estado 25,63% (31 de diciembre de 2020: 24,07%)					
Euro					
19.000.000	Egypt Government International Bond*	4,75%	11/04/2025	23.500.585	0,37
25.745.000	Ivory Coast Government International Bond*	5,13%	15/06/2025	34.056.793	0,53
22.165.000	Romanian Government International Bond*	2,75%	26/02/2026	29.061.677	0,46
12.500.000	Senegal Government International Bond*	4,75%	13/03/2028	15.436.045	0,24
13.907.000	Turkey Government International Bond*	4,38%	08/07/2027	16.385.936	0,26
6.000.000	Ukraine Government International Bond**	6,75%	20/06/2026	7.759.115	0,12
Total euro				126.200.151	1,98
Dólar estadounidense					
33.000.000	Abu Dhabi Government International Bond*	2,13%	30/09/2024	34.524.195	0,54
11.770.000	Abu Dhabi Government International Bond*	2,50%	11/10/2022	12.094.031	0,19
14.000.000	Abu Dhabi Government International Bond*	2,50%	16/04/2025	14.873.329	0,24
7.396.000	Airport Authority*	2,10%	29/12/2049	7.436.308	0,12
25.900.000	Angolan Government International Bond*	9,50%	12/11/2025	28.302.076	0,44
56.573.310	Argentine Republic Government International Bond*	0,13%	09/07/2030	20.406.559	0,32
26.845.329	Argentine Republic Government International Bond*	1,00%	09/07/2029	10.232.903	0,16
14.859.000	Bermuda Government International Bond*	4,85%	06/02/2024	16.417.783	0,26
10.944.000	Brazilian Government International Bond*	2,88%	06/06/2025	11.260.500	0,18
2.000.000	Brazilian Government International Bond*	6,00%	07/04/2026	2.340.890	0,04
17.780.000	Colombia Government International Bond*	3,88%	25/04/2027	18.914.897	0,30
43.510.000	Costa Rica Government International Bond*	4,25%	26/01/2023	44.254.021	0,69
16.000.000	Costa Rica Government International Bond*	4,38%	30/04/2025	16.588.000	0,26
24.500.000	Development Bank of Mongolia LLC*	7,25%	23/10/2023	26.392.968	0,41
30.000.000	Dominican Republic International Bond*	5,50%	27/01/2025	33.012.000	0,52
27.328.000	Dominican Republic International Bond*	5,88%	18/04/2024	29.104.320	0,46
10.000.000	Dominican Republic International Bond*	6,88%	29/01/2026	11.611.000	0,18
24.904.000	Dominican Republic International Bond*	8,63%	20/04/2027	30.592.074	0,48

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

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 del Estado 25,63% (31 de diciembre de 2020: 24,07%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
20.927.000	Egypt Government International Bond*	3,88%	16/02/2026	20.619.164	0,32
6.000.000	Egypt Government International Bond*	4,55%	20/11/2023	6.219.245	0,10
11.289.000	Egypt Government International Bond*	5,25%	06/10/2025	11.893.589	0,19
29.461.000	Egypt Government International Bond*	5,75%	29/05/2024	31.347.009	0,49
9.800.000	Egypt Government International Bond*	6,20%	01/03/2024	10.505.884	0,16
15.483.000	El Salvador Government International Bond*	7,75%	24/01/2023	15.369.974	0,24
4.239.000	Export-Import Bank of Korea*	1,05%	25/01/2022	4.256.125	0,07
7.454.000	Export-Import Bank of Korea*	1,10%	01/11/2022	7.526.937	0,12
18.600.000	Ghana Government International Bond*	6,38%	11/02/2027	18.681.155	0,29
41.700.000	Ghana Government International Bond*	8,13%	18/01/2026	44.903.427	0,70
18.655.000	Istanbul Metropolitan Municipality*	6,38%	09/12/2025	18.585.095	0,29
28.609.000	Ivory Coast Government International Bond*	5,38%	23/07/2024	30.704.059	0,48
4.091.669	Ivory Coast Government International Bond*	5,75%	31/12/2032	4.112.905	0,06
24.100.000	Ivory Coast Government International Bond*	6,38%	03/03/2028	26.473.878	0,42
15.000.000	Kenya Government International Bond*	6,88%	24/06/2024	16.473.402	0,26
15.000.000	Kenya Government International Bond*	7,00%	22/05/2027	16.449.865	0,26
18.418.000	Korea Development Bank*	0,62%	01/10/2022	18.474.650	0,29
15.000.000	Korea Development Bank*	3,25%	19/02/2024	16.055.414	0,25
4.325.000	Korea Expressway Corp*	1,13%	17/05/2026	4.302.056	0,07
23.468.000	Korea Housing Finance Corp*	3,00%	31/10/2022	24.215.027	0,38
34.802.000	Korea Resources Corp*	1,75%	15/04/2026	34.964.911	0,55
17.778.000	Korea Resources Corp*	4,00%	18/04/2023	18.754.387	0,29
20.329.000	Kuwait International Government Bond*	2,75%	20/03/2022	20.678.839	0,33
1.302.000	Mongolia Government International Bond*	5,13%	05/12/2022	1.360.609	0,02
4.500.000	Mongolia Government International Bond*	5,63%	01/05/2023	4.764.375	0,07
1.000.000	Mongolia Government International Bond*	8,75%	09/03/2024	1.153.518	0,02
12.250.000	Namibia International Bonds*	5,50%	03/11/2021	12.381.883	0,19
9.500.000	Oman Government International Bond*	3,88%	08/03/2022	9.618.478	0,15
40.324.000	Oman Government International Bond*	4,13%	17/01/2023	41.434.697	0,65
9.764.000	Oman Government International Bond*	4,88%	01/02/2025	10.218.846	0,16
31.000.000	Oman Government International Bond*	5,38%	08/03/2027	32.575.389	0,51
14.300.000	Peruvian Government International Bond*	7,35%	21/07/2025	17.575.558	0,28
3.827.964	Provincia de Cordoba*	5,00%	10/12/2025	2.973.180	0,05
7.000.000	Provincia de Mendoza Argentina*	2,75%	19/03/2029	4.602.500	0,07
41.361.000	Qatar Government International Bond*	3,38%	14/03/2024	44.359.853	0,70
9.800.000	Qatar Government International Bond*	3,40%	16/04/2025	10.673.071	0,17
29.793.000	Qatar Government International Bond*	3,88%	23/04/2023	31.629.697	0,50
21.000.000	Qatar Government International Bond*	4,50%	20/01/2022	21.478.872	0,34

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

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 del Estado 25,63% (31 de diciembre de 2020: 24,07%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
2.400.000	Republic of Armenia International Bond*	7,15%	26/03/2025	2.715.929	0,04
15.000.000	Republic of Azerbaijan International Bond*	4,75%	18/03/2024	16.258.293	0,25
6.100.000	Republic of South Africa Government International Bond*	4,67%	17/01/2024	6.572.750	0,10
39.000.000	Republic of South Africa Government International Bond*	5,88%	16/09/2025	44.119.961	0,70
39.241.648	Russian Foreign Bond - Eurobond*	7,50%	31/03/2030	45.187.300	0,71
14.974.000	Saudi Government International Bond*	2,38%	26/10/2021	15.063.856	0,24
13.291.000	Sri Lanka Government International Bond*	5,75%	18/01/2022	12.235.562	0,19
36.381.000	Sri Lanka Government International Bond*	5,75%	18/04/2023	27.376.703	0,43
8.000.000	Sri Lanka Government International Bond*	5,88%	25/07/2022	6.800.000	0,11
17.000.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,25%	27/07/2021	16.745.000	0,26
21.600.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,35%	28/06/2024	14.904.000	0,23
27.037.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,85%	14/03/2024	18.858.308	0,30
11.785.000	Turk Ihracat Kredi Bankasi AS*	5,75%	06/07/2026	11.712.510	0,18
10.000.000	Turkey Government International Bond*	4,25%	13/03/2025	9.831.220	0,15
20.791.000	Turkey Government International Bond*	5,60%	14/11/2024	21.414.002	0,34
22.000.000	Turkey Government International Bond*	5,75%	22/03/2024	22.871.332	0,36
12.000.000	Turkey Government International Bond**	6,25%	26/09/2022	12.480.943	0,20
17.290.000	Turkey Government International Bond*	6,38%	14/10/2025	18.141.152	0,28
39.000.000	Turkey Government International Bond*	7,25%	23/12/2023	42.154.125	0,66
5.500.000	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*	4,25%	18/09/2022	5.568.488	0,09
9.000.000	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*	5,00%	23/09/2021	9.045.283	0,14
7.000.000	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*	5,38%	24/10/2023	7.188.998	0,11
12.003.000	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*	8,25%	24/01/2024	13.022.306	0,20
15.000.000	Ukraine Government International Bond*	7,75%	01/09/2022	15.788.580	0,25
10.000.000	Ukraine Government International Bond*	7,75%	01/09/2023	10.795.460	0,17
10.000.000	Ukraine Government International Bond*	7,75%	01/09/2024	10.935.590	0,17
10.000.000	Ukraine Government International Bond*	7,75%	01/09/2025	10.977.200	0,17
19.500.000	Ukraine Government International Bond*	8,99%	01/02/2024	21.595.864	0,34
Total dólar estadounidense				1.507.086.092	23,65
Total bonos del Estado				1.633.286.243	25,63

Número de acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Fondos de inversión 0,52% (31 de diciembre de 2020: 0,53%)			
Dólar estadounidense			
300.000	Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	33.213.000	0,52
Total fondos de inversión ^h		33.213.000	0,52
Total inversiones		6.167.814.815	96,79

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,16% (31 de diciembre de 2020: 0,89%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
191.331.892 USD	158.809.000 €	04/08/2021	Goldman Sachs International	1	2.869.012	0,04
Clases AUD con cobertura						
81 USD	104 AUD	15/09/2021	Citibank NA	1	3	0,00
13.127 USD	16.964 AUD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	390	0,00
Clases CAD con cobertura						
968.000 CAD	774.362 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	7.348	0,00
406 USD	500 CAD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	2	0,00
Clases CHF con cobertura						
407 CHF	441 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
716.194 USD	657.718 CHF	15/09/2021	Westpac Banking Corp	10	3.192	0,00
819.083 USD	741.070 CHF	19/07/2021	Westpac Banking Corp	24	16.990	0,00
Clases EUR con cobertura						
1.436.387 €	1.705.917 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	189	0,00
250.277.825 USD	205.478.903 €	15/09/2021	UBS AG	1	6.215.035	0,10
18.671.625 USD	15.594.809 €	15/09/2021	Westpac Banking Corp	6	148.494	0,00
53.476.424 USD	43.981.319 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	22	1.300.202	0,02
Clases GBP con cobertura						
810.074 £	1.115.207 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	6	3.926	0,00
1.730.322 USD	1.225.559 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	24	37.188	0,00
1.208.149 USD	863.525 £	15/09/2021	Westpac Banking Corp	11	15.028	0,00
Clases JPY con cobertura						
2.445.514 USD	265.734.000 ¥	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	50.964	0,00
3.910.944 USD	430.837.000 ¥	15/09/2021	Westpac Banking Corp	3	26.625	0,00
Clases SEK con cobertura						
60.208 SEK	7.019 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	23	0,00
199.668 USD	1.667.515 SEK	19/07/2021	Westpac Banking Corp	26	4.654	0,00
34.128 USD	288.391 SEK	15/09/2021	Westpac Banking Corp	5	383	0,00
Clases SGD con cobertura						
3 SGD	3 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
102.029 SGD	75.817 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	8	71	0,00
55.624 USD	73.847 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	21	689	0,00
6.678 USD	8.859 SGD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	4	89	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					10.700.497	0,16
					Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados					6.178.515.312	96,95

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (1,35%) (31 de diciembre de 2020: (0,10%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases AUD con cobertura						
2.816.266 AUD	2.186.617 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(71.622)	(0,00)
Clases CAD con cobertura						
3.873.156 CAD	3.202.739 USD	15/09/2021	Royal Bank of Canada	1	(75.009)	(0,00)
484.500 CAD	397.821 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	(6.568)	(0,00)
17.191 USD	21.564 CAD	19/07/2021	Royal Bank of Canada	1	(223)	(0,00)
Clases CHF con cobertura						
553.894 CHF	614.880 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(15.378)	(0,00)
90.058.775 CHF	100.809.616 USD	15/09/2021	UBS AG	2	(3.181.012)	(0,05)
1.021.698 CHF	1.133.336 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	34	(27.509)	(0,00)
1.652.359 CHF	1.803.318 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	7	(12.071)	(0,00)
11 USD	10 CHF	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(0)	(0,00)
111.716 USD	103.068 CHF	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	(16)	(0,00)
Clases EUR con cobertura						
4.143.272 €	5.013.478 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(98.204)	(0,00)
53.760 €	64.379 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(603)	(0,00)
1.665.299.069 €	2.028.370.903 USD	15/09/2021	UBS AG	1	(50.369.609)	(0,79)
175.317.816 €	211.805.713 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	54	(3.821.480)	(0,06)
28.873.539 €	34.785.277 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	16	(489.998)	(0,01)
2.935.080 USD	2.471.472 €	15/09/2021	Westpac Banking Corp	3	(473)	(0,00)
Clases GBP con cobertura						
2.024.676 £	2.865.394 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(68.266)	(0,00)
370.583.346 £	524.823.602 USD	15/09/2021	UBS AG	3	(12.794.176)	(0,20)
11.494.528 £	16.141.922 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	38	(262.015)	(0,01)
862.383 £	1.202.917 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	14	(11.374)	(0,00)
4.470.410 USD	3.252.014 £	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(22.308)	(0,00)
208.120 USD	151.313 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	6	(923)	(0,00)
14.167 USD	10.260 £	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	(9)	(0,00)
Clases JPY con cobertura						
573.436.750 ¥	5.265.341 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(98.059)	(0,00)
110.592.662.730 ¥	1.010.589.623 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	2	(13.513.543)	(0,21)
3.277.870.000 ¥	30.089.052 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	6	(551.916)	(0,01)
200.000.000 ¥	1.809.171 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	(6.020)	(0,00)
Clases SEK con cobertura						
126.917 SEK	15.367 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(524)	(0,00)
23.393.406 SEK	2.831.486 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	2	(94.155)	(0,00)
1.132.239 SEK	135.660 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	21	(3.245)	(0,00)
414.068 SEK	48.964 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	8	(512)	(0,00)
59.162 USD	505.974 SEK	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(11)	(0,00)

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (1,35%) (31 de diciembre de 2020: (0,10%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases SGD con cobertura (cont.)						
187.268 SGD	141.595 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(2.285)	(0,00)
2.249.349 SGD	1.690.780 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	51	(17.476)	(0,00)
34.537.772 SGD	26.103.957 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	12	(414.905)	(0,01)
11.870 USD	15.964 SGD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	(4)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					(86.031.501)	(1,35)

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(86.031.501)	(1,35)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	6.092.483.811	95,60
Otro activo neto	280.158.808	4,40
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	6.372.642.619	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	5.249.862.935	80,32
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	829.453.141	12,69
† Otros valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario	55.285.739	0,85
µ Fondos de inversión	33.213.000	0,51
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(75.331.004)	(1,15)
Total inversiones	6.092.483.811	93,22

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
36.866.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 1.45%, 08/01/2026	36.816.600
34.802.000	Korea Resources Corp, 1.75%, 15/04/2026	34.631.470
28.554.000	Petrobras Global Finance BV, 7.38%, 17/01/2027	34.417.434
31.000.000	Oman Government International Bond, 5.38%, 08/03/2027	32.545.880
26.000.000	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co Ltd 3, 6.33%, 30/09/2027	30.346.188
29.420.000	Emirates Development Bank PJSC, 1.64%, 15/06/2026	29.420.000
29.654.000	XP Inc, 3.25%, 01/07/2026	29.316.537
24.069.000	CBQ Finance Ltd, 2.00%, 12/05/2026	24.007.624
20.686.000	JBS Investments II GmbH, 7.00%, 15/01/2026	22.186.935
18.000.000	Southern Gas Corridor CJSC, 6.88%, 24/03/2026	21.553.800
20.927.000	Egypt Government International Bond, 3.88%, 16/02/2026	20.784.500
19.800.000	SA Global Sukuk Ltd, 1.60%, 17/06/2026	19.825.000
18.040.000	CSN Resources SA, 7.63%, 17/04/2026	19.430.185
19.182.000	Banco BTG Pactual SA, 2.75%, 11/01/2026	19.071.128
17.780.000	Colombia Government International Bond, 3.88%, 25/04/2027	18.920.063
17.953.000	DIB Sukuk Ltd, 1.96%, 22/06/2026	17.953.000
14.300.000	Peruvian Government International Bond, 7.35%, 21/07/2025	17.548.368
15.000.000	Oil & Gas Holding Co BSCC, 7.63%, 07/11/2024	16.695.000
15.000.000	Kenya Government International Bond, 7.00%, 22/05/2027	16.678.215
13.907.000	Turkey Government International Bond, 4.38%, 08/07/2027	16.385.936
16.367.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS, 5.13%, 22/06/2026	16.367.000
12.500.000	Senegal Government International Bond, 4.75%, 13/03/2028	16.137.985
14.000.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand, 5.38%, 17/04/2025	15.825.000
15.000.000	QNB Finance Ltd, 2.63%, 12/05/2025	15.795.000
13.650.000	Russian Foreign Bond - Eurobond, 7.50%, 31/03/2030	15.788.644
14.000.000	Ivory Coast Government International Bond, 6.38%, 03/03/2028	15.453.000
15.000.000	Banco de Credito del Peru, 2.70%, 11/01/2025	15.369.510
14.200.000	Ghana Government International Bond, 8.13%, 18/01/2026	15.217.125

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

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
20.983.000	Orbia Advance Corp SAB de CV, 4.88%, 19/09/2022	22.202.687
20.010.000	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 4.63%, 14/03/2023	20.673.300
15.000.000	Oil & Gas Holding Co BSCC, 7.63%, 07/11/2024	16.725.000
16.668.000	COSL Singapore Capital Ltd, 1.88%, 24/06/2025	16.538.823
15.000.000	Nigeria Government International Bond, 5.63%, 27/06/2022	15.577.500
13.000.000	Philippine Government International Bond, 0.00%, 03/02/2023	15.470.907
14.596.000	CCCI Treasure Ltd, 3.43%, 29/12/2049	14.413.550
14.268.000	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 3.50%, 19/07/2022	14.390.705
12.627.000	Mexico Government International Bond, 3.90%, 27/04/2025	13.917.041
13.502.000	Bluestar Finance Holdings Ltd, 3.50%, 30/09/2021	13.615.040
12.913.000	Contemporary Ruiding Development Ltd, 1.88%, 17/09/2025	12.892.210
13.808.000	Turkey Government International Bond, 4.75%, 26/01/2026	12.818.428
11.200.000	Nigeria Government International Bond, 7.63%, 21/11/2025	12.728.800
9.938.000	MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt, 1.38%, 24/06/2025	12.456.889
11.683.000	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 3.38%, 19/06/2024	11.732.260
10.000.000	Romanian Government International Bond, 4.88%, 22/01/2024	11.162.500
11.000.000	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 3.13%, 19/06/2022	11.039.850
10.193.000	Rumo Luxembourg Sarl, 7.38%, 09/02/2024	10.595.624
9.464.000	Mongolia Government International Bond, 5.13%, 07/04/2026	10.351.250
8.638.000	Petroleos Mexicanos, 6.88%, 16/10/2025	9.588.180
8.000.000	Mexico Government International Bond, 4.00%, 02/10/2023	8.750.000
7.905.000	Egypt Government International Bond, 6.13%, 31/01/2022	8.132.793
10.870.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd, 4.50%, 29/12/2049	7.629.300
7.000.000	CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd, 1.41%, 25/04/2021	7.000.980
6.419.000	Saudi Government International Bond, 2.88%, 04/03/2023	6.675.760
6.371.000	Egypt Government International Bond, 5.58%, 21/02/2023	6.617.876
5.000.000	Mexico Government International Bond, 1.63%, 08/04/2026	6.348.035
6.000.000	Petronas Capital Ltd, 3.13%, 18/03/2022	6.158.580
6.000.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 7.90%, 11/05/2021	5.927.000
5.538.000	Cssc Capital One Ltd, 4.13%, 27/09/2021	5.644.163
5.000.000	Romanian Government International Bond, 4.38%, 22/08/2023	5.443.750
8.600.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd, 4.00%, 29/12/2049	5.402.000
5.117.000	El Salvador Government International Bond, 7.75%, 24/01/2023	5.180.963
5.000.000	Gulf International Bank BSC, 3.50%, 25/03/2022	5.115.000
4.710.000	Turkey Government International Bond, 6.38%, 14/10/2025	4.688.805

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 1,25%. En el mismo periodo, el índice HFRX Global Hedge Fund (USD) (el "Índice") registró una rentabilidad del 3,73%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso.)

Los mercados de crédito y renta variable global, que mantuvieron una trayectoria gradualmente ascendente durante todo el periodo, se anotaron rentabilidades positivas. Los avances fueron más pronunciados en EE. UU. y Europa, mientras que los mercados emergentes y los mercados desarrollados asiáticos se situaron a la zaga. En los mercados de renta fija, la curva de tipos del bono del Tesoro estadounidense se pronunció y la rentabilidad del Tesoro a 10 años subió ligeramente, al igual que la de otros títulos de deuda soberana mundial. El dólar estadounidense se apreció frente al euro, pero se depreció frente a la libra esterlina y el yen japonés. Por lo general, las materias primas repuntaron gracias al aumento de precios del petróleo crudo y el gas natural, mientras que los precios del oro cayeron ligeramente.

La asignación de la Cartera a estrategias de renta variable larga/corta fue el elemento que más positivamente contribuyó a su rendimiento durante el periodo. Los beneficios de las asignaciones a renta variable con posiciones largas y cortas, estrategias de crédito y arbitraje de fusiones/acontecimientos especiales fueron mayores que las pérdidas derivadas de la asignación a estrategias macro global/futuros gestionados. Las ganancias de las posiciones largas compensaron las pérdidas de las cortas, aunque los gestores en general generaron alfa negativa en ambos tipos de posiciones. Por sectores, consumo discrecional, atención sanitaria y finanzas favorecieron, mientras que entre los que más perjudicaron a los resultados destacaron las coberturas de índices de renta variable, tecnología de la información e inmobiliario.

La asignación a estrategias de arbitraje de fusiones/acontecimientos especiales también contribuyó positivamente a la rentabilidad. Se obtuvieron ganancias con varias operaciones que evolucionaron de forma positiva y/o se liquidaron durante el periodo.

La asignación a crédito de la Cartera favoreció durante el periodo como consecuencia de la asignación a la estrategia de valores respaldados por activos. Las mayores aportaciones procedieron de los valores respaldados por hipotecas comerciales y obligaciones de préstamos garantizados ("CLO"), y en menor medida de los valores respaldados por hipotecas residenciales y préstamos para automóviles.

La asignación de la Cartera a la estrategia de futuros gestionados/macro global lastró los resultados, ya que las pérdidas de la estrategia de futuros gestionados superaron a las ganancias de la estrategia sistemática de divisas. Dentro de la estrategia de futuros gestionados, las pérdidas de las posiciones en divisas y tipos de interés pesaron más que las ganancias de la renta variable. Dentro de la estrategia sistemática de divisas, las ganancias se debieron principalmente al posicionamiento largo en el dólar estadounidense frente al euro y, en menor medida, frente al dólar australiano.

A pesar de que los mercados de renta variable seguirán beneficiándose de los estímulos fiscales y de la incesante reapertura en todo el mundo, creemos que es posible que la volatilidad persista mientras los inversores sopesen las perspectivas económicas positivas frente al riesgo de aumento de la inflación y de los tipos de interés. En nuestra opinión, la incertidumbre con respecto a los tipos de interés podría elevar la volatilidad a corto plazo, mientras que la subida de los tipos, la inflación y los impuestos podrían representar un obstáculo para la renta variable a medio plazo. Seguimos posicionando la cartera con vistas a beneficiarnos de una volatilidad elevada, con la ventaja adicional de un entorno de subidas de tipos. La mayor asignación estratégica de la Cartera es la asignación a la estrategia de posiciones largas/cortas en renta variable. A medida que la economía mundial continúe reabriendo, prevemos una elevada dispersión de ganadores y perdedores a medio plazo que nuestros asesores delegados deberán identificar, mientras que las posibles subidas de tipos de interés e impuestos pueden tener diversos grados de repercusión también sobre las empresas. La segunda mayor asignación de la Cartera corresponde a las estrategias de arbitraje de fusiones y acontecimientos especiales. La actividad de fusiones se ha recuperado desde los niveles alcanzados a comienzos de la pandemia y los diferenciales se mantienen en niveles moderados, aunque es posible que se amplíen a medida que aumenten las rentabilidades. La tercera mayor asignación de la Cartera corresponde a las estrategias de futuros gestionados/macro global. Creemos que el nivel de volatilidad del mercado puede seguir siendo elevado y este factor ha favorecido históricamente a estas estrategias, aunque es posible que la subida de los tipos de interés y la inflación impulsen las tendencias también a todas las clases de activos.

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		26.958.767	32.773.005
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	25.118.517	23.745.113
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		520.897	497.202
Cuentas a percibir por acciones emitidas		1.764	134.571
Cuentas por cobrar de intermediarios		4.802.538	3.069.160
Ingresos a percibir y otros activos		55.374	117.350
Activos totales		57.457.857	60.336.401
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		3.231.249	1.822.508
Descubierto bancario	3	–	37
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		3.321	–
Adeudado a los intermediarios		–	350.000
Gastos devengados		185.765	192.941
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		219.929	236.509
Otras cuentas por pagar		148.535	95.161
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		3.788.799	2.697.156
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		53.669.058	57.639.245

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		77.761	267.107
Ingresos por dividendos		82.627	87.268
Ingresos varios		43.172	2.591
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(2.356.010)	(50.852)
		(2.152.450)	306.114
Gastos			
Comisión de gestión	5	431.471	430.345
Comisión de distribución	5	5.769	6.013
Comisión de administración	5	157.436	158.811
Comisión de compromiso	16	4.358	3.057
Comisión de depósito	5	673	1.633
Comisión del Depositario	5	1.398	2.707
Honorarios profesionales	7	49.989	35.226
Honorarios de los Consejeros	6	2.410	2.380
Costes de transacciones	7	101.804	108.841
Honorarios de auditoría	7	9.752	10.888
Reembolso de IVA		(264)	(197)
Otros gastos	7	56.463	49.060
Gastos no asumidos	5	(135.503)	(150.270)
Gastos totales		685.756	658.494
Costes financieros			
Gastos por intereses		4	69
		4	69
Impuestos retenidos en origen		32.202	21.353
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		(2.870.412)	(373.802)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	57.639.245	54.994.332
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	(2.870.412)	(373.802)
Suscripciones	3.049.497	1.579.324
Reembolsos	(4.149.272)	(1.881.370)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	53.669.058	54.318.484

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

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 46,24% (31 de diciembre de 2020: 33,24%)			
Dólar canadiense			
285	Artemis Gold Inc**	1.351	0,00
565	Dye & Durham Ltd**	21.732	0,04
7.399	Great Canadian Gaming Corp**	265.953	0,50
1.600	Green Thumb Industries Inc**	52.873	0,10
2.124	Inter Pipeline Ltd**	34.562	0,06
5.693	Photon Control Inc**	16.459	0,03
9.073	Shaw Communications Inc Class B*	263.112	0,49
Total dólar canadiense		656.042	1,22
Euro			
6.248	468 Spac I SE Class A*	72.761	0,14
462	adidas AG*	171.981	0,32
22.137	Anima Holding SpA*	110.023	0,20
4	Brenntag SE*	372	0,00
960	Eurofins Scientific SE*	109.748	0,20
1	Gerresheimer AG*	111	0,00
111	IMCD NV*	17.652	0,03
12.412	Intertrust NV*	223.440	0,42
3.912	Pegasus Acquisition Co Europe BV*	46.068	0,09
1.937	SAP SE*	272.986	0,51
125	Stroer SE & Co KGaA*	10.014	0,02
1.960	Unilever Plc*	114.742	0,21
Total euro		1.149.898	2,14
Dólar de Hong Kong			
10.249	AIA Group Ltd*	127.356	0,24
191	Baidu Inc Class A*	4.904	0,01
4.149	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd - H Shares*	9.061	0,02
2.329	Sinopharm Group Co Ltd - H Shares*	6.928	0,01
2.187	Tencent Holdings Ltd*	164.465	0,30
Total dólar de Hong Kong		312.714	0,58
Peso mexicano			
37.800	Becle SAB de CV*	100.013	0,19
6.356	Wal-Mart de Mexico SAB de CV*	20.785	0,04
Total peso mexicano		120.798	0,23

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

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 46,24% (31 de diciembre de 2020: 33,24%) (cont.)			
Libra esterlina			
120	ASOS Plc*	8.222	0,01
7.143	Deliveroo Plc Class A*	28.459	0,05
4.807	Frasers Group Plc*	40.010	0,07
1.057	Hikma Pharmaceuticals Plc*	35.716	0,07
36.664	ITV Plc*	63.590	0,12
622	Smiths Group Plc*	13.662	0,03
Total libra esterlina		189.659	0,35
Franco suizo			
1.457	Nestle SA*	181.615	0,34
594	Roche Holding AG*	223.983	0,42
Total franco suizo		405.598	0,76
Dólar estadounidense			
369	51job Inc ADR*	28.697	0,05
12.622	Achillion Pharmaceuticals Inc CVR ^o	6.311	0,01
2.650	Actua Corp ^o	132	0,00
14.468	Alder Biopharmaceuticals Inc CVR ^o	14.468	0,03
3.650	Alexion Pharmaceuticals Inc*	670.541	1,25
1.133	Alibaba Group Holding Ltd ADR*	256.942	0,48
106	Alphabet Inc Class A*	258.830	0,48
17	Amazon.com Inc*	58.483	0,11
268	Anthem Inc*	102.322	0,19
2.257	Apple Inc*	309.119	0,58
1.114	Assurant Inc*	173.985	0,32
6.368	At Home Group Inc*	234.597	0,44
1.119	Athene Holding Ltd Class A*	75.532	0,14
102	Baidu Inc ADR*	20.798	0,04
3.715	Bank of America Corp*	153.169	0,29
14.235	BGC Partners Inc Class A*	80.712	0,15
4.873	BJ's Restaurants Inc*	239.459	0,45
89	BlackRock Inc Class A*	77.872	0,14
130	Booking Holdings Inc*	284.452	0,53
1.443	Bristol-Myers Squibb Co*	96.421	0,18
1.898	CAI International Inc*	106.288	0,20
616	Capri Holdings Ltd*	35.229	0,07
12.679	Change Healthcare Inc*	292.124	0,54
350	Cigna Corp*	82.974	0,15

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

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 46,24% (31 de diciembre de 2020: 33,24%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
8.894	Cincinnati Bell Inc*	137.145	0,26
1.281	Cincinnati Bell Inc - Preferred*	64.063	0,12
11.394	Clarivate Plc*	313.677	0,58
4.097	Clean Harbors Inc*	381.595	0,71
1.356	Clementia Pharmaceuticals Inc CVR ⁰	0	0,00
8.948	Cloudera Inc*	141.915	0,26
1.600	Coherent Inc*	422.944	0,79
528	Compania Brasileira de Distribuicao ADR*	4.113	0,01
3.611	Constellation Pharmaceuticals Inc*	122.052	0,23
390	Core-Mark Holding Co Inc*	17.554	0,03
700	Dell Technologies Inc Class C*	69.769	0,13
5.300	Diamond Resorts Corp ⁰	0	0,00
1.319	Domtar Corp*	72.492	0,13
582	DouYu International Holdings Ltd ADR*	3.981	0,01
3.641	Dova Pharmaceuticals Inc CVR ⁰	455	0,00
419	Dr Reddy's Laboratories Ltd ADR*	30.801	0,06
708	eBay Inc*	49.709	0,09
5.458	Elanco Animal Health Inc CVR ⁰	55	0,00
1.520	EnerSys*	148.550	0,28
8.964	Envista Holdings Corp*	387.334	0,72
40.863	Escrow Altaba Inc ⁰	594.557	1,11
281	Estee Lauder Cos Inc Class A*	89.380	0,17
6.863	EXFO Inc*	40.835	0,08
327	Expedia Group Inc*	53.533	0,10
919	Facebook Inc Class A*	319.545	0,60
1.834	Falcon Minerals Corp*	9.317	0,02
2.932	Ferro Corp*	63.243	0,12
88	Fix Price Group Ltd GDR*	770	0,00
3.110	Fly Leasing Ltd ADR*	52.683	0,10
1.993	Forterra Inc*	46.855	0,09
507	Garrett Motion Inc*	4.046	0,01
3.151	General Motors Co*	186.445	0,35
13.115	G-III Apparel Group Ltd*	430.959	0,80
277	Goldman Sachs Group Inc*	105.130	0,20
3.514	Grifols SA ADR*	60.968	0,11
47.520	Gulf Coast Ultra Deep Royalty Trust**	1.188	0,00
6.914	Hancock Whitney Corp*	307.258	0,57
91	Hartford Financial Services Group Inc*	5.639	0,01

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

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 46,24% (31 de diciembre de 2020: 33,24%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
17.849	Hayward Holdings Inc*	464.431	0,87
3.400	IHS Markit Ltd*	383.044	0,71
2.579	Jamf Holding Corp*	86.577	0,16
79	Johnson & Johnson*	13.014	0,02
6.718	Kaman Corp*	338.587	0,63
963	Kansas City Southern*	272.885	0,51
3.367	Kindred Biosciences Inc*	30.875	0,06
5.198	Kirby Corp*	315.207	0,59
603	Liberty Broadband Corp - Preferred Shares*	17.005	0,03
7.578	LKQ Corp*	372.989	0,69
1.225	Loral Space & Communications Inc*	47.591	0,09
7.653	Luminex Corp*	281.630	0,52
715	Lydall Inc*	43.272	0,08
1.208	Lyft Inc Class A*	73.060	0,14
2.204	Macquarie Infrastructure Corp*	84.347	0,16
1.218	Magellan Health Inc*	114.736	0,21
2.838	Magnachip Semiconductor Corp*	67.715	0,13
519	Magnit PJSC GDR*	7.528	0,01
414	Mail.Ru Group Ltd GDR*	9.381	0,02
751	Marlin Business Services Corp*	17.093	0,03
1.187	Marriott Vacations Worldwide Corp*	189.089	0,35
3.800	Maxim Integrated Products Inc*	400.368	0,75
25.735	Media General Inc CVRØ	0	0,00
78	MercadoLibre Inc*	121.508	0,23
752	Meredith Corp*	32.667	0,06
1.946	Morgan Stanley*	178.429	0,33
5.939	Navistar International Corp*	264.285	0,49
4.049	Nordstrom Inc*	148.072	0,28
9.506	Nuance Communications Inc*	517.507	0,96
8.908	ORBCOMM Inc*	100.126	0,19
638	Oshkosh Corp*	79.520	0,15
2.199	Overstock.com Inc*	202.748	0,38
15.062	PAE Inc*	134.052	0,25
24.634	Pan American Silver Corp (Right, 22/02/2029)**	20.939	0,04
18.235	Paya Holdings Inc*	200.950	0,37
708	PayPal Holdings Inc*	206.368	0,38
838	Penn National Gaming Inc*	64.099	0,12
7.847	Pfenex Inc CVR ^Ø	5.885	0,01

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

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 46,24% (31 de diciembre de 2020: 33,24%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
10.306	PNM Resources Inc*	502.624	0,94
6.024	PPD Inc*	277.646	0,52
1.500	PRA Health Sciences Inc*	247.815	0,46
2.242	Proofpoint Inc*	389.570	0,73
2.490	ProSight Global Inc*	31.772	0,06
791	QUALCOMM Inc*	113.058	0,21
246	Raven Industries Inc*	14.231	0,03
189	Regeneron Pharmaceuticals Inc*	105.564	0,20
22.999	Regis Corp*	215.271	0,40
2.929	Repay Holdings Corp Class A*	70.413	0,13
50	Samsung Electronics Co Ltd GDR*	89.175	0,17
528	Sendas Distribuidora SA ADR*	9.029	0,02
966	SharpSpring Inc*	16.316	0,03
6.263	Skyline Champion Corp*	333.818	0,62
15.300	Slack Technologies Inc Class A*	677.790	1,26
4.611	Sogou Inc ADR*	39.332	0,07
2.964	Sohu.com Ltd ADR*	55.130	0,10
1.145	Soliton Inc*	25.751	0,05
7.016	Sportsman's Warehouse Holdings Inc*	124.674	0,23
7.879	Stemline Therapeutics Inc CVR ⁰	0	0,00
7.967	Steven Madden Ltd*	348.636	0,65
7.467	Sunrun Inc*	416.509	0,78
5.325	Surgalign Holdings Inc*	7.402	0,01
781	Sykes Enterprises Inc*	41.940	0,08
10.989	Syncora Holdings Ltd**	2.747	0,00
4.444	Talend SA ADR*	291.526	0,54
1.013	Tapestry Inc*	44.045	0,08
9.327	Tenable Holdings Inc*	385.671	0,72
229	Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR*	2.267	0,00
140	Thermo Fisher Scientific Inc*	70.626	0,13
700	T-Mobile US Inc*	101.381	0,19
1.250	Tobira Therapeutics Inc CVR ⁰	0	0,00
358	Ulta Beauty Inc*	123.786	0,23
729	US Concrete Inc*	53.800	0,10
1.538	Valmont Industries Inc*	363.045	0,68
674	Visa Inc Class A*	157.595	0,29
406	Walt Disney Co*	71.363	0,13
3.880	Watford Holdings Ltd*	135.761	0,25

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

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 46,24% (31 de diciembre de 2020: 33,24%) (cont.)				
Dólar estadounidense (cont.)				
2.778	Welbilt Inc*		64.311	0,12
2.500	Wills Towers Watson Plc*		575.050	1,07
1.670	Woodward Inc*		205.210	0,38
2.005	WR Grace & Co*		138.586	0,26
1.392	X5 Retail Group NV GDR*		48.804	0,09
3.250	Xilinx Inc*		470.080	0,88
453	Yandex NV Class A*		32.050	0,06
583	Zillow Group Inc Class C*		71.254	0,13
701	Zimmer Biomet Holdings Inc*		112.735	0,21
	Total dólar estadounidense		21.982.750	40,96
	Total valores de renta variable		24.817.459	46,24
Fondos de inversión inmobiliaria 0,50% (31 de diciembre de 2020: 0,58%)				
Dólar estadounidense				
282	Columbia Property Trust Inc		4.904	0,01
1.950	QTS Realty Trust Inc Class A		150.735	0,28
2.500	VEREIT Inc		114.825	0,21
	Total fondos de inversión inmobiliaria *		270.464	0,50
Número de Acciones	Descripción de los valores	Fecha de vencimiento	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Participatory Notes 0,01% (31 de diciembre de 2020: 0,01%)				
	Euro			
2.083	468 Spac I SE	30/04/2026	2.223	0,01
	Total participatory notes **		2.223	0,01
	Total inversiones		25.090.146	46,75

Contratos de divisas a plazo 0,57% (31 de diciembre de 2020: 2,80%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
40.000 AUD	3.328.944 ¥	15/09/2021	Citibank NA	1	27	0,00
300.000 BRL	58.467 USD	15/09/2021	BNP Paribas	4	773	0,00
2.470.000 BRL	485.496 USD	15/09/2021	Citibank NA	3	2.246	0,01
150.000 BRL	29.330 USD	15/09/2021	UBS AG	4	289	0,00
6.370.000 CLP	8.658 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	73	0,00
7.080.000 CLP	9.690 USD	15/09/2021	UBS AG	1	14	0,00
35.641 €	160.000 PLN	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	296	0,00

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,57% (31 de diciembre de 2020: 2,80%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
37.830 €	170.000 PLN	15/09/2021	Citibank NA	2	268	0,00
20.000 €	23.745 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	11	0,00
128.603 €	580.000 PLN	15/09/2021	UBS AG	2	365	0,00
30.000 ILS	9.215 USD	17/09/2021	BNP Paribas	1	0	0,00
46.283.818 ¥	550.000 AUD	15/09/2021	Citibank NA	7	4.238	0,01
3.387.244 ¥	40.000 AUD	15/09/2021	Deutsche Bank AG	1	499	0,00
1.696.467 ¥	20.000 AUD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	275	0,00
38.371.775 ¥	460.000 AUD	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	2	494	0,00
43.854.190 ¥	520.000 AUD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	7	4.862	0,01
21.977.050 ¥	260.000 AUD	15/09/2021	UBS AG	6	2.882	0,01
26.960.000 KRW	23.821 USD	15/09/2021	BNP Paribas	1	32	0,00
970.000 MXN	47.922 USD	17/09/2021	Royal Bank of Scotland	1	315	0,00
670.000 MXN	33.297 USD	17/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	21	0,00
80.000 PLN	17.674 €	15/09/2021	Citibank NA	1	27	0,00
110.000 PLN	24.292 €	15/09/2021	UBS AG	2	48	0,00
1.410.000 THB	43.896 USD	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	84	0,00
647.546 TRY	60.000 €	15/09/2021	BNP Paribas	2	437	0,00
1.298.522 TRY	120.000 €	15/09/2021	Citibank NA	3	1.254	0,00
110.000 TRY	12.143 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	37	0,00
108.441 TRY	10.000 €	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	130	0,00
60.000 TRY	6.623 USD	15/09/2021	UBS AG	2	21	0,00
35.646 USD	30.000 €	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	12	0,00
365.006 USD	490.000 SGD	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	546	0,00
68.445 USD	76.550.000 KRW	15/09/2021	Barclays Bank Plc	2	717	0,00
97.986 USD	90.000 CHF	15/09/2021	Barclays Bank Plc	5	420	0,00
29.448 USD	8.720.000 HUF	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	27	0,00
10.643 USD	340.000 THB	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	38	0,00
13.915 USD	10.000 £	15/09/2021	BNP Paribas	1	99	0,00
291.748 USD	360.000 CAD	15/09/2021	BNP Paribas	6	1.035	0,00
160.461 USD	210.000 AUD	15/09/2021	BNP Paribas	4	2.753	0,01
70.930 USD	100.000 NZD	15/09/2021	BNP Paribas	3	1.071	0,00
96.701 USD	130.000 SGD	15/09/2021	BNP Paribas	1	8	0,00
244.565 USD	7.700.000 THB	15/09/2021	BNP Paribas	4	4.390	0,01
19.653 USD	5.800.000 HUF	15/09/2021	BNP Paribas	2	84	0,00
178.564 USD	19.670.000 ¥	15/09/2021	BNP Paribas	8	1.225	0,00
229.417 USD	190.000 €	15/09/2021	BNP Paribas	4	3.739	0,01
218.427 USD	10.710.000 PHP	15/09/2021	BNP Paribas	3	410	0,00
6.058 USD	30.000 BRL	15/09/2021	BNP Paribas	1	134	0,00

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,57% (31 de diciembre de 2020: 2,80%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
909.989 USD	68.120.000 INR	15/09/2021	BNP Paribas	11	2.102	0,00
1.236.681 USD	1.034.143 €	16/07/2021	Brown Brothers Harriman	1	9.928	0,02
228.513 USD	163.463 £	16/07/2021	Brown Brothers Harriman	1	2.688	0,01
412.814 USD	376.804 CHF	16/07/2021	Brown Brothers Harriman	1	5.016	0,01
614.307 USD	758.294 CAD	01/10/2021	Brown Brothers Harriman	1	1.954	0,00
315.206 USD	2.447.274 HKD	16/07/2021	Brown Brothers Harriman	1	64	0,00
174.775 USD	230.000 AUD	15/09/2021	Citibank NA	9	2.047	0,00
199.402 USD	2.840.000 ZAR	15/09/2021	Citibank NA	2	2.445	0,01
418.506 USD	560.000 SGD	15/09/2021	Citibank NA	3	1.980	0,00
168.349 USD	120.000 £	15/09/2021	Citibank NA	4	2.547	0,01
155.326 USD	7.610.000 PHP	15/09/2021	Citibank NA	2	414	0,00
412.223 USD	30.740.000 INR	15/09/2021	Citibank NA	9	2.529	0,01
38.502 USD	320.000 SEK	15/09/2021	Citibank NA	1	1.058	0,00
59.673 USD	6.570.000 ¥	15/09/2021	Citibank NA	3	438	0,00
29.816 USD	21.630.000 CLP	15/09/2021	Citibank NA	2	170	0,00
454.969 USD	1.700.000 PLN	15/09/2021	Citibank NA	9	8.319	0,02
556.449 USD	17.410.000 THB	15/09/2021	Citibank NA	1	13.404	0,03
39.097 USD	350.000 TRY	15/09/2021	Citibank NA	1	342	0,00
54.509 USD	50.000 CHF	15/09/2021	Citibank NA	2	306	0,00
64.994 USD	80.000 CAD	15/09/2021	Citibank NA	2	390	0,00
60.792 USD	50.000 €	15/09/2021	Citibank NA	2	1.403	0,00
111.715 USD	124.680.000 KRW	15/09/2021	Citibank NA	3	1.404	0,00
9.957 USD	50.000 BRL	15/09/2021	Citibank NA	1	84	0,00
142.477 USD	200.000 NZD	15/09/2021	Citibank NA	5	2.759	0,01
113.378 USD	32.660.000 HUF	15/09/2021	Citibank NA	3	3.183	0,01
26.421 USD	220.000 NOK	15/09/2021	Citibank NA	1	847	0,00
48.918 USD	180.000 PLN	15/09/2021	Deutsche Bank AG	1	1.626	0,00
361.309 USD	3.070.000 NOK	15/09/2021	Deutsche Bank AG	8	4.438	0,01
105.511 USD	150.000 NZD	15/09/2021	Deutsche Bank AG	3	723	0,00
1.299.682 USD	142.300.000 ¥	15/09/2021	Deutsche Bank AG	7	16.741	0,03
10.018 USD	750.000 INR	15/09/2021	Deutsche Bank AG	1	22	0,00
27.919 USD	140.000 BRL	15/09/2021	Deutsche Bank AG	3	274	0,00
169.264 USD	140.000 €	15/09/2021	Deutsche Bank AG	2	2.975	0,01
40.025 USD	340.000 SEK	15/09/2021	Deutsche Bank AG	2	241	0,00
49.307 USD	160.000 ILS	17/09/2021	Deutsche Bank AG	1	160	0,00
8.083 USD	10.000 CAD	15/09/2021	Deutsche Bank AG	1	7	0,00
394.934 USD	360.000 CHF	15/09/2021	Deutsche Bank AG	7	4.674	0,01
305.436 USD	400.000 AUD	15/09/2021	Deutsche Bank AG	8	5.039	0,01

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,57% (31 de diciembre de 2020: 2,80%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
309.262 USD	280.000 CHF	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	8	5.726	0,01
15.026 USD	20.000 AUD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	6	0,00
141.690 USD	2.010.000 ZAR	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	6	2.293	0,01
31.138 USD	280.000 TRY	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	134	0,00
58.617 USD	490.000 SEK	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	3	1.282	0,00
201.017 USD	22.160.000 ¥	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	14	1.228	0,00
97.863 USD	120.000 CAD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	5	959	0,00
179.190 USD	3.600.000 MXN	17/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	167	0,00
538.296 USD	720.000 SGD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	3	2.763	0,01
1.091.968 USD	910.000 €	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	25	11.091	0,02
1.004.455 USD	720.000 £	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	14	9.641	0,02
291.519 USD	390.000 SGD	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	2	1.438	0,00
136.719 USD	6.660.000 PHP	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	1	1.146	0,00
92.775 USD	120.000 AUD	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	1	2.656	0,01
92.903 USD	2.950.000 THB	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	3	888	0,00
195.254 USD	140.000 £	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	1	1.818	0,00
29.435 USD	2.190.000 INR	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	2	247	0,00
130.208 USD	1.110.000 NOK	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	1	1.176	0,00
8.078 USD	10.000 CAD	15/09/2021	Société Générale	1	2	0,00
59.594 USD	80.000 SGD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	90	0,00
26.346 USD	100.000 PLN	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	73	0,00
159.114 USD	210.000 AUD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	6	1.406	0,00
175.187 USD	160.000 CHF	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	4	1.738	0,00
149.988 USD	16.520.000 ¥	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	9	1.049	0,00
55.385 USD	470.000 NOK	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	9	750	0,00
516.605 USD	430.000 €	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	11	5.860	0,01
14.199 USD	200.000 ZAR	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	3	328	0,00
21.672 USD	6.240.000 HUF	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	3	618	0,00
73.662 USD	82.270.000 KRW	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	874	0,00
46.969 USD	2.300.000 PHP	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	149	0,00
105.775 USD	150.000 NZD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	9	987	0,00
32.627 USD	270.000 SEK	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	1.033	0,00
106.973 USD	130.000 CAD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	7	1.993	0,00
278.867 USD	200.000 £	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	11	2.528	0,01
215.150 USD	16.060.000 INR	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	4	1.107	0,00
15.825 USD	80.000 BRL	15/09/2021	UBS AG	1	28	0,00
30.966 USD	22.490.000 CLP	15/09/2021	UBS AG	2	141	0,00
274.217 USD	250.000 CHF	15/09/2021	UBS AG	14	3.204	0,01

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,57% (31 de diciembre de 2020: 2,80%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
107.439 USD	90.000 €	15/09/2021	UBS AG	4	539	0,00
143.580 USD	190.000 AUD	15/09/2021	UBS AG	5	891	0,00
499.422 USD	4.260.000 SEK	15/09/2021	UBS AG	2	947	0,00
7.058 USD	10.000 NZD	15/09/2021	UBS AG	1	72	0,00
252.276 USD	2.130.000 NOK	15/09/2021	UBS AG	8	4.678	0,01
102.853 USD	7.710.000 INR	15/09/2021	UBS AG	2	96	0,00
13.895 USD	10.000 £	15/09/2021	UBS AG	1	78	0,00
8.273 USD	10.000 CAD	15/09/2021	UBS AG	1	198	0,00
35.915 USD	500.000 ZAR	15/09/2021	UBS AG	3	1.240	0,00
13.947 USD	15.630.000 KRW	15/09/2021	UBS AG	2	118	0,00
234.146 USD	880.000 PLN	15/09/2021	UBS AG	5	2.939	0,01
Clases CHF con cobertura						
197.620 USD	181.396 CHF	19/07/2021	Goldman Sachs International	4	1.287	0,00
165.141 USD	151.924 CHF	19/07/2021	UBS AG	1	707	0,00
1.558.467 USD	1.402.474 CHF	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	40.512	0,08
Clases EUR con cobertura						
9.656 €	11.455 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
199.666 USD	166.618 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	2.003	0,00
202.292 USD	168.915 €	19/07/2021	UBS AG	2	1.903	0,00
878.357 USD	727.226 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	15	15.630	0,03
Clases GBP con cobertura						
112.305 £	154.588 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	563	0,00
112.305 £	154.604 USD	19/07/2021	UBS AG	1	548	0,00
110.629 £	152.229 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	606	0,00
1.726 USD	1.249 £	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	0	0,00
3.289 USD	2.350 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	43	0,00
Clases JPY con cobertura						
451.884 USD	49.790.019 ¥	19/07/2021	Citibank NA	1	3.222	0,01
396.134 USD	43.349.738 ¥	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	5.507	0,01
806.481 USD	88.082.410 ¥	19/07/2021	Westpac Banking Corp	7	12.763	0,03
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					307.174	0,57

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de futuros 0,54% (31 de diciembre de 2020: 0,12%)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(44)	Australian Dollar Currency Future September 2021	109.414	0,21
(8)	Bankers Acceptance Future June 2022	293	0,00
(1)	British Pound Currency Future September 2021	2.362	0,01
(6)	Canadian Dollar Currency Future September 2021	12.589	0,02
1	E-mini Russell 2000 Index Future September 2021	3.130	0,01
(30)	Euro FX Currency Future September 2021	125.047	0,23
(1)	Japanese Yen Currency Future September 2021	1.680	0,00
(4)	Mexican Peso Currency Future September 2021	1.300	0,00
2	Nasdaq 100 E-mini Future September 2021	18.082	0,03
(3)	South African Rand Currency (CME) Future September 2021	5.325	0,01
1	Swedish Krona Currency Future September 2021	3.659	0,01
3	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2021	484	0,00
3	US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2021	5.219	0,01
Plusvalía latente total sobre contratos de futuros *		288.584	0,54

Contratos por diferencias 2,37% (31 de diciembre de 2020: 2,72%)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
31	Amazon.com Inc	JPMorgan Chase Bank	41.473	0,08
5.515	American International Group Inc	JPMorgan Chase Bank	29.746	0,05
2.170	Amundi SA	Morgan Stanley	67.274	0,13
3.294	Arrow Global Group Plc	JPMorgan Chase Bank	55	0,00
2.243	Ashland Global Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	3.304	0,01
729	Aspen Pharmacare Holding	Morgan Stanley	1.834	0,00
(5.559)	AT&T Inc	JPMorgan Chase Bank	2.885	0,01
10.811	Atrium European Real Estate Inc	JPMorgan Chase Bank	6.748	0,01
7.044	Avantor Inc	JPMorgan Chase Bank	64.475	0,12
5	Booking Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	199	0,00
123	Croda International Plc	Morgan Stanley	5.645	0,01
676	Crown Resorts Ltd	JPMorgan Chase Bank	2	0,00
669	Danaher Corp	JPMorgan Chase Bank	62.412	0,12
4.585	Dialog Semiconductor Plc	JPMorgan Chase Bank	3.065	0,01
(523)	Digital Realty Trust Inc	JPMorgan Chase Bank	954	0,00
(1.266)	Discovery Communications Inc	JPMorgan Chase Bank	34.426	0,06
1.829	Elis SA	Morgan Stanley	3.112	0,01
(3.925)	Engie SA	Morgan Stanley	526	0,00
80	Enphase Energy Inc	JPMorgan Chase Bank	2.926	0,01
334	Enphase Energy Plc	Morgan Stanley	3.551	0,01
226	Eurofins Scientific	Morgan Stanley	14.550	0,03

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 2,37% (31 de diciembre de 2020: 2,72%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(1.634)	Fox Corp	Morgan Stanley	8.538	0,02
548	Gerresheimer	Morgan Stanley	24.761	0,05
(1.346)	GlaxoSmithKline Plc	Morgan Stanley	324	0,00
(998)	Grand Canyon Education Inc	JPMorgan Chase Bank	1.637	0,00
2.746	GrandVision NV	JPMorgan Chase Bank	12.807	0,02
(2.234)	Grifols SA	JPMorgan Chase Bank	2.130	0,00
1.841	Haldex AB	JPMorgan Chase Bank	4.884	0,01
(200)	Hannover Rueck SE	Morgan Stanley	2.986	0,01
20	Hermes International	Morgan Stanley	16.447	0,03
1.117	Hiedelbergcement AG	Morgan Stanley	21.628	0,04
(1.274)	II-VI Inc	JPMorgan Chase Bank	11.718	0,02
60	Iliad SA	Morgan Stanley	985	0,00
(500)	Inmobiliaria Colonial SOCIMI SA	JPMorgan Chase Bank	679	0,00
(1.576)	JPMorgan Basket 321	JPMorgan Chase Bank	363	0,00
(1.560)	JPMorgan Basket JPCR323	JPMorgan Chase Bank	232	0,00
208	Kering	Morgan Stanley	76.696	0,14
1.378	LafargeHolcim Ltd	Morgan Stanley	17.021	0,03
(271)	LendingTree Inc	Morgan Stanley	4.663	0,01
(32)	LendingTree Inc	JPMorgan Chase Bank	203	0,00
2.064	Lincoln National Corp	JPMorgan Chase Bank	25.002	0,05
(230)	Lumentum Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	3.459	0,01
39	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SA	Morgan Stanley	13.993	0,03
(8.228)	Marks & Spencer Group Plc	Morgan Stanley	9.393	0,02
(3.960)	Materialise NV	JPMorgan Chase Bank	2.948	0,01
(1.998)	MDC Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	9.048	0,02
1.198	Microsoft Corp	JPMorgan Chase Bank	91.579	0,17
1.494	Migros Ticaret AS	Morgan Stanley	270	0,00
743	Naturgy Energy Group SA	JPMorgan Chase Bank	155	0,00
149	Naver Corp	Morgan Stanley	16.072	0,03
719	Nestle SA	Morgan Stanley	10.729	0,02
(27)	Organon & Co	Morgan Stanley	118	0,00
(9.352)	Perdoceo Education Corp	Morgan Stanley	1.527	0,00
(9.416)	Perdoceo Education Corp	JPMorgan Chase Bank	663	0,00
(816)	Proto Labs Inc	JPMorgan Chase Bank	27.056	0,05
520	Publicis Groupe	Morgan Stanley	4.593	0,01
(2.091)	Qualys Inc	JPMorgan Chase Bank	9.605	0,02
724	Quanta Services Inc	Morgan Stanley	2.521	0,00
767	Quanta Services Inc	JPMorgan Chase Bank	1.319	0,00

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 2,37% (31 de diciembre de 2020: 2,72%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(1.763)	Realty Income Corp	JPMorgan Chase Bank	5.511	0,01
228	Restoration Hardware Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	56.213	0,10
(437)	Robert Half International Inc	JPMorgan Chase Bank	747	0,00
2.065	Ryanair Holdings Plc	Morgan Stanley	19.427	0,04
21	SGS SA	Morgan Stanley	12.929	0,02
630	Siltronic AG	JPMorgan Chase Bank	2.276	0,00
12.296	Smith & Nephew Plc	Morgan Stanley	31.369	0,06
(260)	SolarEdge Technologies Inc	JPMorgan Chase Bank	3.916	0,01
3.551	State Street Corp	JPMorgan Chase Bank	178	0,00
(2.017)	Strategic Education Inc	JPMorgan Chase Bank	17.466	0,03
(1.647)	Strategic Education Inc	Morgan Stanley	19.772	0,04
653	Stroeer Media AG	Morgan Stanley	7.261	0,01
15.132	Suez SA	JPMorgan Chase Bank	34.467	0,06
(5.435)	Telefonica SA	Morgan Stanley	3.630	0,01
189	Toshiba Corp	JPMorgan Chase Bank	893	0,00
4.059	UDG Healthcare Plc	JPMorgan Chase Bank	1.306	0,00
(308)	VMware Inc - Class A	JPMorgan Chase Bank	368	0,00
(847)	Volvo AB - B Shares	JPMorgan Chase Bank	2.362	0,00
(742)	Western Union Co	JPMorgan Chase Bank	1.515	0,00
(1.673)	Western Union Co	Morgan Stanley	3.584	0,01
Plusvalía latente total sobre contratos por diferencias [∞]			1.272.863	2,37
			Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados			26.958.767	50,23

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (2,87%) (31 de diciembre de 2020: (0,31%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
210.000 AUD	17.730.271 ¥	15/09/2021	BNP Paribas	4	(2.143)	(0,01)
720.000 AUD	557.754 USD	15/09/2021	BNP Paribas	3	(17.039)	(0,03)
230.000 AUD	19.383.147 ¥	15/09/2021	Citibank NA	7	(2.025)	(0,00)
10.000 AUD	7.709 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(199)	(0,00)
130.000 AUD	100.407 USD	15/09/2021	Deutsche Bank AG	5	(2.778)	(0,01)
1.990.000 AUD	168.651.816 ¥	15/09/2021	Deutsche Bank AG	4	(26.048)	(0,05)
290.000 AUD	24.582.426 ¥	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(3.841)	(0,01)
10.000 AUD	846.388 ¥	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	1	(121)	(0,00)

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (2,87%) (31 de diciembre de 2020: (0,31%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
280.000 AUD	23.650.722 ¥	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	5	(2.951)	(0,01)
120.000 AUD	92.770 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	6	(2.651)	(0,01)
20.000 AUD	1.678.774 ¥	15/09/2021	UBS AG	1	(116)	(0,00)
70.000 AUD	53.684 USD	15/09/2021	UBS AG	5	(1.115)	(0,00)
20.000 BRL	4.015 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(66)	(0,00)
20.000 BRL	4.016 USD	15/09/2021	UBS AG	1	(67)	(0,00)
2.020.000 CAD	1.670.839 USD	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	(39.607)	(0,07)
20.000 CAD	16.455 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(304)	(0,00)
25.250 CAD	20.895 USD	01/09/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(504)	(0,00)
12.300 CAD	10.150 USD	01/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(217)	(0,00)
170.000 CAD	139.529 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	7	(2.247)	(0,01)
80.000 CAD	65.009 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	5	(406)	(0,00)
10.000 CAD	8.121 USD	15/09/2021	UBS AG	1	(45)	(0,00)
30.000 CHF	33.567 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(1.046)	(0,00)
50.000 CHF	55.599 USD	15/09/2021	Deutsche Bank AG	4	(1.396)	(0,00)
40.000 CHF	44.801 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(1.438)	(0,00)
60.000 CHF	67.038 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	3	(1.995)	(0,00)
590.000 CHF	658.440 USD	15/09/2021	UBS AG	3	(18.849)	(0,04)
94.150.000 CLP	131.555 USD	15/09/2021	BNP Paribas	1	(2.512)	(0,01)
6.970.000 CLP	9.687 USD	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	1	(133)	(0,00)
26.820.000 CLP	36.778 USD	15/09/2021	UBS AG	1	(18)	(0,00)
440.000 €	4.851.018 TRY	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	(14.537)	(0,03)
10.000 €	108.358 TRY	15/09/2021	BNP Paribas	1	(121)	(0,00)
105.581 €	480.000 PLN	15/09/2021	BNP Paribas	2	(706)	(0,00)
130.000 €	1.415.944 TRY	15/09/2021	Citibank NA	3	(2.378)	(0,01)
26.495 €	120.000 PLN	15/09/2021	Citibank NA	1	(58)	(0,00)
41.808 €	190.000 PLN	15/09/2021	Deutsche Bank AG	1	(261)	(0,00)
10.000 €	109.210 TRY	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(215)	(0,00)
80.000 €	97.823 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(2.802)	(0,01)
10.000 €	110.373 TRY	15/09/2021	Société Générale	1	(344)	(0,00)
80.000 €	97.213 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	3	(2.190)	(0,01)
20.000 €	216.314 TRY	15/09/2021	UBS AG	1	(197)	(0,00)
220.187 €	1.000.000 PLN	15/09/2021	UBS AG	10	(1.202)	(0,00)
1.000.000 €	1.219.497 USD	15/09/2021	UBS AG	1	(31.722)	(0,06)
1.700.000 £	2.402.484 USD	15/09/2021	BNP Paribas	2	(53.619)	(0,10)
70.000 £	99.002 USD	15/09/2021	Citibank NA	3	(2.284)	(0,01)

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (2,87%) (31 de diciembre de 2020: (0,31%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
10.000 £	13.923 USD	15/09/2021	Deutsche Bank AG	1	(106)	(0,00)
30.000 £	42.322 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(872)	(0,00)
40.000 £	56.176 USD	15/09/2021	Société Générale	2	(909)	(0,00)
50.000 £	70.509 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	3	(1.425)	(0,00)
3.380.000 HUF	11.488 USD	15/09/2021	BNP Paribas	1	(84)	(0,00)
206.730.000 HUF	723.228 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(25.726)	(0,05)
13.460.000 HUF	46.872 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(1.458)	(0,00)
6.050.000 HUF	20.679 USD	15/09/2021	UBS AG	1	(267)	(0,00)
200.000 ILS	61.545 USD	17/09/2021	Barclays Bank Plc	2	(111)	(0,00)
540.000 ILS	166.777 USD	17/09/2021	BNP Paribas	3	(904)	(0,00)
280.000 ILS	86.228 USD	17/09/2021	Citibank NA	2	(219)	(0,00)
2.610.000 ILS	804.627 USD	17/09/2021	Deutsche Bank AG	2	(2.907)	(0,01)
120.000 ILS	37.040 USD	17/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(179)	(0,00)
50.000 ILS	15.415 USD	17/09/2021	UBS AG	1	(56)	(0,00)
123.880.000 INR	1.682.545 USD	15/09/2021	Citibank NA	3	(31.505)	(0,06)
330.000 INR	4.460 USD	15/09/2021	Société Générale	1	(62)	(0,00)
4.170.000 INR	56.265 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(688)	(0,00)
2.220.000 ¥	20.105 USD	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	(90)	(0,00)
4.560.000 ¥	41.269 USD	15/09/2021	Citibank NA	2	(158)	(0,00)
14.909.729 ¥	180.000 AUD	15/09/2021	Citibank NA	7	(756)	(0,00)
1.690.000 ¥	15.295 USD	15/09/2021	Deutsche Bank AG	1	(58)	(0,00)
22.630.000 ¥	206.290 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	13	(2.264)	(0,01)
17.361.129 ¥	210.000 AUD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(1.185)	(0,00)
6.660.000 ¥	60.593 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	9	(548)	(0,00)
11.603.706 ¥	140.000 AUD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	6	(523)	(0,00)
1.410.000 ¥	12.839 USD	15/09/2021	UBS AG	2	(127)	(0,00)
30.725.644 ¥	370.000 AUD	15/09/2021	UBS AG	4	(852)	(0,00)
15.880.000 KRW	14.212 USD	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	(162)	(0,00)
654.260.000 KRW	586.574 USD	15/09/2021	Citibank NA	5	(7.715)	(0,02)
99.590.000 KRW	89.111 USD	15/09/2021	UBS AG	4	(999)	(0,00)
1.720.000 MXN	86.218 USD	17/09/2021	Barclays Bank Plc	1	(684)	(0,00)
22.470.000 MXN	1.122.032 USD	17/09/2021	Citibank NA	2	(4.628)	(0,01)
1.550.000 MXN	77.454 USD	17/09/2021	Deutsche Bank AG	1	(375)	(0,00)
3.850.000 MXN	193.066 USD	17/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	3	(1.611)	(0,00)
780.000 MXN	38.849 USD	17/09/2021	UBS AG	1	(60)	(0,00)

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (2,87%) (31 de diciembre de 2020: (0,31%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
7.150.000 NOK	865.103 USD	15/09/2021	Citibank NA	3	(33.955)	(0,06)
550.000 NOK	66.366 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(2.432)	(0,01)
580.000 NOK	69.995 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	5	(2.573)	(0,01)
1.240.000 NOK	149.623 USD	15/09/2021	UBS AG	4	(5.480)	(0,01)
20.000 NZD	14.182 USD	15/09/2021	BNP Paribas	1	(210)	(0,00)
650.000 NZD	468.645 USD	15/09/2021	Citibank NA	2	(14.562)	(0,03)
10.000 NZD	7.061 USD	15/09/2021	UBS AG	1	(75)	(0,00)
970.000 PHP	19.790 USD	15/09/2021	BNP Paribas	1	(44)	(0,00)
24.300.000 PHP	506.334 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(11.675)	(0,02)
50.000 PLN	11.164 €	15/09/2021	BNP Paribas	1	(124)	(0,00)
2.860.000 PLN	780.144 USD	15/09/2021	Citibank NA	4	(28.721)	(0,05)
2.310.000 PLN	516.723 €	15/09/2021	Citibank NA	2	(6.833)	(0,01)
70.000 PLN	15.695 €	15/09/2021	Morgan Stanley	1	(251)	(0,00)
80.000 PLN	17.879 €	15/09/2021	Société Générale	1	(218)	(0,00)
10.000 PLN	2.648 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(21)	(0,00)
190.000 PLN	51.910 USD	15/09/2021	UBS AG	2	(1.991)	(0,00)
690.000 PLN	152.972 €	15/09/2021	UBS AG	7	(409)	(0,00)
6.360.000 SEK	768.912 USD	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	(24.710)	(0,05)
300.000 SEK	36.122 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(1.019)	(0,00)
120.000 SEK	14.172 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(131)	(0,00)
810.000 SEK	98.024 USD	15/09/2021	UBS AG	2	(3.243)	(0,01)
2.280.000 SGD	1.722.355 USD	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	(26.500)	(0,05)
560.000 THB	17.479 USD	15/09/2021	BNP Paribas	2	(12)	(0,00)
4.860.000 THB	155.813 USD	15/09/2021	Citibank NA	4	(4.221)	(0,01)
1.330.000 THB	42.250 USD	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	1	(766)	(0,00)
1.500.000 TRY	171.165 USD	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	(5.069)	(0,01)
1.707.194 TRY	160.000 €	15/09/2021	BNP Paribas	1	(1.005)	(0,00)
590.000 TRY	65.811 USD	15/09/2021	BNP Paribas	1	(479)	(0,00)
317.702 TRY	30.000 €	15/09/2021	Citibank NA	1	(454)	(0,00)
560.000 TRY	62.328 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(318)	(0,00)
300.000 TRY	34.381 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(1.161)	(0,00)
13.933 USD	20.000 NZD	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	(38)	(0,00)
37.409 USD	50.000 AUD	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	(141)	(0,00)
133.668 USD	180.000 SGD	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	(215)	(0,00)
16.599 USD	18.790.000 KRW	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	(26)	(0,00)
438.950 USD	3.970.000 TRY	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	(652)	(0,00)
104.934 USD	2.200.000 MXN	17/09/2021	BNP Paribas	1	(4.469)	(0,01)
181.372 USD	205.800.000 KRW	15/09/2021	BNP Paribas	7	(711)	(0,00)

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (2,87%) (31 de diciembre de 2020: (0,31%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
45.090 USD	410.000 TRY	15/09/2021	BNP Paribas	3	(309)	(0,00)
50.544 USD	38.210.000 CLP	15/09/2021	BNP Paribas	1	(1.827)	(0,00)
79.654 USD	260.000 ILS	17/09/2021	BNP Paribas	1	(211)	(0,00)
24.312 USD	210.000 NOK	15/09/2021	BNP Paribas	1	(100)	(0,00)
22.511 USD	30.000 AUD	15/09/2021	Citibank NA	2	(19)	(0,00)
32.252 USD	40.000 CAD	15/09/2021	Citibank NA	1	(50)	(0,00)
62.764 USD	90.000 NZD	15/09/2021	Citibank NA	5	(108)	(0,00)
42.917 USD	390.000 TRY	15/09/2021	Citibank NA	2	(268)	(0,00)
267.562 USD	360.000 SGD	15/09/2021	Citibank NA	3	(204)	(0,00)
89.199 USD	6.700.000 INR	15/09/2021	Citibank NA	2	(97)	(0,00)
238.500 USD	269.800.000 KRW	15/09/2021	Citibank NA	3	(207)	(0,00)
39.265 USD	150.000 PLN	15/09/2021	Citibank NA	1	(145)	(0,00)
36.860 USD	120.000 ILS	17/09/2021	Citibank NA	1	(1)	(0,00)
167.292 USD	3.400.000 MXN	17/09/2021	Citibank NA	1	(1.786)	(0,00)
27.633 USD	20.000 £	15/09/2021	Citibank NA	1	(1)	(0,00)
314.131 USD	93.400.000 HUF	15/09/2021	Citibank NA	2	(998)	(0,00)
75.678 USD	650.000 SEK	15/09/2021	Citibank NA	1	(380)	(0,00)
54.378 USD	40.060.000 CLP	15/09/2021	Citibank NA	2	(528)	(0,00)
15.011 USD	20.000 AUD	15/09/2021	Deutsche Bank AG	1	(8)	(0,00)
186.219 USD	1.610.000 NOK	15/09/2021	Deutsche Bank AG	4	(934)	(0,00)
192.800 USD	240.000 CAD	15/09/2021	Deutsche Bank AG	2	(1.009)	(0,00)
103.743 USD	890.000 SEK	15/09/2021	Deutsche Bank AG	1	(399)	(0,00)
16.581 USD	1.840.000 ¥	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(8)	(0,00)
57.953 USD	530.000 TRY	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(735)	(0,00)
49.788 USD	190.000 PLN	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(132)	(0,00)
12.434 USD	180.000 ZAR	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(49)	(0,00)
206.970 USD	150.000 £	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(283)	(0,00)
24.265 USD	210.000 NOK	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(147)	(0,00)
56.402 USD	70.000 CAD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	4	(126)	(0,00)
43.720 USD	910.000 MXN	17/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(1.533)	(0,00)
43.246 USD	370.000 SEK	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(49)	(0,00)
37.157 USD	50.000 SGD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(33)	(0,00)
37.483 USD	50.000 AUD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(67)	(0,00)
155.967 USD	210.000 SGD	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	1	(231)	(0,00)
49.961 USD	37.490.000 CLP	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	1	(1.424)	(0,00)
349.751 USD	1.140.000 ILS	17/09/2021	Royal Bank of Scotland	2	(426)	(0,00)
472.537 USD	9.780.000 MXN	17/09/2021	Royal Bank of Scotland	2	(13.810)	(0,03)
8.304 USD	120.000 ZAR	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(18)	(0,00)

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (2,87%) (31 de diciembre de 2020: (0,31%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
46.168 USD	13.770.000 HUF	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(292)	(0,00)
24.192 USD	30.000 CAD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(34)	(0,00)
90.454 USD	130.000 NZD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	4	(362)	(0,00)
89.044 USD	100.900.000 KRW	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(228)	(0,00)
9.253 USD	190.000 MXN	17/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(195)	(0,00)
74.329 USD	100.000 SGD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(51)	(0,00)
22.522 USD	30.000 AUD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(8)	(0,00)
22.521 USD	30.000 AUD	15/09/2021	UBS AG	2	(9)	(0,00)
37.153 USD	50.000 SGD	15/09/2021	UBS AG	1	(37)	(0,00)
80.772 USD	1.640.000 MXN	17/09/2021	UBS AG	1	(783)	(0,00)
54.678 USD	62.010.000 KRW	15/09/2021	UBS AG	3	(185)	(0,00)
8.851 USD	6.520.000 CLP	15/09/2021	UBS AG	1	(85)	(0,00)
89.134 USD	340.000 PLN	15/09/2021	UBS AG	3	(196)	(0,00)
19.902 USD	180.000 TRY	15/09/2021	UBS AG	1	(30)	(0,00)
68.434 USD	350.000 BRL	15/09/2021	UBS AG	5	(680)	(0,00)
3.071 USD	10.000 ILS	17/09/2021	UBS AG	1	(0)	(0,00)
33.933 USD	490.000 ZAR	15/09/2021	UBS AG	1	(49)	(0,00)
55.213 USD	16.480.000 HUF	15/09/2021	UBS AG	1	(390)	(0,00)
9.110.000 ZAR	661.977 USD	15/09/2021	BNP Paribas	1	(30.190)	(0,06)
50.000 ZAR	3.505 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(38)	(0,00)
960.000 ZAR	69.091 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	5	(2.515)	(0,01)
60.000 ZAR	4.370 USD	15/09/2021	Morgan Stanley	1	(209)	(0,00)
250.000 ZAR	18.087 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(749)	(0,00)
220.000 ZAR	16.000 USD	15/09/2021	UBS AG	1	(742)	(0,00)
Clases CHF con cobertura						
789.214 CHF	858.574 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	4	(4.374)	(0,01)
757.056 CHF	822.918 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(3.524)	(0,01)
791.181 CHF	860.052 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	(3.724)	(0,01)
Clases EUR con cobertura						
1.091.556 €	1.309.130 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	(14.189)	(0,03)
1.056.379 €	1.265.948 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(12.738)	(0,02)
1.282.802 €	1.537.280 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	21	(15.458)	(0,03)
Clases GBP con cobertura						
2.191 £	3.058 USD	19/07/2021	UBS AG	3	(31)	(0,00)
1.139 £	1.611 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(37)	(0,00)

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (2,87%) (31 de diciembre de 2020: (0,31%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases GBP con cobertura (cont.)						
93.345 USD	67.813 £	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(340)	(0,00)
93.355 USD	67.813 £	19/07/2021	UBS AG	1	(330)	(0,00)
91.921 USD	66.801 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(366)	(0,00)
Clases JPY con cobertura						
1.685.529.802 ¥	15.487.959 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(299.522)	(0,56)
1.758.415.108 ¥	16.141.121 USD	19/07/2021	UBS AG	4	(295.909)	(0,55)
1.692.203.514 ¥	15.552.438 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	(303.863)	(0,56)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(1.540.822)	(2,87)

Contratos de futuros (0,06%) (31 de diciembre de 2020: (0,26%))

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(46)	3-Month Euro Euribor Future December 2023	(1.883)	(0,00)
(39)	90-Day Eurodollar Future June 2023	(125)	(0,00)
(29)	90-Day Eurodollar Future December 2023	(612)	(0,00)
(98)	90-Day Sterling Future March 2023	(7.045)	(0,01)
(3)	Canadian 10-Year Bond Future September 2021	(3.230)	(0,01)
(3)	Euro-BOBL Future September 2021	(747)	(0,00)
6	Euro-BTP Future September 2021	(581)	(0,00)
(1)	Euro-Bund Future September 2021	(1.138)	(0,00)
(1)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2021	(4.008)	(0,01)
(1)	Euro-OAT Future September 2021	(700)	(0,00)
1	Hang Seng China Enterprises Index Future July 2021	(1.642)	(0,01)
1	Hang Seng Index Future July 2021	(534)	(0,00)
3	Nikkei 225 Mini Future September 2021	(176)	(0,00)
(2)	S&P 500 E-mini Future September 2021	(4.300)	(0,01)
7	SGX Nifty 50 Future July 2021	(1.305)	(0,00)
(1)	United Kingdom Long Gilt Future September 2021	(1.299)	(0,00)
(3)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2021	(2.297)	(0,01)
(11)	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2021	(1.117)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de futuros ⁺		(32.739)	(0,06)

Contratos de opciones sobre renta variable suscritos (0,00%) (31 de diciembre de 2020: (0,00%))

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de compra					
2	16/07/2021	At Home Group Inc, Strike Price \$37	88	(15)	(0,00)
Total valor razonable en contratos de opciones sobre renta variable suscritos ⁺				(15)	(0,00)

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,09%) (31 de diciembre de 2020: (2,59%))

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(4.336)	3D Systems Corp	JPMorgan Chase Bank	(68.085)	(0,13)
(399)	3M Co	JPMorgan Chase Bank	(12.333)	(0,02)
(1.020)	Acuity Brands Inc	JPMorgan Chase Bank	(25.300)	(0,05)
933	Adapteo OYJ	JPMorgan Chase Bank	(431)	(0,00)
(4.909)	Adtalem Global Education Inc	JPMorgan Chase Bank	(22.544)	(0,04)
(5.430)	Advanced Micro Devices Inc	JPMorgan Chase Bank	(57.989)	(0,10)
8.427	Aggreko Plc	JPMorgan Chase Bank	(1.412)	(0,00)
(652)	Air Liquide SA	Morgan Stanley	(21.397)	(0,04)
(411)	Allianz SE	Morgan Stanley	(11.440)	(0,02)
944	Ampol Ltd	JPMorgan Chase Bank	(2.448)	(0,00)
(2.394)	Analog Devices Inc	JPMorgan Chase Bank	(98.207)	(0,18)
(968)	Anheuser-Busch InBev SA	Morgan Stanley	(11.640)	(0,02)
27.862	Anima Holdings SPA	Morgan Stanley	(6.516)	(0,01)
(2.400)	Aon Plc	JPMorgan Chase Bank	(87.349)	(0,16)
(1.275)	Apollo Global Management Inc	JPMorgan Chase Bank	(7.224)	(0,01)
29	ASOS Plc	Morgan Stanley	(392)	(0,00)
(7.965)	AstraZeneca Plc	JPMorgan Chase Bank	(75.187)	(0,14)
(234)	AvalonBay Communities Inc	Morgan Stanley	(3.747)	(0,01)
(1.087)	Avangrid Inc	JPMorgan Chase Bank	(5.382)	(0,01)
(2.151)	AXA SA	Morgan Stanley	(3.903)	(0,01)
(3.460)	B&G Foods Inc	JPMorgan Chase Bank	(11.835)	(0,02)
(630)	Bank of Montreal	Morgan Stanley	(9.259)	(0,02)
(897)	BASF SE	Morgan Stanley	(13.539)	(0,03)
(619)	Bayerische Motoren Werke AG	Morgan Stanley	(22.416)	(0,04)
(6.563)	Beachbody Co Inc	JPMorgan Chase Bank	(3.263)	(0,01)
(867)	Belden Inc	JPMorgan Chase Bank	(3.201)	(0,01)
(1.077)	Beyond Meat Inc	JPMorgan Chase Bank	(19.331)	(0,04)
4.459	BGC Partners Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(476)	(0,00)
(2.035)	Blink Charging Co	JPMorgan Chase Bank	(17.693)	(0,03)
(3.120)	Bloom Energy Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	(7.929)	(0,01)

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,09%) (31 de diciembre de 2020: (2,59%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
37	Booking Holdings Inc	Morgan Stanley	(9.034)	(0,02)
(1.712)	Bunzl Plc	Morgan Stanley	(9.366)	(0,02)
(550)	Canadian Imperial Bank of Commerce	JPMorgan Chase Bank	(8.197)	(0,02)
2.673	Canadian National Railway Co	JPMorgan Chase Bank	(9.961)	(0,02)
(1.590)	Canadian Pacific Railway Ltd	JPMorgan Chase Bank	(6.860)	(0,01)
(400)	Canadian Tire Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	(16.080)	(0,03)
6.676	CapitaLand Ltd	JPMorgan Chase Bank	(148)	(0,00)
(2.310)	Carparts.Com	JPMorgan Chase Bank	(9.660)	(0,02)
471	Chubb Ltd	Morgan Stanley	(5.389)	(0,01)
(964)	Colgate-Palmolive Co	Morgan Stanley	(5.196)	(0,01)
(139)	Credit Acceptance Corp	JPMorgan Chase Bank	(13.137)	(0,02)
(181)	Credit Acceptance Corp	Morgan Stanley	(13.461)	(0,03)
(891)	Daimler AG	Morgan Stanley	(37.626)	(0,07)
4.567	Danone	Morgan Stanley	(30.092)	(0,06)
(1.479)	Deutsche Post AG	Morgan Stanley	(45.674)	(0,09)
(2.653)	Deutsche Telekom AG	Morgan Stanley	(11.752)	(0,02)
5.584	Deutsche Wohnen SE	JPMorgan Chase Bank	(13.429)	(0,03)
1.466	Eagle Materials Inc	JPMorgan Chase Bank	(279)	(0,00)
(376)	Elisa OYJ	Morgan Stanley	(2.207)	(0,00)
(4.395)	Enel SpA	Morgan Stanley	(4.631)	(0,01)
(99)	Equinix Inc	JPMorgan Chase Bank	(2.881)	(0,01)
4.531	Equitable Holdings Inc	Morgan Stanley	(9.601)	(0,02)
(696)	Equity Residential	Morgan Stanley	(1.527)	(0,00)
4.690	Euskaltel SA	JPMorgan Chase Bank	(660)	(0,00)
542	Expedia Inc	Morgan Stanley	(3.111)	(0,01)
(146)	Fair Isaac Corp	JPMorgan Chase Bank	(3.159)	(0,01)
573	Fidelity National Formation Services	Morgan Stanley	(2.193)	(0,00)
234	Fidelity National Information Services Inc	JPMorgan Chase Bank	(977)	(0,00)
100	Fonciere Lyonnaise SA	JPMorgan Chase Bank	(811)	(0,00)
(1.772)	Fox Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	(10.581)	(0,02)
1.151	Gamesys Group Plc	JPMorgan Chase Bank	(674)	(0,00)
(23)	Givaudan SA	Morgan Stanley	(54.220)	(0,10)
(671)	Green Realty Corp	Morgan Stanley	(2.728)	(0,01)
(808)	Guidewire Software Inc	JPMorgan Chase Bank	(8.481)	(0,02)
(1.500)	HealthEquity Inc	JPMorgan Chase Bank	(14.936)	(0,03)
(2.013)	HelloFresh SE	JPMorgan Chase Bank	(40.354)	(0,08)
(2.701)	Hennes & Mauritz AB - B Shares	Morgan Stanley	(11.224)	(0,02)
(8.651)	Hyllion Holdings Corp	JPMorgan Chase Bank	(27.671)	(0,05)

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,09%) (31 de diciembre de 2020: (2,59%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
1.914	Hypermarcas SA	Morgan Stanley	(1.512)	(0,00)
(618)	ICON Plc	JPMorgan Chase Bank	(15.995)	(0,03)
(749)	International Flavors & Fragrances Inc	JPMorgan Chase Bank	(17.125)	(0,03)
(1.440)	JM Smucker Co	JPMorgan Chase Bank	(14.426)	(0,03)
(38)	JM Smucker Co	Morgan Stanley	(87)	(0,00)
13.977	John Laing Group Plc	JPMorgan Chase Bank	(820)	(0,00)
(1.590)	JPMorgan Basket 315	JPMorgan Chase Bank	(1.994)	(0,00)
(1.560)	JPMorgan Basket 316	JPMorgan Chase Bank	(4.174)	(0,01)
(1.545)	JPMorgan Basket 317	JPMorgan Chase Bank	(3.718)	(0,01)
(1.570)	JPMorgan Basket 318	JPMorgan Chase Bank	(2.064)	(0,00)
(1.570)	JPMorgan Basket 319	JPMorgan Chase Bank	(1.521)	(0,00)
(1.565)	JPMorgan Basket 320	JPMorgan Chase Bank	(291)	(0,00)
(1.570)	JPMorgan Basket 322	JPMorgan Chase Bank	(10)	(0,00)
(1.560)	JPMorgan Basket JPCR324	JPMorgan Chase Bank	(303)	(0,00)
(2.932)	Kellogs Co	JPMorgan Chase Bank	(7.901)	(0,01)
(3.206)	Koninklijke Ahold NV	Morgan Stanley	(21.464)	(0,04)
(1.328)	Koninklijke Philips NV	Morgan Stanley	(3.396)	(0,01)
(4.193)	Kroger Co	JPMorgan Chase Bank	(5.128)	(0,01)
(395)	L'Oréal SA	Morgan Stanley	(60.938)	(0,11)
(6.256)	Lordstown Motors Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	(11.377)	(0,02)
(402)	Lululemon Athletica Inc	JPMorgan Chase Bank	(23.065)	(0,04)
(270)	Merck & Co Inc	Morgan Stanley	(942)	(0,00)
(124)	Middleby Corp	JPMorgan Chase Bank	(959)	(0,00)
4.558	Natexis	JPMorgan Chase Bank	(387)	(0,00)
(400)	National Bank of Canada	JPMorgan Chase Bank	(846)	(0,00)
(242)	Next Plc	Morgan Stanley	(8.895)	(0,02)
4.568	Nextera Energy Inc	JPMorgan Chase Bank	(12.404)	(0,02)
(273)	NIKE Inc Class B	Morgan Stanley	(19.244)	(0,04)
(6.364)	Nokia OYJ	Morgan Stanley	(8.481)	(0,02)
1.036	Norwegian Finans Holding ASA	JPMorgan Chase Bank	(26)	(0,00)
(1.163)	Omnicom Group Inc	JPMorgan Chase Bank	(25.476)	(0,05)
717	Orange Belgium SA	JPMorgan Chase Bank	(2.955)	(0,01)
(6.669)	Pearson Plc	JPMorgan Chase Bank	(16.043)	(0,03)
(464)	Pfizer Inc	Morgan Stanley	(1.150)	(0,00)
7.243	PG&E Corp	Morgan Stanley	(12.151)	(0,02)
13.172	Primo Water Corp	JPMorgan Chase Bank	(6.191)	(0,01)
1.229	Qualcomm Inc	JPMorgan Chase Bank	(4.816)	(0,01)
(966)	S&P Global Inc	JPMorgan Chase Bank	(48.183)	(0,09)

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,09%) (31 de diciembre de 2020: (2,59%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(1.187)	Salesforce.com	JPMorgan Chase Bank	(14.029)	(0,03)
6.171	Sbanken ASA	JPMorgan Chase Bank	(202)	(0,00)
(514)	Schneider Electric SA	Morgan Stanley	(26.123)	(0,05)
(894)	Shake Shack Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(16.439)	(0,03)
(617)	Siemens AG	Morgan Stanley	(22.217)	(0,04)
(1.436)	Signify NV	JPMorgan Chase Bank	(26.003)	(0,05)
338	SIMMO AG	JPMorgan Chase Bank	(438)	(0,00)
45.568	Soho China Ltd	JPMorgan Chase Bank	(1.502)	(0,00)
1.142	Solarpack Corporacion Tecnologica SA	JPMorgan Chase Bank	(813)	(0,00)
6.099	Spire Healthcare Group Plc	JPMorgan Chase Bank	(375)	(0,00)
(69)	Swisscom AG	Morgan Stanley	(3.585)	(0,01)
(2.799)	Tapestry Inc	JPMorgan Chase Bank	(2.181)	(0,00)
854	Tarkett SA	JPMorgan Chase Bank	(878)	(0,00)
(222)	Teledyne Technologies Inc	JPMorgan Chase Bank	(9.097)	(0,02)
(63)	Tesla Motors Inc	Morgan Stanley	(1.782)	(0,00)
(784)	Trupanion Inc	JPMorgan Chase Bank	(30.503)	(0,06)
14.571	Vectura Group PLC	JPMorgan Chase Bank	(43)	(0,00)
(731)	Vinci SA	Morgan Stanley	(4.985)	(0,01)
28.514	Vocus Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	(1.089)	(0,00)
(1.019)	Wabtec Corp	JPMorgan Chase Bank	(2.410)	(0,00)
1.512	Walt Disney Co	JPMorgan Chase Bank	(17.675)	(0,03)
4.279	Webster Financial Corp	JPMorgan Chase Bank	(15.276)	(0,03)
(707)	World Acceptance Corp	Morgan Stanley	(13.734)	(0,03)
Minusvalía latente total sobre contratos por diferencias [∞]			(1.657.673)	(3,09)
			Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados			(3.231.249)	(6,02)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados			23.727.518	44,21
Otro activo neto			29.941.540	55,79
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables			53.669.058	100,00

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

Análisis de la cartera	USD	% de los Activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	24.048.256	41,85
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	420.027	0,73
± Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	255.830	0,45
∅ Otros valores	621.863	1,08
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(1.618.458)	(2,82)
Total inversiones	23.727.518	41,29

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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 período 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 período. Como mínimo, se presentan las 20 compras y las 20 ventas más importantes, siempre que se disponga de dicha información.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
38.024	Nuance Communications Inc	2.024.629
30.608	Sunrun Inc	2.020.066
6.400	Coherent Inc	1.650.935
10.200	Alexion Pharmaceuticals Inc	1.608.708
8.968	Proofpoint Inc	1.542.735
16.940	RealPage Inc	1.468.878
18.244	CoreLogic Inc	1.456.154
24.176	Webster Financial Corp	1.379.659
6.240	GW Pharmaceuticals Inc ADR	1.336.436
17.344	State Street Corp	1.324.353
71.396	Hayward Holdings Inc	1.214.631
45.576	Clarivate Analytics Plc	1.185.524
32.344	HMS Holdings Corp	1.184.514
50.716	Change Healthcare Inc	1.168.030
31.812	Luminex Corp	1.166.618
17.776	Talend SA ADR	1.145.000
23.988	BJ's Restaurants Inc	1.127.698
15.476	Cubic Corp	1.123.688
9.848	Acacia Communications Inc Class B	1.123.528
38.596	Perspecta Inc	1.117.266
24.096	PPD Inc	1.109.263
10.000	IHS Markit Ltd	1.033.258
3.852	Kansas City Southern	1.030.035
36.292	Shaw Communications Inc Class B	1.005.783
25.472	At Home Group Inc	931.751
16.000	Cooper Tire & Rubber	908.064
6.000	PRA Health Sciences Inc	882.724
16.324	Viela Bio Inc	864.202
6.680	Woodward Inc	848.714
20.612	Hancock Whitney Corp	836.621
4.748	Marriott Vacations Worldwide Corp	820.437
61.560	Paya Holdings Inc Class A	787.058
18.000	Slack Technologies Inc Class A	769.066

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

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
4.400.000	Hilton Orlando Trust 2018-ORL Class E, 2.81%, 15/12/2034	4.376.109
4.000.000	Gallatin CLO IX 2018-1 Ltd Class D1, 3.31%, 21/01/2028	3.993.000
4.000.000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-SLP Class E, 4.59%, 10/10/2032	3.967.063
4.000.000	Black Diamond CLO 2017-1 Ltd Class C, 4.16%, 24/04/2029	3.930.800
4.000.000	Catamaran CLO 2013-1 Ltd Class DR, 3.02%, 27/01/2028	3.901.200
3.169.360	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M3, 5.70%, 25/07/2028	3.324.361
3.209.791	Motel 6 Trust 2017-MTL6 Class E, 3.41%, 15/08/2034	3.218.443
2.984.340	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2, 3.80%, 25/09/2029	3.055.334
2.949.523	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2, 2.30%, 25/10/2030	2.955.515
1.974.148	NRZ Excess Spread-Collateralized Class D, 4.69%, 25/05/2023	1.974.148
13.532	JPMorgan Chase & Co	1.951.065
60.920	e.l.f. Beauty Inc	1.510.810
11.008	Eagle Materials Inc	1.450.082
17.344	State Street Corp	1.431.074
9.968	Regal Beloit Corp	1.403.223
2.024	Equinix Inc	1.375.790
24.176	Webster Financial Corp	1.354.018
14.944	Grubhub Inc	1.071.543
38.128	Nomad Foods Ltd	955.656
4.100	Valmont Industries Inc	903.990
18.192	Terminix Global Holdings Inc	901.547
18.584	Marvell Technology Inc	863.784
15.196	Stewart Information Services	856.413
5.468	PTC Inc	704.338

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund

Informe del Gestor de inversiones

En el semestre finalizado el 30 de junio de 2021, la rentabilidad total de las acciones de la Clase de acumulación I USD fue del 3,08%. En el mismo periodo, los dos índices de referencia, el S&P 500 (Total Return, Net of Tax, USD) y el HFRX Equity Hedge (USD Total Return), rindieron un 15,00% y un 7,86%, respectivamente. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso.)

Durante el periodo, el S&P 500 alcanzó nuevos máximos históricos. Los datos económicos continuaron siendo sólidos al bajar el desempleo a mínimos de varios años y dispararse los índices de gestores de compras del sector manufacturero global ("PMI") a máximos no vistos en 15 años. Por otra parte, la demanda agregada se mantuvo elevada (con aumentos de precios de muchos bienes y servicios) gracias a una combinación de programas de estímulos monetarios y fiscales masivos con el gasto contenido hasta la fecha por diversas medidas de confinamiento y restricciones sobre los viajes aplicadas en todo el mundo. Las noticias de unos datos económicos más sólidos y aumento de la inflación empujaron al Consejo de la Reserva Federal estadounidense a acelerar el calendario de subidas de tipos —de cero subidas previstas para 2023 a dos potenciales—. Sin embargo, continúa el debate acerca de si el aumento de precios será efímero o más sostenible, especialmente cuando se resuelvan los problemas de la cadena de suministro y el elevado gasto de los consumidores regrese a las medias a más largo plazo.

Clasificamos las posiciones largas de la cartera en tres categorías: apreciación del capital, rentabilidad total y oportunistas. Las inversiones de apreciación del capital presentan atractivos fundamentales sectoriales, fuertes posiciones competitivas, ingresos crecientes e interesantes oportunidades de reinversión. Las inversiones de rentabilidad total presentan flujos de ingresos sostenibles o crecientes respaldados por el valor de los activos, que pueden dar lugar a un incremento de la rentabilidad en efectivo para los accionistas (por ejemplo, mayores dividendos, recompras de acciones, devoluciones del capital). La categoría de rentabilidad total incluye también posiciones de renta fija, actualmente sobre todo valores de alta rentabilidad. Las inversiones oportunistas son aquellas que presentan catalizadores identificables. En esta categoría se clasifican las empresas con cambios en su dirección, reorganizaciones sociales, actividad de fusiones y adquisiciones, «activos ocultos» y otras distorsiones del mercado que pueden hacer emerger su valor intrínseco. Se pueden utilizar posiciones cortas para incrementar la rentabilidad y/o reducir los riesgos, en una combinación que dependerá en parte del contexto en el que opere la Cartera: las posiciones cortas de fundamentales (valores relacionados con empresas concretas) pueden caracterizarse por ideas basadas en catalizadores, posibles incumplimientos de las previsiones de beneficios, cambios en el panorama competitivo y/o posiciones cortas temáticas, por ejemplo. Las posiciones cortas del mercado se utilizan para intentar gestionar exposición y reducir los riesgos del mercado general.

Las posiciones largas en renta variable generaron una rentabilidad inferior en el periodo analizado, especialmente debido a la selección de valores en los sectores de tecnología de la información y energía. En la parte larga, las categorías de apreciación del capital, rentabilidad total y oportunista cerraron el periodo en positivo. En contraste, las posiciones cortas en títulos concretos y las posiciones cortas del mercado para cubrir la Cartera restaron rentabilidad desde una perspectiva de su contribución, en parte debido al avance generalizado que experimentó el mercado durante el periodo del informe.

De cara al futuro, creemos que una política monetaria y fiscal sin precedentes y la confianza de los consumidores serán una buena medicina para la economía. Cabe esperar que esto favorezca un repunte duradero y sostenible del crecimiento del PIB y a las expectativas de beneficios, dado que la confianza de los consumidores (con un balance más saneado) es el ingrediente fundamental para una economía impulsada por los consumidores. Si esto se materializa, creemos que podríamos presenciar una tasa de proyección de los beneficios corporativos de 2021 superior a la que se pronostica en estos momentos, a pesar de que se ha registrado un aumento del 14% en lo que va de año. Ahora nos enfrentamos a una dinámica de principio del ciclo que no veíamos desde hace una década: un crecimiento superior al tendencial del PIB y los beneficios de las empresas, caídas del desempleo y tipos de interés ultrabajos. Las start-up están floreciendo y el sector financiero se asienta sobre cimientos sólidos. La economía "online" ha mantenido en funcionamiento a Estados Unidos durante los días más oscuros de la pandemia y sigue creciendo por su relevancia tanto para empresas como para consumidores. No obstante, somos conscientes de que el entorno de inversión no está exento de dificultades. Este entorno está dominado por una confluencia de consideraciones en materia de política fiscal, estímulos de la política monetaria, preocupación por la salud pública, incertidumbre geopolítica, volatilidad de los precios de las materias primas, dinámica de inflación y constantes interrogantes (por ejemplo, la reactivación de la economía). Seguimos centrándonos en reflexionar en profundidad y con creatividad y nos esforzamos por ofrecer siempre rentabilidades atractivas ajustadas por el riesgo. Dadas las vicisitudes de una economía cada vez más globalizada, también procuraremos mantener la flexibilidad en nuestras decisiones y una actitud abierta a nuevas ideas en diversos sectores, clases de activos y zonas geográficas.

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		437.562.974	352.946.599
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	35.320.109	37.369.785
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		2.569.209	1.389.657
Cuentas a percibir por acciones emitidas		2.455.319	2.141.065
Cuentas por cobrar de intermediarios		33.924.102	23.425.281
Ingresos a percibir y otros activos		399.502	387.354
Activos totales		512.231.215	417.659.741
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		26.322.204	14.308.630
Descubierto bancario	3	–	227
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		1.339.078	239.651
Gastos devengados		565.248	479.257
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		10.308.641	4.092.316
Otras cuentas por pagar		448.330	539.635
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		38.983.501	19.659.716
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		473.247.714	398.000.025

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		340.282	374.156
Ingresos por dividendos		2.651.437	1.001.602
Ingresos por préstamo de valores	15	9.470	378
Ingresos varios		6.973	35.829
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		10.381.978	3.467.039
		13.390.140	4.879.004
Gastos			
Comisión de gestión	5	2.529.837	1.071.268
Comisión de distribución	5	29.433	33.036
Comisión de administración	5	198.877	127.635
Comisión de compromiso	16	23.367	8.130
Comisión de depósito	5	5.962	5.997
Comisión del Depositario	5	11.106	7.838
Honorarios profesionales	7	59.427	23.029
Honorarios de los Consejeros	6	2.413	2.375
Comisión de rentabilidad	5	206.390	134.072
Costes de transacciones	7	153.984	103.299
Honorarios de auditoría	7	10.481	8.800
Reembolso de IVA		(1.922)	(518)
Otros gastos	7	75.069	16.066
Gastos totales		3.304.424	1.541.027
Gastos por intereses		–	2.735
		–	2.735
Impuestos retenidos en origen		665.237	244.897
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		9.420.479	3.090.345

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	398.000.025	154.323.514
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	9.420.479	3.090.345
Suscripciones	127.304.437	125.043.327
Reembolsos	(61.477.227)	(28.074.467)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	473.247.714	254.382.719

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (cont.)

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 89,20% (31 de diciembre de 2020: 83,76%)			
Dólar estadounidense			
58.900	Activision Blizzard Inc	5.621.416	1,19
16.752	Adobe Inc	9.810.641	2,07
18.420	Air Products & Chemicals Inc	5.299.066	1,12
4.950	Alphabet Inc Class A	12.086.860	2,55
47	Alphabet Inc Class C	117.797	0,02
3.619	Amazon.com Inc	12.449.939	2,63
43.660	Amphenol Corp Class A	2.986.781	0,63
122.209	Anaplan Inc	6.513.740	1,38
100.491	Apollo Global Management Inc Class A	6.250.540	1,32
66.584	Apple Inc	9.119.345	1,93
23.188	Asbury Automotive Group Inc	3.973.728	0,84
92.000	Ashland Global Holdings Inc	8.050.000	1,70
3.085	ASML Holding NV	2.131.241	0,45
12.350	Avery Dennison Corp	2.596.464	0,55
11.220	Becton Dickinson & Co	2.728.592	0,58
2.880	BlackRock Inc Class A	2.519.914	0,53
45.194	Blackstone Group Inc	4.390.145	0,93
112.050	Brookfield Asset Management Inc Class A	5.712.309	1,21
772	Brookfield Asset Management Reinsurance Partners Ltd Class A	40.159	0,01
84.616	Brookfield Infrastructure Partners LP	4.700.419	0,99
27.780	CDW Corp	4.851.777	1,02
111.716	CenterPoint Energy Inc	2.739.276	0,58
27.097	Chevron Corp	2.838.140	0,60
46.094	Chewy Inc Class A	3.674.153	0,78
69.664	Citigroup Inc	4.928.728	1,04
29.770	CME Group Inc Class A	6.331.484	1,34
4.490	Costco Wholesale Corp	1.776.558	0,37
27.995	Dollar Tree Inc	2.785.502	0,59
36.970	DoubleVerify Holdings Inc	1.565.310	0,33
155.731	Duck Creek Technologies Inc	6.775.856	1,43
259.350	Dun & Bradstreet Holdings Inc	5.542.309	1,17
114.550	Enbridge Inc	4.586.582	0,97
266.110	Enterprise Products Partners LP	6.421.234	1,36
33.900	Equifax Inc	8.119.389	1,72
71.808	Equitable Holdings Inc	2.186.554	0,46
28.530	Expedia Group Inc	4.670.646	0,99
21.300	Facebook Inc Class A	7.406.223	1,56

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (cont.)

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 89,20% (31 de diciembre de 2020: 83,76%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
12.400	FedEx Corp	3.699.292	0,78
41.080	Fidelity National Information Services Inc	5.819.804	1,23
20.973	Floor & Decor Holdings Inc Class A	2.216.846	0,47
29.887	Frontier Communications Parent Inc	789.017	0,17
23.403	Home Depot Inc	7.462.983	1,58
13.590	Honeywell International Inc	2.980.967	0,63
13.400	Humana Inc	5.932.448	1,25
82.770	IHS Markit Ltd	9.324.868	1,97
107.100	Independence Holdings Corp	1.071.000	0,23
23.460	Johnson & Johnson	3.864.800	0,82
35.486	JPMorgan Chase & Co	5.519.492	1,17
258.175	Keurig Dr Pepper Inc	9.098.087	1,92
22.930	L3Harris Technologies Inc	4.956.320	1,05
60.993	Lamb Weston Holdings Inc	4.919.695	1,04
226.391	Legalzoom.com Inc	8.568.899	1,81
16.400	LKQ Corp	807.208	0,17
21.200	Marriott International Inc Class A	2.894.224	0,61
39.650	McDonald's Corp	9.158.754	1,93
48.632	Medtronic Plc	6.036.690	1,28
41.000	Microsoft Corp	11.106.900	2,35
60.264	Mondelez International Inc Class A	3.762.884	0,79
124.956	NextEra Energy Inc	9.156.776	1,93
25.600	NIKE Inc Class B	3.954.944	0,84
108.842	nVent Electric Plc	3.400.224	0,72
38.900	OneSpaWorld Holdings Ltd	376.941	0,08
1.749	O'Reilly Automotive Inc	990.301	0,21
7.300	Parker-Hannifin Corp	2.241.903	0,47
191.300	Paya Holdings Inc Class A	2.108.126	0,45
68.145	Payoneer Global Inc	706.664	0,15
71.800	Payoneer Inc	709.384	0,15
17.680	Procter & Gamble Co	2.385.562	0,50
15.700	Raytheon Technologies Corp	1.339.367	0,28
91.024	Repay Holdings Corp Class A	2.188.217	0,46
44.303	Salesforce.com Inc	10.821.894	2,29
7.900	Sempra Energy	780.283	0,16
13.746	ServiceNow Inc	7.554.114	1,60
5.200	Shake Shack Inc Class A	556.504	0,12
38.556	Splunk Inc	5.574.426	1,18

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (cont.)

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 89,20% (31 de diciembre de 2020: 83,76%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
12.100	Spotify Technology SA		3.334.639	0,70	
26.700	Tapestry Inc		1.160.916	0,24	
38.514	TE Connectivity Ltd		5.207.478	1,10	
7.200	Thermo Fisher Scientific Inc		3.632.184	0,77	
74.895	TJX Cos Inc		5.049.421	1,07	
34.164	Tradeweb Markets Inc Class A		2.888.908	0,61	
39.050	Uber Technologies Inc		1.957.186	0,41	
30.220	Union Pacific Corp		6.646.285	1,40	
18.050	UnitedHealth Group Inc		7.227.942	1,53	
74.000	Utz Brands Inc		1.612.460	0,34	
23.390	Visa Inc Class A		5.469.050	1,16	
26.353	Walmart Inc		3.716.300	0,78	
7.837	Walt Disney Co		1.377.509	0,29	
51.490	Waste Management Inc		7.214.264	1,52	
40.231	WEC Energy Group Inc		3.578.547	0,76	
37.155	WEX Inc		7.204.355	1,52	
100.450	Whole Earth Brands Inc		1.456.525	0,31	
18.000	Workday Inc Class A		4.297.320	0,91	
	Total valores de renta variable *		422.166.914	89,20	
Fondos de inversión inmobiliaria 0,66% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)					
Dólar estadounidense					
9.729	SBA Communications Corp Class A		3.100.632	0,66	
	Total fondos de inversión inmobiliaria *		3.100.632	0,66	
Número de acciones	Descripción de los valores	Fecha de vencimiento	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto	
Participatory Notes 0,00% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)					
Dólar estadounidense					
3.000	OneSpaWorld Holdings Ltd	19/03/2024	9.300	0,00	
	Total participatory notes **		9.300	0,00	
Importe principal	Descripción de los valores	Cupón	Fecha de vencimiento	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Bonos de empresa 1,63% (31 de diciembre de 2020: 2,84%)					
Dólar estadounidense					
874.612	Anagram International Inc/Anagram Holdings LLC [†]	10,00%	15/08/2026	878.985	0,19
362.928	Anagram International Inc/Anagram Holdings LLC [†]	15,00%	15/08/2025	419.182	0,09
795.989	Anagram International Inc/Anagram Holdings LLC ^{**}	15,00%	15/08/2025	919.367	0,19

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (cont.)

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 1,63% (31 de diciembre de 2020: 2,84%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
1.160.000	APX Group Inc**	7,63%	01/09/2023	1.193.350	0,25
90.000	Cinemark USA Inc**	5,88%	15/03/2026	94.466	0,02
95.000	Enterprise Products Operating LLC**	2,91%	01/06/2067	86.616	0,02
585.000	Oak Street Health Inc**	0,00%	15/03/2026	600.671	0,13
189.000	Party City Holdings Inc**	5,75%	15/07/2025	179.786	0,04
1.575.350	Party City Holdings Inc†	5,75%	15/07/2025	1.498.552	0,32
820.000	Rockpoint Gas Storage Canada Ltd**	7,00%	31/03/2023	839.988	0,18
165.000	Uber Technologies Inc**	0,00%	15/12/2025	168.135	0,03
445.000	Uber Technologies Inc**	6,25%	15/01/2028	479.803	0,10
150.000	Uber Technologies Inc**	7,50%	15/09/2027	165.046	0,03
200.000	WEC Energy Group Inc**	2,27%	15/05/2067	184.716	0,04
Total bonos de empresa				7.708.663	1,63
Total inversiones				432.985.509	91,49

Contratos de divisas a plazo 0,16% (31 de diciembre de 2020: 1,64%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases EUR con cobertura						
207.897 €	246.622 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	12	0,00
7.314.578 USD	6.034.853 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	5	155.269	0,03
4.275.811 USD	3.563.257 €	19/07/2021	UBS AG	2	48.623	0,01
25.610.862 USD	21.130.554 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	49	543.117	0,12
Clases GBP con cobertura						
518.204 £	713.273 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	2.635	0,00
506.872 £	697.765 USD	19/07/2021	UBS AG	2	2.488	0,00
490.242 £	674.592 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	2.686	0,00
15.503 USD	10.934 £	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	398	0,00
12.654 USD	8.926 £	19/07/2021	UBS AG	1	322	0,00
779.825 USD	552.731 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	5	16.217	0,00
Clases SGD con cobertura						
14.728 SGD	10.948 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	8	0,00
42.055 USD	56.180 SGD	19/07/2021	Goldman Sachs International	5	263	0,00
31.243 USD	41.776 SGD	19/07/2021	UBS AG	1	166	0,00
48.023 USD	64.232 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	7	238	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					772.442	0,16

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de futuros 0,01% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(49)	E-mini Russell 2000 Index Future September 2021	36.477	0,01
Plusvalía latente total sobre contratos de futuros ±		36.477	0,01

Contratos de opciones sobre renta variable adquiridos 0,04% (31 de diciembre de 2020: 0,24%)

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de compra					
205	21/01/2022	Apollo Global Management LLC, Strike Price \$65	(46.227)	74.825	0,01
170	20/08/2021	Dollar Tree Inc, Strike Price \$115	(129.502)	4.335	0,00
120	16/07/2021	Floor & Decor Holdings Inc, Strike Price \$120	(83.762)	1.800	0,00
430	20/08/2021	Sumo Logic Inc, Strike Price \$25	(168.420)	30.100	0,01
151	16/07/2021	Chewy Inc, Strike Price \$80	(80.226)	43.412	0,01
390	20/08/2021	Tapestry Inc, Strike Price \$53	(125.399)	13.650	0,00
50	19/11/2021	WEX Inc, Strike Price \$220	(58.577)	32.750	0,01
Total valor razonable en contratos de opciones sobre renta variable adquiridos ±				200.872	0,04

Contratos por diferencias 0,18% (31 de diciembre de 2020: 0,19%)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
1.387.898	Campbell Soup Co	JPMorgan Chase Bank	95.367	0,02
1.019.119	Church & Dwight Co Inc	JPMorgan Chase Bank	8.479	0,00
2.285.700	Consolidated Edison Inc	JPMorgan Chase Bank	164.100	0,04
186.978	Consolidated Edison Inc	Goldman Sachs International	1.904	0,00
459.780	Oracle Corp	Goldman Sachs International	21.792	0,01
714.924	Paycom Software Inc	JPMorgan Chase Bank	62.478	0,01
20.464	Sally Beauty Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	2.702	0,00
1.180.000	Shake Shack Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	119.800	0,03
914.256	Southern Co	JPMorgan Chase Bank	57.312	0,01
661.654	Sprouts Farmers Market Inc	JPMorgan Chase Bank	17.704	0,00
642.824	Sprouts Farmers Market Inc	Goldman Sachs International	42.877	0,01
839.673	Tesla Inc	JPMorgan Chase Bank	67.313	0,01
1.708.440	Western Union Co	JPMorgan Chase Bank	192.510	0,04
Plusvalía latente total sobre contratos por diferencias ∞			854.338	0,18

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Inversión privada en renta variable pública – (PIPE) 0,57% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)

Contraparte	Obligación referenciada	Importe nominal	Fecha de cierre	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Churchill Capital Corp IV Clase A	Churchill Capital Corp IV Class A	5.500.005 USD	23/07/2021	2.713.336	0,57
Spartan Acquisition Corp II	Spartan Acquisition Corp II	1.700.000 USD	09/07/2021	-	0,00
Plusvalía latente total sobre inversión privada en renta variable pública – (PIPE) [∞]				2.713.336	0,57
				Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados				437.562.974	92,45

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,60%) (31 de diciembre de 2020: (0,13%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases EUR con cobertura (cont.)						
1.328.010 €	1.611.059 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(35.605)	(0,01)
69.208.148 €	83.012.586 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	6	(909.100)	(0,19)
65.222.566 €	78.181.156 USD	19/07/2021	UBS AG	3	(805.873)	(0,17)
78.984.795 €	94.780.958 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	70	(1.079.173)	(0,23)
1.210 USD	1.020 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(0)	(0,00)
Clases GBP con cobertura						
13.723 £	18.970 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(12)	(0,00)
34.870 £	48.899 USD	19/07/2021	UBS AG	3	(726)	(0,00)
384.350 £	534.491 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	16	(3.504)	(0,00)
Clases SGD con cobertura						
218.773 SGD	163.619 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	4	(873)	(0,00)
207.623 SGD	155.268 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(817)	(0,00)
292.118 SGD	218.819 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	34	(1.508)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(2.837.191)	(0,60)

Contratos de futuros (0,41%) (31 de diciembre de 2020: (0,21%))

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(55)	Nasdaq 100 E-mini Future September 2021	(818.264)	(0,17)
(279)	S&P 500 E-mini Future September 2021	(1.106.235)	(0,23)
(15)	US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2021	(56.368)	(0,01)
Minusvalía latente total sobre contratos de futuros ±		(1.980.867)	(0,41)

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de opciones sobre renta variable suscritos (0,09%) (31 de diciembre de 2020: (0,09%))

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de compra					
(855)	20/08/2021	Paya Holdings Inc, Strike Price \$15	82.132	(5.985)	(0,00)
(151)	16/07/2021	Chewy Inc, Strike Price \$100	14.413	(1.888)	(0,00)
Opciones de venta					
(205)	21/01/2022	Apollo Global Management LLC, Strike Price \$50	52.377	(29.213)	(0,01)
(151)	15/10/2021	Chewy Inc, Strike Price \$65	59.320	(36.617)	(0,01)
(170)	20/08/2021	Chewy Inc, Strike Price \$75	48.033	(54.060)	(0,01)
(24)	20/08/2021	O'Reilly Automotive Inc, Strike Price \$420	67.584	(4.800)	(0,00)
(170)	20/08/2021	Dollar Tree Inc, Strike Price \$100	127.642	(59.925)	(0,01)
(120)	15/10/2021	Floor & Decor Holdings Inc, Strike Price \$100	87.692	(76.800)	(0,02)
(855)	20/08/2021	Paya Holdings Inc, Strike Price \$10	79.959	(23.512)	(0,00)
(430)	20/08/2021	Sumo Logic Inc, Strike Price \$18	124.887	(29.025)	(0,01)
(390)	20/08/2021	Tapestry Inc, Strike Price \$40	63.751	(51.675)	(0,01)
(1.600)	16/07/2021	Under Armour Inc, Strike Price \$13	115.214	(3.200)	(0,00)
(50)	19/11/2021	WEX Inc, Strike Price \$180	52.923	(46.000)	(0,01)
Total valor razonable en contratos de opciones sobre renta variable suscritos ±				(422.700)	(0,09)

Contratos por diferencias (0,56%) (31 de diciembre de 2020: (1,04%))

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
2.511.340	3M Co	Goldman Sachs International	(55.676)	(0,01)
1.851.633	Automatic Data Processing	JPMorgan Chase Bank	(65.281)	(0,01)
1.144.092	Carvana Co	JPMorgan Chase Bank	(82.050)	(0,02)
1.632.246	Domino's Pizza Inc	JPMorgan Chase Bank	(306.054)	(0,06)
497.028	Doordash Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(90.112)	(0,02)
672.956	Five9 Inc	Goldman Sachs International	(90.346)	(0,02)
1.603.042	Franklin Resources Inc	JPMorgan Chase Bank	(93.041)	(0,02)
164.610	Fubotv Inc	JPMorgan Chase Bank	(115.380)	(0,02)
322.824	Fubotv Inc	Goldman Sachs International	(221.943)	(0,05)
199.430	Gamestop Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	(74.029)	(0,02)
137.028	Gamestop Corp Class A	Goldman Sachs International	(70.783)	(0,02)
1.302.000	Guidewire Software Inc	JPMorgan Chase Bank	(83.328)	(0,02)
705.850	Iron Mountain Inc	JPMorgan Chase Bank	(79.230)	(0,02)
2.388.540	Kroger Co	JPMorgan Chase Bank	(73.920)	(0,02)
711.386	Lemonade Inc	Goldman Sachs International	(362.306)	(0,08)
434.215	Mudrick Capital Acquisition Corp Class A	Goldman Sachs International	(22.076)	(0,00)
298.076	Nio Inc	JPMorgan Chase Bank	(150.844)	(0,03)

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (0,56%) (31 de diciembre de 2020: (1,04%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
790.257	Northrop Grumman Corp	JPMorgan Chase Bank	(43.332)	(0,01)
222.287	Polaris Inc	Goldman Sachs International	(15.643)	(0,00)
694.284	SailPoint Technologies Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	(11.703)	(0,00)
2.459.960	Sap SE	JPMorgan Chase Bank	(22.428)	(0,01)
355.680	Xpeng Inc	JPMorgan Chase Bank	(152.334)	(0,03)
1.500.603	Zoom Video Communications Class A	JPMorgan Chase Bank	(352.341)	(0,07)
434.032	Zoom Video Communications Class A	Goldman Sachs International	(7.587)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos por diferencias ∞			(2.641.767)	(0,56)

Contratos de swap de rentabilidad total (3,90%) (31 de diciembre de 2020: (2,13%))

Importe nominal	Fecha de extinción	Tipo variable	Entidad de referencia	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
USD (2.265.265)	20/09/2021	0,14 ¹	iBoxx USD Liquid Investment Grade Index ²	(75.426)	(0,02)
USD (1.034.958)	15/05/2022	0,18 ¹	MSCI World Gross Total Return Index ³	(192.137)	(0,04)
USD (2.165.050)	01/08/2022	(0,93) ⁴	S&P Retail Select Industry Index ²	(365.125)	(0,08)
USD (4.462.547)	29/10/2021	(0,43) ⁴	JPMorgan Basket JPNBGCND ³	(1.924.564)	(0,41)
USD (6.116.843)	12/08/2022	0,13 ¹	Goldman Sachs Basket GSCBNBVL ²	(981.405)	(0,21)
USD (9.343.557)	06/05/2022	0,06 ⁴	JPMorgan Basket JPNBRMV3 ³	(3.373.000)	(0,71)
USD (14.466.981)	19/07/2021	0,19 ⁴	JPMorgan Basket JPNBLQGS ³	(5.848.671)	(1,23)
USD (16.693.524)	04/05/2022	0,22 ⁴	S&P 500 Equal Weight Total Return Index ³	(5.679.351)	(1,20)
Minusvalía latente total sobre contratos de swap de rentabilidad total ∞				(18.439.679)	(3,90)

¹ El LIBOR a 3 meses es la referencia para este contrato de swap de rentabilidad total.

² La contraparte en este contrato de swap de rentabilidad total es Goldman Sachs International.

³ La contraparte en este contrato de swap de rentabilidad total es JPMorgan Chase Bank.

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

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(26.322.204)	(5,56)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	411.240.770	86,89
Otro activo neto	62.006.944	13,11
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	473.247.714	100,00

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Análisis de la cartera	USD	% de los Activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	425.267.546	83,02
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	4.921.244	0,96
† Otros valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario	2.796.719	0,55
± Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	(2.166.218)	(0,42)
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(19.578.521)	(3,82)
Total inversiones	411.240.770	80,29

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
1.000.000	LegalZoom.com Inc	28.000.000
127.212	Salesforce.com Inc	27.477.638
401.964	Apollo Global Management Inc Class A	22.912.310
156.456	TE Connectivity Ltd	20.264.493
188.772	Lamb Weston Holdings Inc	14.893.156
186.176	Chewy Inc Class A	14.321.909
95.424	Splunk Inc	13.856.498
400.496	Keurig Dr Pepper Inc	13.180.470
23.944	ServiceNow Inc	12.689.163
113.180	Dollar Tree Inc	11.688.745
108.388	Chevron Corp	11.554.327
152.144	NextEra Energy Inc	11.363.906
191.756	Anaplan Inc	11.299.557
42.000	SBA Communications Corp Class A	11.087.461
160.180	TJX Cos Inc	10.649.396
441.768	nVent Electric Plc	10.503.058
10.200.000	Party City Holdings Inc, 8.75%, 15/02/2026	10.200.000
73.720	Expedia Group Inc	9.727.029
82.200	Waste Management Inc	9.408.863
287.232	Equitable Holdings Inc	9.369.251
9.340.000	T-Mobile US Inc, 2.63%, 15/04/2026	9.340.000
2.876	Amazon.com Inc	9.337.644
83.892	Floor & Decor Holdings Inc Class A	8.746.300
29.600	Parker-Hannifin Corp	8.499.077
18.000	O'Reilly Automotive Inc	8.156.880
28.000	FedEx Corp	7.776.737
65.008	Medtronic Plc	7.675.987
29.200	Air Products & Chemicals Inc	7.507.658
35.600	Union Pacific Corp	7.208.539
55.600	Fidelity National Information Services Inc	7.193.120
31.200	Microsoft Corp	7.188.913
100.400	LiveRamp Holdings Inc	7.032.354
15.160	Adobe Inc	6.981.434
24.884	Home Depot Inc	6.686.187

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (cont.)

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
33.396	WEX Inc	6.525.720
179.480	DoubleVerify Holdings Inc	6.094.952
133.000	Uber Technologies Inc	6.060.038

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (cont.)

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
856.000	Univar Solutions USA Inc	18.226.791
196.800	Baxter International Inc	16.414.940
237.920	Gilead Sciences Inc	15.169.549
154.944	Blackstone Group Inc	14.399.699
23.804	O'Reilly Automotive Inc	12.635.817
132.276	WEC Energy Group Inc	12.556.922
54.400	L3Harris Technologies Inc	10.816.851
260.076	Duck Creek Technologies Inc	10.422.116
10.200.000	Party City Holdings Inc, 8.75%, 15/02/2026	10.415.029
127.864	Citigroup Inc	9.487.383
273.396	Keurig Dr Pepper Inc	9.476.105
9.340.000	T-Mobile US Inc, 2.63%, 15/04/2026	9.349.302
524.876	Gates Industrial Corp PLC	9.217.627
35.600	Becton Dickinson & Co	8.953.056
12.000	BlackRock Inc Class A	8.894.195
107.800	Pinterest Inc Class A	7.878.351
27.640	PayPal Holdings Inc	7.865.700
223.720	Conagra Brands Inc	7.668.823
29.120	Workday Inc Class A	7.286.446
326.200	Under Armour Inc Class A	7.257.073
32.400	Equifax Inc	7.135.854
24.000	Anthem Inc	7.084.129
122.800	Uber Technologies Inc	6.756.782
131.200	LivRamp Holdings Inc	6.753.906
19.672	Home Depot Inc	6.450.653
17.600	DexCom Inc	6.305.369
70.680	Novartis AG ADR	6.063.036
28.800	Asbury Automotive Group Inc	5.568.932
226.656	CenterPoint Energy Inc	5.295.852
31.000	American Water Works Co Inc	4.962.913
8.592	Adobe Inc	4.672.193
183.800	Repay Holdings Corp Class A	4.492.480
44.400	Activision Blizzard Inc	4.273.404
12.600	Lululemon Athletica Inc	4.020.573
18.000	Caterpillar Inc	3.925.754
6.020	ASML Holding NV	3.909.367
13.200	Air Products & Chemicals Inc	3.860.863

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund

Informe del Gestor de inversiones

Durante el periodo de seis meses finalizado el 30 de junio de 2021 (el "periodo analizado") la rentabilidad total de la Clase de Acumulación USD I se situó en el -1,56%. Durante el mismo periodo, el índice de referencia combinado, que se compone en un 50% del JP Morgan GBI Emerging Markets Global Diversified (Total Return, Unhedged, USD), en un 25% del JP Morgan EMBI Global Diversified (Total Return, USD) y en un 25% del JP Morgan CEMBI Diversified (Total Return, USD) (el "Índice"), rindió un -1,57%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

La deuda de mercados emergentes ("ME") se enfrentó a un contexto volátil en la primera mitad del año al verse favorecidos los activos de riesgo por la sólida recuperación económica y las continuas campañas de vacunación mundial, a pesar de la presión que ejerció el "reflation trade" en los mercados de renta fija. Los valores del Tesoro fueron objeto de bruscas ventas masivas que llevaron las rentabilidades a 10 años a un máximo del 1,74% al final de marzo; esto quedó parcialmente contrarrestado a finales del segundo trimestre, a pesar del giro "hawkish" que adoptó la Reserva Federal estadounidense (la "Fed") a mediados de junio. Los precios del petróleo tuvieron un buen comportamiento durante todo el periodo, mientras que los metales preciosos atravesaron dificultades, en ambos casos como consecuencia del sentimiento económico positivo. El dólar estadounidense avanzó en gran medida en consonancia con las rentabilidades de los bonos del Tesoro, aunque experimentó un gran salto tras la reunión de la Fed del mes de junio.

El índice JP Morgan EMBI Global Diversified (EMBI GD) rindió un -0,66% en el periodo. Los diferenciales del índice experimentaron una contracción de 352 pb a 340 pb, alcanzando un máximo de 372 pb a comienzos de marzo. Por países, Ecuador fue el que mejor se comportó con diferencia, debido a que el candidato Lasso, favorable al mercado, ganó las elecciones presidenciales. Zambia le siguió de cerca, con una rentabilidad de dos dígitos de sus bonos en impago, favorecido por las expectativas de que el país llegue a un acuerdo con el FMI tras las elecciones de agosto. El principal rezagado fue Argentina, puesto que el país todavía tiene que demostrar una combinación de políticas económicas que sea suficiente para estabilizar la dinámica de la deuda, seguido de Bielorrusia, que afrontó sanciones de EE. UU. y de la UE por su mano dura con la oposición política tras las polémicas elecciones del pasado año.

La deuda corporativa se anotó una rentabilidad positiva del 1,11%, medida por el índice JP Morgan CEMBI Diversified, dado que esta clase de activos se benefició de su duración relativamente menor en tipos de interés y de un sólido entorno para los fundamentales de las empresas. Por regiones, Asia y CEEMEA se anotaron rentabilidades positivas, mientras que América Latina perjudicó a los resultados. Por lo que respecta a la asignación sectorial, el sector de los metales y la minería fue el que mejor se comportó, mientras que el sector de suministros públicos y el inmobiliario se situaron a la zaga en el primer semestre de 2021.

El índice JP Morgan GBI-EM Global Diversified rindió un -3,38%. La rentabilidad negativa durante el periodo se debió tanto a la depreciación de las monedas de mercados emergentes frente al dólar estadounidense como al avance de las rentabilidades de los bonos locales, dado que la rentabilidad media del índice de referencia pasó del 4,22% al 4,98% durante el periodo analizado. Sudáfrica y República Dominicana fueron los mercados locales del índice de referencia que mejor se comportaron durante el primer semestre del año. Por otra parte, Turquía se anotó los peores resultados, seguida de Perú, Colombia y Chile.

La cartera batió al índice de referencia durante el período, gracias al posicionamiento ascendente en bonos denominados en monedas fuertes y locales, aunque el posicionamiento ascendente en deuda corporativa perjudicó a los resultados. La asignación táctica de activos (TAA) perjudicó ligeramente a la rentabilidad debido también a una infraponderación de la deuda corporativa frente a las monedas fuertes y las monedas locales, aunque una infraponderación de la duración y la protección frente al CDX en el primer trimestre resultaron favorables para la TAA. Por lo que respecta a la deuda soberana en monedas fuertes, la asignación por países fue lo que más contribuyó a la rentabilidad, gracias sobre todo a las sobreponderaciones de Angola, Costa Rica, Sri Lanka y Ecuador, así como a la selección de instrumentos en Ucrania. Por otra parte, la selección de valores en Rumanía fue lo que más perjudicó. Por lo que respecta a las divisas locales, las principales contribuciones a la rentabilidad superior procedieron de sobreponderaciones del rublo ruso, la corona checa, la grivna ucraniana y la libra egipcia, así como de la infraponderación del baht tailandés. Las infraponderaciones de duración en diferentes mercados locales de baja rentabilidad y en Turquía, así como una sobreponderación de tipos en Sudáfrica también favorecieron a los resultados. El posicionamiento en tipos en América Latina perjudicó, así como una infraponderación del rand sudafricano. Por último, el posicionamiento en deuda corporativa lastró la rentabilidad debido sobre todo a la exposición a Huarong, que experimentó una presión de precios a consecuencia de la preocupación por el retraso en la publicación del informe anual y por el nivel de ayudas públicas que percibe la empresa. El posicionamiento en los EAU y la infraponderación de Filipinas también perjudicaron, mientras que, por lo que respecta a la asignación a deuda corporativa, la selección de bonos en Brasil fue lo que más contribuyó a la rentabilidad.

Las expectativas de crecimiento mundial para el resto de 2021 siguen siendo alentadoras, siendo probable que los mercados emergentes ("ME") se beneficien de la incesante recuperación cíclica, tal como reflejan tanto los datos de manufacturas como los precios de las materias primas. La aceleración de la vacunación prevista para el segundo semestre del año en los mercados emergentes probablemente también favorecerá a la dinámica del crecimiento doméstico. Ante esta coyuntura, seguimos siendo optimistas sobre las perspectivas a medio plazo de las monedas de ME, ya que deberían salir bien paradas en nuestro escenario base de recuperación del crecimiento de los ME, y la mejora de los términos de intercambio favorecen especialmente a las monedas de países exportadores de materias primas.

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

Informe del Gestor de inversiones (cont.)

Por lo que respecta a los tipos locales, nuestras perspectivas son positivas para los países en los que ya se han descontado unas subidas de tipos significativas o para aquellos que están experimentando una recuperación menos profunda, mientras que mantenemos posiciones infraponderadas en varios países con bajos niveles de rentabilidad.

Un aumento de los tipos de interés estadounidenses mayor del esperado podría suponer un riesgo de cola para esta clase de activos, aunque nuestra hipótesis central es que los tipos subirán gradualmente en los próximos trimestres, lo cual no creemos que trastoque excesivamente las condiciones de financiación o los sectores de diferenciales en ME. En el ámbito corporativo, prevemos una reanimación del EBITDA de las grandes empresas de la región y una mejora de las métricas de apalancamiento de las mismas. También creemos que las valoraciones de los bonos soberanos y corporativos en divisas fuertes de mercados emergentes se encuentran dentro del rango de valor razonable y resultan atractivas en relación con los mercados desarrollados.

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		1.161.442.674	1.446.897.015
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	26.219.925	47.914.399
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		33.461.204	–
Cuentas a percibir por acciones emitidas		3.329.083	1.519.620
Cuentas por cobrar de intermediarios		9.766.856	5.722.972
Ingresos a percibir y otros activos		23.218.037	24.059.466
Activos totales		1.257.437.779	1.526.113.472
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		31.032.028	15.291.276
Descubierto bancario	3	106.321	3.290
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		50.092.362	846.950
Adeudado a los intermediarios		9.320.000	13.702.000
Gastos devengados		1.144.507	1.085.123
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		31.971.812	2.774.622
Otras cuentas por pagar		2.425.742	2.734.497
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		126.092.772	36.437.758
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		1.131.345.007	1.489.675.714

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		36.900.277	43.874.577
Ingresos por préstamo de valores	15	4.724	700
Ingresos varios		30.528	–
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(68.503.990)	(157.651.313)
		(31.568.461)	(113.776.036)
Gastos			
Comisión de gestión	5	4.944.674	5.222.258
Comisión de distribución	5	43.039	59.200
Comisión de administración	5	613.773	820.927
Comisión de compromiso	16	114.557	85.980
Comisión de depósito	5	302.046	376.702
Comisión del Depositario	5	37.766	77.635
Honorarios profesionales	7	105.983	67.993
Honorarios de los Consejeros	6	2.413	2.375
Costes de transacciones	7	473.201	354.243
Honorarios de auditoría	7	14.153	13.563
Reembolso de IVA		(7.041)	(5.402)
Otros gastos	7	16.536	69.141
Gastos no asumidos	5	–	(1.149)
Gastos totales		6.661.100	7.143.466
Costes financieros			
Gastos por intereses		6.031	5.295
Repartos de dividendos abonados	1	5.030.515	6.933.747
		5.036.546	6.939.042
Impuestos retenidos en origen		1.152.237	1.011.566
Impuesto sobre las plusvalías		(718.149)	(173.775)
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		(43.700.195)	(128.696.335)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	1.489.675.714	1.709.204.969
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	(43.700.195)	(128.696.335)
Suscripciones	392.788.085	405.264.561
Reembolsos	(707.418.597)	(482.521.773)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	1.131.345.007	1.503.251.422

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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 Tesoro 1,63% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)					
Shekel israelí					
54.469.193	Bank of Israel Bill - Makam	0,00%	02/09/2021	16.724.391	1,48
5.561.865	Israel Treasury Bill MOF	0,00%	31/08/2021	1.706.794	0,15
Total bonos del Tesoro **				18.431.185	1,63
Bonos de empresa 32,59% (31 de diciembre de 2020: 28,55%)					
Peso colombiano					
4.060.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP*	7,63%	10/09/2024	1.098.787	0,10
17.077.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP*	8,38%	08/11/2027	4.362.869	0,38
Total peso colombiano				5.461.656	0,48
Euro					
342.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	2,75%	22/01/2033	424.283	0,03
2.082.000	NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance Plc*	7,13%	19/07/2024	2.574.176	0,23
971.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	1,88%	05/11/2031	1.126.898	0,10
Total euro				4.125.357	0,36
Rupia indonesia					
94.200.000.000	JPMorgan Chase Bank NA†	7,00%	18/09/2030	6.860.593	0,61
Total rupia indonesia				6.860.593	0,61
Peso mexicano					
46.510.400	Comision Federal de Electricidad*	7,35%	25/11/2025	2.256.827	0,20
43.963.800	Comision Federal de Electricidad*	8,18%	23/12/2027	2.123.976	0,19
Total peso mexicano				4.380.803	0,39
Dólar estadounidense					
2.000.000	1MDB Global Investments Ltd**	4,40%	09/03/2023	2.016.963	0,18
1.025.000	ABJA Investment Co Pte Ltd*	5,45%	24/01/2028	1.098.789	0,10
600.000	ABJA Investment Co Pte Ltd*	5,95%	31/07/2024	649.710	0,06
1.317.000	ABQ Finance Ltd*	3,13%	24/09/2024	1.379.261	0,12
2.709.000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*	4,60%	02/11/2047	3.202.065	0,28
632.000	Abu Dhabi National Energy Co PJSC*	2,00%	29/04/2028	636.930	0,06
1.801.000	Adani Electricity Mumbai Ltd*	3,95%	12/02/2030	1.802.424	0,16
1.102.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd*	4,20%	04/08/2027	1.150.897	0,10
250.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd**	4,38%	03/07/2029	262.258	0,02
400.000	ADCB Finance Cayman Ltd*	4,00%	29/03/2023	422.024	0,04
813.651	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA*	6,00%	18/11/2048	887.599	0,08
650.000	AES Gener SA*	7,13%	26/03/2079	696.738	0,06

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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 32,59% (31 de diciembre de 2020: 28,55%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
538.000	Africa Finance Corp*	2,88%	28/04/2028	541.126	0,05
497.000	African Export-Import Bank*	3,99%	21/09/2029	522.569	0,05
567.000	AIA Group Ltd [†]	2,70%	29/12/2049	574.371	0,05
200.000	AIA Group Ltd [†]	3,20%	16/09/2040	207.299	0,02
250.000	AIA Group Ltd ^{**}	3,38%	07/04/2030	276.436	0,02
597.000	Akbank TAS [*]	5,00%	24/10/2022	611.585	0,05
600.000	Akbank TAS [*]	5,13%	31/03/2025	601.984	0,05
400.000	Akbank TAS ^{**}	6,80%	06/02/2026	421.688	0,04
206.000	Alibaba Group Holding Ltd [†]	3,25%	09/02/2061	200.071	0,02
1.265.000	Alibaba Group Holding Ltd [†]	4,00%	06/12/2037	1.423.366	0,13
1.000.000	Altice Financing SA [*]	7,50%	15/05/2026	1.042.550	0,09
1.700.000	America Movil SAB de CV [*]	3,63%	22/04/2029	1.879.083	0,17
300.000	Antofagasta Plc ^{**}	2,38%	14/10/2030	289.425	0,03
1.050.000	Arabian Centres Sukuk II Ltd [†]	5,63%	07/10/2026	1.117.756	0,10
523.000	Axiata SPV2 Bhd [†]	2,16%	19/08/2030	514.557	0,05
781.000	Azul Investments LLP ^{**}	7,25%	15/06/2026	767.270	0,07
963.000	B2W Digital Lux Sarl ^{**}	4,38%	20/12/2030	966.260	0,09
435.000	Banco Davivienda SA ^{**}	6,65%	29/12/2049	457.483	0,04
1.025.000	Banco de Bogota SA [†]	4,38%	03/08/2027	1.083.902	0,10
1.550.000	Banco de Bogota SA [†]	6,25%	12/05/2026	1.699.242	0,15
1.382.000	Banco de Credito del Peru ^{**}	3,13%	01/07/2030	1.376.334	0,12
843.000	Banco do Brasil SA ^{**}	9,00%	29/12/2049	940.451	0,08
599.000	Banco Mercantil del Norte SA [†]	7,50%	29/12/2049	677.619	0,06
1.459.000	Banco Mercantil del Norte SA [†]	7,63%	29/12/2049	1.658.518	0,15
450.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand ^{**}	5,38%	17/04/2025	511.151	0,05
1.363.000	Bancolumbia SA [†]	4,63%	18/12/2029	1.386.866	0,12
2.050.000	Bangkok Bank PCL ^{**}	3,73%	25/09/2034	2.130.914	0,19
1.363.000	Bank Leumi Le-Israel BM [†]	3,28%	29/01/2031	1.397.075	0,12
616.000	Bank Muscat SAOG [*]	4,75%	17/03/2026	640.640	0,06
418.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT [*]	3,75%	30/03/2026	426.474	0,04
1.218.000	Banque Ouest Africaine de Developpement [*]	4,70%	22/10/2031	1.314.320	0,12
289.000	Banque Ouest Africaine de Developpement [*]	5,00%	27/07/2027	321.250	0,03
576.000	BBK BSC [†]	5,50%	09/07/2024	611.048	0,05
582.000	Bharti Airtel Ltd ^{**}	3,25%	03/06/2031	579.793	0,05
2.050.000	BOC Aviation Ltd [†]	3,00%	11/09/2029	2.107.484	0,19
274.000	BOC Aviation Ltd ^{**}	3,50%	18/09/2027	292.335	0,03
400.000	Braskem Idesa SAPI [†]	7,45%	15/11/2029	425.328	0,04
1.265.000	Braskem Netherlands Finance BV ^{**}	8,50%	23/01/2081	1.475.433	0,13

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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 32,59% (31 de diciembre de 2020: 28,55%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
1.782.900	Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais [†]	5,33%	15/02/2028	1.935.784	0,17
593.000	BRF SA ^{**}	4,88%	24/01/2030	623.471	0,05
2.561.000	C&W Senior Financing DAC ^{**}	6,88%	15/09/2027	2.741.679	0,24
350.000	C&W Senior Financing DAC ^{**}	7,50%	15/10/2026	368.695	0,03
1.400.000	Cable Onda SA ^{**}	4,50%	30/01/2030	1.478.610	0,13
1.424.000	CAS Capital No 1 Ltd [†]	4,00%	29/12/2049	1.429.696	0,13
500.000	CBQ Finance Ltd [†]	2,00%	15/09/2025	502.918	0,04
639.000	CBQ Finance Ltd [†]	2,00%	12/05/2026	637.003	0,06
600.000	CBQ Finance Ltd [†]	5,00%	24/05/2023	646.536	0,06
796.000	CDBL Funding 2 [†]	2,00%	04/03/2026	794.852	0,07
1.643.000	Celestial Miles Ltd [†]	5,75%	29/12/2049	1.749.795	0,15
431.000	Cemex SAB de CV ^{**}	5,13%	29/12/2049	445.417	0,04
450.000	Cemex SAB de CV ^{**}	7,38%	05/06/2027	507.375	0,04
902.000	Cemig Geracao e Transmissao SA [†]	9,25%	05/12/2024	1.042.045	0,09
618.000	Central American Bottling Corp [†]	5,75%	31/01/2027	647.293	0,06
232.000	Champion Path Holdings Ltd [†]	4,50%	27/01/2026	240.725	0,02
622.000	Champion Path Holdings Ltd [†]	4,85%	27/01/2028	649.269	0,06
465.000	China Evergrande Group [†]	8,25%	23/03/2022	396.634	0,03
600.000	China Evergrande Group [†]	8,75%	28/06/2025	397.144	0,03
3.291.000	China Minmetals Corp [†]	3,75%	29/12/2049	3.361.816	0,30
826.000	China Overseas Finance Cayman VI Ltd [†]	5,95%	08/05/2024	927.704	0,08
454.000	China Resources Land Ltd [†]	4,13%	26/02/2029	495.662	0,04
239.000	Chinalco Capital Holdings Ltd [†]	4,00%	25/08/2021	239.587	0,02
402.000	Chinalco Capital Holdings Ltd [†]	4,10%	29/12/2049	418.633	0,04
541.000	Chinalco Capital Holdings Ltd [†]	4,25%	21/04/2022	549.754	0,05
696.000	CIFI Holdings Group Co Ltd [†]	5,95%	20/10/2025	734.180	0,06
802.000	CMB International Leasing Management Ltd [†]	1,88%	12/08/2025	795.166	0,07
491.000	CMB International Leasing Management Ltd [†]	2,75%	12/08/2030	483.952	0,04
669.000	Comision Federal de Electricidad [†]	3,35%	09/02/2031	665.525	0,06
546.000	Comision Federal de Electricidad [†]	4,75%	23/02/2027	611.416	0,05
1.425.000	Commercial Bank PSQC [†]	4,50%	29/12/2049	1.437.469	0,13
810.000	Corp Nacional del Cobre de Chile [†]	3,00%	30/09/2029	842.801	0,07
604.000	Corp Nacional del Cobre de Chile [†]	3,75%	15/01/2031	659.872	0,06
731.000	Corp Nacional del Cobre de Chile [†]	4,38%	05/02/2049	856.655	0,08
543.000	Cosan SA ^{**}	5,50%	20/09/2029	586.711	0,05
500.000	Country Garden Holdings Co Ltd [†]	4,80%	06/08/2030	520.402	0,05
200.000	Country Garden Holdings Co Ltd [†]	5,13%	14/01/2027	213.391	0,02
497.000	Country Garden Holdings Co Ltd [†]	6,15%	17/09/2025	544.956	0,05

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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 32,59% (31 de diciembre de 2020: 28,55%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
386.000	Credicorp Ltd**	2,75%	17/06/2025	392.726	0,03
2.385.000	CSN Inova Ventures**	6,75%	28/01/2028	2.640.791	0,24
1.500.000	CSN Resources SA**	4,63%	10/06/2031	1.534.290	0,14
1.687.000	CSN Resources SA**	7,63%	17/04/2026	1.821.437	0,16
1.500.000	DBS Group Holdings Ltd*	4,52%	11/12/2028	1.619.524	0,14
763.000	Development Bank of Kazakhstan JSC*	2,95%	06/05/2031	761.016	0,07
205.000	Dianjian Haiyu Ltd*	4,30%	29/12/2049	213.410	0,02
895.000	DIB Sukuk Ltd*	2,95%	16/01/2026	933.845	0,08
497.000	DIB Tier 1 Sukuk 3 Ltd*	6,25%	29/12/2049	539.245	0,05
430.000	DP World Crescent Ltd*	3,88%	18/07/2029	466.015	0,04
990.000	DP World Plc*	6,85%	02/07/2037	1.345.543	0,12
1.744.000	Ecopetrol SA*	5,88%	28/05/2045	1.870.908	0,16
1.739.000	Ecopetrol SA*	6,88%	29/04/2030	2.101.164	0,19
905.000	Ecopetrol SA*	7,38%	18/09/2043	1.117.861	0,10
596.000	El Sukuk Co Ltd*	1,83%	23/09/2025	599.102	0,05
550.000	Elect Global Investments Ltd*	4,10%	29/12/2049	560.802	0,05
615.000	Elect Global Investments Ltd*	4,85%	29/12/2049	643.507	0,06
550.000	Emaar Sukuk Ltd*	3,64%	15/09/2026	565.615	0,05
1.401.000	Embraer Netherlands Finance BV*	6,95%	17/01/2028	1.605.896	0,14
1.423.000	Emirates NBD Bank PJSC*	6,13%	29/12/2049	1.533.282	0,14
941.000	Empresa de Transmision Electrica SA*	5,13%	02/05/2049	1.048.194	0,09
216.000	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA*	3,65%	07/05/2030	233.251	0,02
240.000	Empresa Nacional del Petroleo**	3,75%	05/08/2026	251.551	0,02
406.000	Empresa Nacional del Petroleo**	4,50%	14/09/2047	401.825	0,04
499.621	Energiean Israel Finance Ltd*	4,88%	30/03/2026	511.439	0,05
634.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd*	3,38%	12/05/2026	647.028	0,06
516.000	Equate Petrochemical BV*	2,63%	28/04/2028	522.398	0,05
1.945.000	First Quantum Minerals Ltd**	6,88%	15/10/2027	2.121.898	0,19
700.000	First Quantum Minerals Ltd**	7,50%	01/04/2025	728.094	0,06
500.000	FirstRand Bank Ltd*	6,25%	23/04/2028	527.208	0,05
1.894.000	Frashion Brilliant Ltd*	4,25%	23/07/2029	1.886.769	0,17
430.000	Fresnillo Plc**	4,25%	02/10/2050	436.306	0,04
1.668.000	FS Luxembourg Sarl**	10,00%	15/12/2025	1.868.235	0,17
1.761.000	FWD Group Ltd*	5,75%	09/07/2024	1.810.350	0,16
902.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,63%	31/03/2036	883.372	0,08
1.286.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,94%	30/09/2040	1.274.154	0,11
1.025.000	Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA*	5,15%	11/02/2026	1.152.388	0,10
1.148.000	Gazprom PJSC via Gaz Finance Plc*	3,25%	25/02/2030	1.141.111	0,10

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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 32,59% (31 de diciembre de 2020: 28,55%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
433.000	GC Treasury Center Co Ltd*	2,98%	18/03/2031	443.238	0,04
400.000	Geopark Ltd**	5,50%	17/01/2027	404.504	0,04
1.025.000	GNL Quintero SA*	4,63%	31/07/2029	1.119.172	0,10
400.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd*	6,13%	15/05/2029	475.520	0,04
442.000	Greenko Dutch BV**	3,85%	29/03/2026	453.382	0,04
696.000	Greenland Global Investment Ltd*	6,75%	25/06/2022	644.121	0,06
1.098.000	Gtlk Europe Capital DAC*	4,65%	10/03/2027	1.146.697	0,10
346.000	Gtlk Europe Capital DAC*	4,95%	18/02/2026	368.293	0,03
585.445	Guara Norte Sarl**	5,20%	15/06/2034	611.087	0,05
500.000	Gulf International Bank BSC*	2,38%	23/09/2025	504.830	0,04
1.363.000	Haidilao International Holding Ltd*	2,15%	14/01/2026	1.347.877	0,12
1.624.000	Hanwha Life Insurance Co Ltd*	4,70%	29/12/2049	1.701.270	0,15
1.886.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd*	4,00%	29/12/2049	1.176.393	0,10
200.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd*	4,50%	29/12/2049	135.568	0,01
508.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	3,38%	24/02/2030	349.626	0,03
600.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	4,50%	29/05/2029	417.000	0,04
750.000	Huarong Finance II Co Ltd*	5,50%	16/01/2025	556.927	0,05
1.265.000	Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru**	6,38%	01/06/2028	1.336.156	0,12
757.000	Hyundai Capital America**	2,75%	27/09/2026	792.799	0,07
2.290.000	IHS Netherlands Holdco BV**	8,00%	18/09/2027	2.478.975	0,22
424.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT*	3,40%	09/06/2031	430.608	0,04
1.000.000	Industrias Penoles SAB de CV**	4,15%	12/09/2029	1.087.960	0,10
558.000	Industrias Penoles SAB de CV**	4,75%	06/08/2050	604.693	0,05
1.086.000	Inkia Energy Ltd*	5,88%	09/11/2027	1.130.939	0,10
575.000	Investment Energy Resources Ltd*	6,25%	26/04/2029	623.156	0,05
460.000	Israel Electric Corp Ltd*	4,25%	14/08/2028	514.439	0,05
1.100.000	JBS Finance Luxembourg Sarl**	3,63%	15/01/2032	1.100.759	0,10
1.265.000	JBS USA Food Co*	5,75%	15/01/2028	1.358.888	0,12
1.194.000	JMH Co Ltd*	2,50%	09/04/2031	1.209.359	0,11
620.000	JSW Hydro Energy Ltd*	4,13%	18/05/2031	629.883	0,06
1.305.000	JSW Steel Ltd*	5,95%	18/04/2024	1.394.197	0,12
882.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	9,38%	30/06/2024	831.110	0,07
700.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	10,50%	15/01/2025	657.522	0,06
200.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	10,88%	23/07/2023	199.724	0,02
800.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	11,25%	16/04/2025	755.769	0,07
350.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	11,70%	11/11/2025	330.476	0,03
1.550.000	Kallpa Generacion SA*	4,13%	16/08/2027	1.594.919	0,14
4.797.000	KazMunayGas National Co JSC*	5,75%	19/04/2047	6.005.029	0,53

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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 32,59% (31 de diciembre de 2020: 28,55%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
1.114.000	KazMunayGas National Co JSC [*]	6,38%	24/10/2048	1.477.582	0,13
1.265.000	Kenbourne Invest SA ^{**}	6,88%	26/11/2024	1.344.531	0,12
1.500.000	Klabin Austria GmbH ^{**}	3,20%	12/01/2031	1.476.330	0,13
215.000	Klabin Austria GmbH [*]	5,75%	03/04/2029	246.026	0,02
1.326.000	Kookmin Bank [*]	2,50%	04/11/2030	1.321.452	0,12
1.526.000	Kosmos Energy Ltd [*]	7,13%	04/04/2026	1.517.630	0,13
854.000	Krung Thai Bank PCL [*]	4,40%	29/12/2049	864.649	0,08
500.000	Kyobo Life Insurance Co Ltd [*]	3,95%	29/12/2049	510.562	0,05
791.000	Leader Goal International Ltd [*]	4,25%	29/12/2049	809.816	0,07
1.265.000	Lenovo Group Ltd ^{**}	5,88%	24/04/2025	1.429.084	0,13
1.179.168	Leviathan Bond Ltd [*]	6,50%	30/06/2027	1.308.112	0,12
700.000	Liquid Telecommunications Financing Plc [*]	8,50%	13/07/2022	705.129	0,06
1.708.000	Lukoil Securities BV [*]	3,88%	06/05/2030	1.807.764	0,16
966.000	Mashreqbank PSC [*]	4,25%	26/02/2024	1.034.771	0,09
1.194.000	Medco Bell Pte Ltd [*]	6,38%	30/01/2027	1.233.211	0,11
1.420.000	Medco Oak Tree Pte Ltd [*]	7,38%	14/05/2026	1.556.257	0,13
1.054.000	MEGlobal Canada ULC [*]	5,00%	18/05/2025	1.184.580	0,10
751.000	MEGlobal Canada ULC [*]	5,88%	18/05/2030	928.523	0,08
260.000	Meituan [*]	3,05%	28/10/2030	257.521	0,02
332.000	Melco Resorts Finance Ltd [*]	5,38%	04/12/2029	351.297	0,03
2.807.000	Melco Resorts Finance Ltd ^{**}	5,63%	17/07/2027	2.937.217	0,26
609.000	Melco Resorts Finance Ltd [*]	5,75%	21/07/2028	644.018	0,06
464.000	MercadoLibre Inc ^{**}	3,13%	14/01/2031	456.112	0,04
1.655.000	Metinvest BV [*]	8,50%	23/04/2026	1.889.782	0,17
1.185.000	Mexico City Airport Trust [*]	5,50%	31/07/2047	1.202.834	0,11
1.230.000	MHP SE [*]	7,75%	10/05/2024	1.338.925	0,12
585.000	Millicom International Cellular SA ^{**}	4,50%	27/04/2031	606.279	0,05
1.485.000	Millicom International Cellular SA [*]	5,13%	15/01/2028	1.549.211	0,14
420.300	Millicom International Cellular SA [*]	6,25%	25/03/2029	460.092	0,04
540.000	Millicom International Cellular SA [*]	6,63%	15/10/2026	572.916	0,05
2.002.000	Minera Mexico SA de CV ^{**}	4,50%	26/01/2050	2.246.605	0,19
575.000	Mizrahi Tefahot Bank Ltd [*]	3,08%	07/04/2031	580.750	0,05
550.000	MTR Corp Ltd [*]	1,63%	19/08/2030	532.043	0,05
1.628.495	MV24 Capital BV [*]	6,75%	01/06/2034	1.806.612	0,16
389.660	Nakilat Inc ^{**}	6,07%	31/12/2033	480.821	0,04
300.000	Nanyang Commercial Bank Ltd [*]	3,80%	20/11/2029	309.338	0,03
1.264.000	Natura Cosmeticos SA ^{**}	4,13%	03/05/2028	1.297.180	0,11
1.727.000	NBK Tier 1 Financing 2 Ltd [*]	4,50%	29/12/2049	1.802.501	0,16

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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
v					
Dólar estadounidense (cont.)					
2.050.000	Nexa Resources SA**	5,38%	04/05/2027	2.207.296	0,19
1.739.000	NWD MTN Ltd*	4,13%	18/07/2029	1.810.683	0,16
272.000	OCP SA*	3,75%	23/06/2031	275.332	0,02
200.000	OCP SA*	6,88%	25/04/2044	244.777	0,02
870.000	Oil & Gas Holding Co BSCC*	8,38%	07/11/2028	1.016.880	0,09
1.148.000	Oil India International Pte Ltd*	4,00%	21/04/2027	1.212.048	0,11
902.000	Oil India Ltd*	5,13%	04/02/2029	1.009.709	0,09
545.000	Ooredoo International Finance Ltd*	2,63%	08/04/2031	552.833	0,05
453.000	OQ SAOC*	5,13%	06/05/2028	456.480	0,04
465.000	Orbia Advance Corp SAB de CV**	2,88%	11/05/2031	468.506	0,04
1.265.000	Orbia Advance Corp SAB de CV**	6,75%	19/09/2042	1.666.062	0,15
538.000	Oryx Funding Ltd*	5,80%	03/02/2031	567.541	0,05
1.048.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd**	1,83%	10/09/2030	1.050.892	0,09
596.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd*	4,25%	19/06/2024	651.644	0,06
1.025.000	Oztel Holdings SPC Ltd*	6,63%	24/04/2028	1.135.048	0,10
604.000	Pampa Energia SA*	7,38%	21/07/2023	588.480	0,05
550.000	Parkway Pantai Ltd*	4,25%	29/12/2049	556.462	0,05
1.095.000	Periama Holdings LLC*	5,95%	19/04/2026	1.185.543	0,10
589.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	4,38%	05/02/2050	604.497	0,05
790.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	6,15%	21/05/2048	1.000.266	0,09
1.204.000	Petrobras Global Finance BV*	5,50%	10/06/2051	1.205.926	0,11
7.391.600	Petroleos de Venezuela SA*	5,38%	12/04/2027	332.622	0,03
1.580.000	Petroleos de Venezuela SA*	5,50%	12/04/2037	71.100	0,01
13.366.824	Petroleos de Venezuela SA*	6,00%	16/05/2024	601.507	0,05
12.004.188	Petroleos de Venezuela SA**	6,00%	15/11/2026	540.188	0,05
723.000	Petroleos del Peru SA*	4,75%	19/06/2032	760.054	0,07
1.870.000	Petroleos del Peru SA*	5,63%	19/06/2047	1.995.758	0,18
4.444.000	Petroleos Mexicanos*	5,95%	28/01/2031	4.322.901	0,38
848.000	Petroleos Mexicanos*	6,35%	12/02/2048	723.840	0,06
302.000	Petroleos Mexicanos*	6,88%	16/10/2025	334.692	0,03
641.000	Petroleos Mexicanos*	6,95%	28/01/2060	568.054	0,05
4.264.000	Petroleos Mexicanos*	7,69%	23/01/2050	4.109.430	0,36
300.000	Petropavlovsk 2016 Ltd*	8,13%	14/11/2022	311.612	0,03
771.000	Petrorio Luxembourg Sarl**	6,13%	09/06/2026	789.697	0,07
993.000	Power Finance Corp Ltd*	3,95%	23/04/2030	1.025.356	0,09
451.000	Powerchina Roadbridge Group British Virgin Islands Ltd*	3,08%	29/12/2049	451.203	0,04
1.123.000	Prosus NV*	3,68%	21/01/2030	1.201.108	0,11
496.000	Prosus NV*	5,50%	21/07/2025	566.111	0,05

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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 32,59% (31 de diciembre de 2020: 28,55%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
826.000	PTTEP Treasury Center Co Ltd*	3,90%	06/12/2059	890.961	0,08
335.000	Qatar Petroleum Development Co*	3,13%	12/07/2041	333.764	0,03
263.000	Qatar Petroleum Development Co*	3,30%	12/07/2051	263.000	0,02
1.025.000	QNB Finance Ltd*	2,63%	12/05/2025	1.074.173	0,09
500.000	QNB Finansbank AS*	4,88%	19/05/2022	510.472	0,04
1.234.000	QNB Finansbank AS*	6,88%	07/09/2024	1.339.816	0,12
1.514.000	REC Ltd*	2,25%	01/09/2026	1.484.774	0,13
450.000	REC Ltd*	3,50%	12/12/2024	471.734	0,04
1.286.000	Rede D'or Finance Sarl**	4,50%	22/01/2030	1.321.847	0,12
300.000	Reliance Industries Ltd*	3,67%	30/11/2027	328.558	0,03
250.000	Reliance Industries Ltd*	4,88%	10/02/2045	311.974	0,03
1.025.000	RKPF Overseas 2020 A Ltd*	5,20%	12/01/2026	1.031.922	0,09
1.894.000	Rumo Luxembourg Sarl**	5,25%	10/01/2028	2.029.705	0,18
580.000	SA Global Sukuk Ltd*	2,69%	17/06/2031	586.117	0,05
732.000	SABIC Capital I BV*	2,15%	14/09/2030	708.985	0,06
2.050.000	Saka Energi Indonesia PT*	4,45%	05/05/2024	1.949.017	0,17
1.573.000	Samba Funding Ltd*	2,75%	02/10/2024	1.641.543	0,14
360.000	Sands China Ltd**	3,80%	08/01/2026	385.819	0,03
300.000	Sands China Ltd*	4,38%	18/06/2030	325.458	0,03
497.000	Sands China Ltd*	5,13%	08/08/2025	556.536	0,05
1.845.000	Sands China Ltd*	5,40%	08/08/2028	2.144.241	0,19
280.000	Sasol Financing USA LLC*	4,38%	18/09/2026	290.151	0,03
1.845.000	Sasol Financing USA LLC*	5,88%	27/03/2024	1.975.100	0,17
1.025.000	Sasol Financing USA LLC*	6,50%	27/09/2028	1.156.671	0,10
4.450.000	Saudi Arabian Oil Co*	4,25%	16/04/2039	4.991.961	0,44
1.095.000	Saudi Arabian Oil Co*	4,38%	16/04/2049	1.257.018	0,11
790.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 4*	4,22%	27/01/2024	855.150	0,08
484.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 4*	4,72%	27/09/2028	569.224	0,05
800.000	SEPLAT Energy Plc*	7,75%	01/04/2026	836.404	0,07
600.000	Shanghai Port Group BVI Development 2 Co Ltd*	2,38%	13/07/2030	602.737	0,05
500.000	Shanghai Port Group BVI Development Co Ltd*	2,85%	11/09/2029	522.833	0,05
251.000	Shimao Group Holdings Ltd*	5,60%	15/07/2026	262.971	0,02
1.744.000	Shinhan Bank Co Ltd*	4,50%	26/03/2028	1.994.141	0,18
909.000	Shinhan Financial Group Co Ltd*	5,88%	29/12/2049	975.802	0,09
995.000	Shriram Transport Finance Co Ltd*	4,40%	13/03/2024	999.726	0,09
500.000	Shriram Transport Finance Co Ltd*	5,10%	16/07/2023	509.000	0,04
1.291.000	SierraCol Energy Andina LLC**	6,00%	15/06/2028	1.308.364	0,12
596.000	Sigma Alimentos SA de CV*	4,13%	02/05/2026	651.127	0,06

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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 32,59% (31 de diciembre de 2020: 28,55%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
896.000	Simpar Europe SA**	5,20%	26/01/2031	920.980	0,08
1.524.000	Southern Copper Corp*	6,75%	16/04/2040	2.176.287	0,19
9.721.000	Southern Gas Corridor CJSC*	6,88%	24/03/2026	11.645.855	1,03
524.000	State Agency of Roads of Ukraine*	6,25%	24/06/2028	524.967	0,05
2.726.000	State Oil Co of the Azerbaijan Republic*	6,95%	18/03/2030	3.441.976	0,30
1.200.000	StoneCo Ltd**	3,95%	16/06/2028	1.198.824	0,11
600.000	Studio City Finance Ltd*	6,00%	15/07/2025	631.650	0,06
1.845.000	Studio City Finance Ltd*	6,50%	15/01/2028	1.980.986	0,17
646.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd*	3,75%	25/02/2029	710.499	0,06
480.000	Sunac China Holdings Ltd*	5,95%	26/04/2024	473.102	0,04
599.000	Sunac China Holdings Ltd*	6,50%	26/01/2026	577.420	0,05
1.470.000	Sunac China Holdings Ltd*	7,00%	09/07/2025	1.446.557	0,13
200.000	Sunac China Holdings Ltd*	7,95%	08/08/2022	204.591	0,02
600.000	Sunac China Holdings Ltd*	8,35%	19/04/2023	621.210	0,05
850.000	Suzano Austria GmbH*	5,00%	15/01/2030	964.112	0,09
604.000	Suzano Austria GmbH**	7,00%	16/03/2047	817.583	0,07
604.000	Telecom Argentina SA**	8,00%	18/07/2026	570.780	0,05
918.000	Telefonica Celular del Paraguay SA**	5,88%	15/04/2027	965.736	0,09
400.000	Tencent Holdings Ltd*	3,24%	03/06/2050	392.670	0,03
902.000	Tencent Holdings Ltd*	3,60%	19/01/2028	988.887	0,09
1.201.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd**	3,25%	15/08/2030	1.222.324	0,11
3.041.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*	3,15%	01/10/2026	2.896.552	0,26
1.456.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV**	7,13%	31/01/2025	1.607.169	0,14
1.610.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd*	3,75%	18/06/2050	1.541.888	0,14
1.474.000	TNB Global Ventures Capital Bhd*	4,85%	01/11/2028	1.720.336	0,15
367.000	Transportadora de Gas del Sur SA*	6,75%	02/05/2025	346.921	0,03
796.000	Trust Fibra Uno**	5,25%	15/12/2024	885.614	0,08
1.120.000	Trust Fibra Uno*	6,39%	15/01/2050	1.318.559	0,12
550.000	Tullow Oil Plc**	7,00%	01/03/2025	490.325	0,04
814.000	Tullow Oil Plc*	10,25%	15/05/2026	856.324	0,08
1.265.000	Turkcell İletişim Hizmetleri AS*	5,80%	11/04/2028	1.344.333	0,12
596.000	Türkiye Garanti Bankası AS*	5,25%	13/09/2022	615.996	0,05
826.000	Türkiye Garanti Bankası AS*	5,88%	16/03/2023	863.203	0,08
400.000	Türkiye İş Bankası AS*	6,13%	25/04/2024	415.978	0,04
596.000	Türkiye Petrol Rafinerileri AS*	4,50%	18/10/2024	597.073	0,05
612.000	Türkiye Sınai Kalkınma Bankası AS*	6,00%	23/01/2025	621.999	0,05
1.139.000	Türkiye Sise ve Cam Fabrikaları AS*	6,95%	14/03/2026	1.263.849	0,11
485.000	Türkiye Vakıflar Bankası TAO*	6,50%	08/01/2026	495.737	0,04

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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 32,59% (31 de diciembre de 2020: 28,55%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
194.833	Ukreximbank Via Biz Finance Plc*	9,63%	27/04/2022	200.702	0,02
641.000	Ulker Biskuvi Sanayi AS*	6,95%	30/10/2025	696.299	0,06
1.194.000	Ultrapar International SA*	5,25%	06/06/2029	1.287.269	0,11
1.095.000	Unigel Luxembourg SA*	8,75%	01/10/2026	1.188.688	0,10
500.000	United Bank for Africa Plc*	7,75%	08/06/2022	516.158	0,05
1.155.000	United Overseas Bank Ltd*	2,00%	14/10/2031	1.156.871	0,10
1.194.000	Usiminas International Sarl**	5,88%	18/07/2026	1.296.290	0,11
531.000	Vale Overseas Ltd*	3,75%	08/07/2030	566.019	0,05
821.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	8,95%	11/03/2025	807.614	0,07
500.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	13,88%	21/01/2024	548.948	0,05
1.250.000	Vedanta Resources Ltd*	7,13%	31/05/2023	1.160.013	0,10
371.000	VEON Holdings BV*	3,38%	25/11/2027	374.302	0,03
2.004.000	VEON Holdings BV**	4,00%	09/04/2025	2.117.497	0,19
100.000	Vnesheconombank Via VEB Finance Plc*	6,80%	22/11/2025	118.250	0,01
828.000	Volcan Compania Minera SAA*	4,38%	11/02/2026	822.427	0,07
300.000	Votorantim Cimentos International SA**	7,25%	05/04/2041	408.084	0,04
597.000	VTR Comunicaciones SpA**	5,13%	15/01/2028	626.346	0,06
737.000	VTR Finance NV**	6,38%	15/07/2028	783.862	0,07
625.000	Wynn Macau Ltd*	5,63%	26/08/2028	653.519	0,06
1.500.000	XP Inc**	3,25%	01/07/2026	1.485.000	0,13
600.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS*	5,75%	24/02/2022	612.006	0,05
763.000	YPF SA**	7,00%	15/12/2047	501.600	0,04
757.000	YPF SA*	8,50%	23/03/2025	676.573	0,06
1.668.000	YPF SA*	8,50%	28/07/2025	1.322.307	0,11
800.000	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd*	3,13%	16/07/2025	801.001	0,07
Total dólar estadounidense				347.877.216	30,75
Total bonos de empresa				368.705.625	32,59
Bonos del Estado 65,13% (31 de diciembre de 2020: 65,07%)					
Peso chileno					
2.715.000.000	Bonos de la Tesorería de la República en pesos*	2,80%	01/10/2033	3.031.426	0,27
5.000.000	Bonos de la Tesorería de la República en pesos*	5,10%	15/07/2050	6.768	0,00
Total peso chileno				3.038.194	0,27
Yuan renminbi chino					
98.000.000	China Government Bond**	1,99%	09/04/2025	14.674.307	1,30
59.200.000	China Government Bond**	2,36%	02/07/2023	9.103.641	0,80
12.190.000	China Government Bond**	2,68%	21/05/2030	1.817.138	0,16

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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 del Estado 65,13% (31 de diciembre de 2020: 65,07%) (cont.)					
Yuan renminbi chino (cont.)					
57.770.000	China Government Bond**	2,85%	04/06/2027	8.847.256	0,78
19.300.000	China Government Bond**	2,94%	17/10/2024	3.000.133	0,27
36.000.000	China Government Bond**	3,02%	22/10/2025	5.596.624	0,49
3.000.000	China Government Bond**	3,12%	05/12/2026	467.772	0,04
26.200.000	China Government Bond**	3,13%	21/11/2029	4.055.855	0,36
9.400.000	China Government Bond**	3,27%	19/11/2030	1.475.391	0,13
8.000.000	China Government Bond**	3,28%	03/12/2027	1.255.841	0,11
9.900.000	China Government Bond**	3,72%	12/04/2051	1.548.964	0,14
15.000.000	China Government Bond**	3,81%	14/09/2050	2.373.804	0,21
Total yuan renminbi chino				54.216.726	4,79
Peso colombiano					
12.204.052.542	Colombian TES*	3,00%	25/03/2033	3.148.214	0,28
70.289.800.000	Colombian TES*	5,75%	03/11/2027	18.035.751	1,60
21.987.100.000	Colombian TES*	6,00%	28/04/2028	5.658.973	0,50
27.790.900.000	Colombian TES*	7,00%	30/06/2032	7.264.180	0,64
8.546.200.000	Colombian TES*	7,25%	18/10/2034	2.244.978	0,20
171.000.000	Financiera de Desarrollo Territorial SA Findeter*	7,88%	12/08/2024	46.958	0,00
Total peso colombiano				36.399.054	3,22
Corona checa					
20.530.000	Czech Republic Government Bond*	0,95%	15/05/2030	887.103	0,08
131.230.000	Czech Republic Government Bond*	1,00%	26/06/2026	5.900.593	0,52
72.630.000	Czech Republic Government Bond*	1,20%	13/03/2031	3.188.551	0,28
164.760.000	Czech Republic Government Bond*	2,40%	17/09/2025	7.893.822	0,70
155.890.000	Czech Republic Government Bond*	2,75%	23/07/2029	7.760.285	0,68
Total corona checa				25.630.354	2,26
Peso de la República Dominicana					
36.200.000	Dominican Republic Bond*	11,25%	05/02/2027	764.426	0,06
117.800.000	Dominican Republic International Bond**	8,63%	11/06/2031	2.145.826	0,19
23.200.000	Dominican Republic International Bond*	8,90%	15/02/2023	428.899	0,04
Total peso de la República Dominicana				3.339.151	0,29
Libra egipcia					
24.281.000	Egypt Government Bond*	14,20%	07/07/2023	1.556.432	0,14
56.761.000	Egypt Government Bond*	14,41%	07/07/2027	3.607.795	0,32
61.268.000	Egypt Government Bond*	14,48%	06/04/2026	3.909.466	0,34

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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 del Estado 65,13% (31 de diciembre de 2020: 65,07%) (cont.)					
Libra egipcia (cont.)					
47.545.000	Egypt Government Bond*	15,90%	02/07/2024	3.170.757	0,28
Total libra egipcia				12.244.450	1,08
Euro					
688.000	Banque Centrale de Tunisie International Bond*	5,63%	17/02/2024	760.500	0,07
417.000	Banque Centrale de Tunisie International Bond*	6,38%	15/07/2026	455.275	0,04
166.000	Benin Government International Bond*	4,88%	19/01/2032	196.890	0,02
136.000	Benin Government International Bond*	6,88%	19/01/2052	167.189	0,02
747.000	Croatia Government International Bond*	1,13%	04/03/2033	879.054	0,08
1.270.000	Egypt Government International Bond*	6,38%	11/04/2031	1.566.400	0,14
455.000	Hungary Government International Bond*	1,50%	17/11/2050	501.045	0,04
201.000	Hungary Government International Bond*	1,75%	05/06/2035	252.268	0,02
163.000	Indonesia Government International Bond*	1,10%	12/03/2033	188.635	0,02
2.694.000	Ivory Coast Government International Bond*	5,88%	17/10/2031	3.432.210	0,30
2.303.000	Ivory Coast Government International Bond*	6,63%	22/03/2048	2.856.526	0,25
1.920.000	Ivory Coast Government International Bond*	6,88%	17/10/2040	2.482.540	0,22
495.000	North Macedonia Government International Bond*	1,63%	10/03/2028	580.475	0,05
3.045.000	Peruvian Government International Bond*	1,25%	11/03/2033	3.508.736	0,31
920.000	Provincia de Buenos Aires*	5,38%	20/01/2023	433.684	0,04
615.000	Republic of Cameroon International Bond*	5,95%	07/07/2032	729.328	0,06
186.000	Romanian Government International Bond*	2,63%	02/12/2040	218.398	0,02
3.316.000	Romanian Government International Bond*	3,38%	28/01/2050	4.184.338	0,37
200.000	Romanian Government International Bond*	3,88%	29/10/2035	278.240	0,02
1.124.000	Romanian Government International Bond*	4,63%	03/04/2049	1.684.876	0,15
240.000	Senegal Government International Bond*	4,75%	13/03/2028	296.372	0,03
406.000	Senegal Government International Bond*	5,38%	08/06/2037	475.481	0,04
992.000	Serbia International Bond*	1,50%	26/06/2029	1.184.790	0,11
466.000	Serbia International Bond*	1,65%	03/03/2033	540.329	0,05
612.000	Serbia International Bond*	3,13%	15/05/2027	806.880	0,07
729.000	Ukraine Government International Bond**	6,75%	20/06/2026	942.733	0,08
Total euro				29.603.192	2,62
Cedi ghanés					
15.590.000	Republic of Ghana Government Bonds*	19,25%	18/12/2023	2.801.868	0,25
81	Republic of Ghana Government Bonds*	24,75%	19/07/2021	14	0,00
Total cedi ghanés				2.801.882	0,25

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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 del Estado 65,13% (31 de diciembre de 2020: 65,07%) (cont.)					
Forint húngaro					
433.290.000	Hungary Government Bond*	1,50%	22/04/2026	1.427.841	0,12
282.450.000	Hungary Government Bond*	3,00%	26/06/2024	991.482	0,09
1.156.390.000	Hungary Government Bond*	3,00%	27/10/2027	4.091.166	0,36
1.532.890.000	Hungary Government Bond*	3,00%	21/08/2030	5.396.106	0,48
332.760.000	Hungary Government Bond*	3,00%	27/10/2038	1.102.256	0,10
531.820.000	Hungary Government Bond*	3,25%	22/10/2031	1.900.623	0,17
678.770.000	Hungary Government Bond*	6,75%	22/10/2028	2.959.269	0,26
Total forint húngaro				17.868.743	1,58
Rupia india					
900.000.000	India Government Bond*	7,32%	28/01/2024	12.789.806	1,13
Total rupia india				12.789.806	1,13
Rupia indonesia					
244.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	5,50%	15/04/2026	16.846.560	1,49
49.400.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,50%	15/06/2025	3.571.526	0,32
8.114.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,50%	15/02/2031	553.218	0,05
61.883.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,63%	15/05/2033	4.244.503	0,37
51.537.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00%	15/05/2022	3.665.774	0,32
12.300.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00%	15/05/2027	898.334	0,08
16.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50%	15/08/2032	1.162.266	0,10
45.420.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50%	15/06/2035	3.242.048	0,29
5.630.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50%	15/05/2038	397.414	0,03
32.850.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50%	15/04/2040	2.323.175	0,21
114.376.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,13%	15/05/2024	8.617.009	0,76
3.824.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,25%	15/05/2029	294.453	0,03
39.741.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,25%	15/05/2036	3.002.690	0,27
19.584.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38%	15/03/2024	1.474.528	0,13
75.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38%	15/09/2026	5.807.179	0,51
917.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38%	15/03/2034	70.149	0,01
7.700.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38%	15/04/2039	589.714	0,05
63.761.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,75%	15/05/2031	5.063.874	0,45
11.961.000.000	Indonesia Treasury Bond*	9,00%	15/03/2029	954.674	0,08
Total rupia indonesia				62.779.088	5,55
Ringgit malayo					
4.300.000	Malaysia Government Bond**	2,63%	15/04/2031	978.550	0,09
4.000.000	Malaysia Government Bond**	3,50%	31/05/2027	995.883	0,09

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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 del Estado 65,13% (31 de diciembre de 2020: 65,07%) (cont.)					
Ringgit malayo (cont.)					
13.227.000	Malaysia Government Bond**	3,62%	30/11/2021	3.209.882	0,28
7.000.000	Malaysia Government Bond**	3,73%	15/06/2028	1.760.696	0,16
11.000.000	Malaysia Government Bond**	3,76%	20/04/2023	2.734.148	0,24
4.000.000	Malaysia Government Bond**	3,76%	22/05/2040	906.992	0,08
22.200.000	Malaysia Government Bond**	3,80%	17/08/2023	5.545.730	0,49
8.580.000	Malaysia Government Bond**	3,83%	05/07/2034	2.060.003	0,18
8.700.000	Malaysia Government Bond**	3,90%	30/11/2026	2.210.677	0,20
6.000.000	Malaysia Government Bond**	3,91%	15/07/2026	1.526.193	0,13
5.000.000	Malaysia Government Bond**	3,96%	15/09/2025	1.271.236	0,11
6.925.000	Malaysia Government Bond**	4,06%	30/09/2024	1.756.044	0,16
5.200.000	Malaysia Government Bond**	4,07%	15/06/2050	1.202.272	0,11
2.000.000	Malaysia Government Bond**	4,23%	30/06/2031	516.895	0,05
6.900.000	Malaysia Government Bond**	4,25%	31/05/2035	1.733.812	0,15
4.130.000	Malaysia Government Bond**	4,64%	07/11/2033	1.081.066	0,10
990.000	Malaysia Government Bond**	4,89%	08/06/2038	258.950	0,02
3.100.000	Malaysia Government Bond**	4,94%	30/09/2043	815.662	0,07
15.000.000	Malaysia Government Investment Issue**	4,07%	30/09/2026	3.838.555	0,34
5.000.000	Malaysia Government Investment Issue**	4,37%	31/10/2028	1.302.222	0,11
Total ringgit malayo				35.705.468	3,16
Peso mexicano					
69.820.000	Mexican Bonos*	7,75%	29/05/2031	3.704.224	0,33
183.810.000	Mexican Bonos*	7,75%	23/11/2034	9.749.717	0,86
64.130.000	Mexican Bonos*	7,75%	13/11/2042	3.313.879	0,29
26.590.800	Mexican Bonos*	8,00%	07/11/2047	1.409.971	0,12
88.530.000	Mexican Bonos*	8,50%	18/11/2038	4.917.409	0,44
129.740.000	Mexican Bonos*	10,00%	05/12/2024	7.281.556	0,64
1.010.895.800	Mexico Cetes*	0,00%	01/07/2021	5.077.104	0,45
6.419.076.800	Mexico Cetes*	0,00%	29/07/2021	32.130.777	2,84
724.685.800	Mexico Cetes*	0,00%	04/11/2021	3.582.572	0,32
Total peso mexicano				71.167.209	6,29
Sol peruano					
12.864.000	Fondo MIVIVIENDA SA*	7,00%	14/02/2024	3.627.765	0,32
2.110.000	Peru Government Bond*	5,35%	12/08/2040	488.674	0,04
2.604.000	Peru Government Bond*	5,40%	12/08/2034	643.940	0,06
9.323.000	Peru Government Bond*	6,15%	12/08/2032	2.554.342	0,23
2.542.000	Peruvian Government International Bond**	5,20%	12/09/2023	725.863	0,07

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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 del Estado 65,13% (31 de diciembre de 2020: 65,07%) (cont.)					
Sol peruano (cont.)					
7.017.000	Peruvian Government International Bond*	5,40%	12/08/2034	1.735.225	0,15
6.154.000	Peruvian Government International Bond**	6,90%	12/08/2037	1.706.421	0,15
12.028.000	Peruvian Government International Bond*	6,95%	12/08/2031	3.530.339	0,31
60.000	Peruvian Government International Bond**	8,20%	12/08/2026	19.486	0,00
Total sol peruano				15.032.055	1,33
Zloty polaco					
26.264.000	Republic of Poland Government Bond**	1,25%	25/10/2030	6.678.107	0,59
11.956.000	Republic of Poland Government Bond*	2,50%	25/04/2024	3.307.892	0,29
32.031.000	Republic of Poland Government Bond*	2,50%	25/07/2027	8.953.062	0,79
9.407.000	Republic of Poland Government Bond**	2,75%	25/04/2028	2.678.552	0,24
7.691.000	Republic of Poland Government Bond*	2,75%	25/10/2029	2.212.248	0,20
Total zloty polaco				23.829.861	2,11
Nuevo leu rumano					
4.460.000	Romania Government Bond*	3,65%	28/07/2025	1.114.862	0,10
9.965.000	Romania Government Bond*	3,65%	24/09/2031	2.436.182	0,21
10.510.000	Romania Government Bond*	4,00%	25/10/2023	2.623.663	0,23
13.000.000	Romania Government Bond*	4,40%	25/09/2023	3.279.137	0,29
2.655.000	Romania Government Bond*	4,75%	11/10/2034	686.366	0,06
5.905.000	Romania Government Bond*	4,85%	22/04/2026	1.551.792	0,14
Total nuevo leu rumano				11.692.002	1,03
Rublo ruso					
1.204.917.000	Russian Federal Bond - OFZ*	4,50%	16/07/2025	15.153.427	1,34
820.611.000	Russian Federal Bond - OFZ*	6,90%	23/05/2029	11.199.165	0,99
798.072.000	Russian Federal Bond - OFZ*	7,25%	10/05/2034	11.080.232	0,98
41.694.000	Russian Federal Bond - OFZ*	7,70%	16/03/2039	604.398	0,05
633.525.653	Russian Federal Inflation Linked Bond*	2,50%	17/07/2030	8.502.943	0,75
Total rublo ruso				46.540.165	4,11
Dinar serbio					
27.210.000	Serbia Treasury Bonds*	4,50%	11/01/2026	301.114	0,03
120.490.000	Serbia Treasury Bonds*	5,88%	08/02/2028	1.460.889	0,13
Total dinar serbio				1.762.003	0,16

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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 del Estado 65,13% (31 de diciembre de 2020: 65,07%) (cont.)					
Rand sudafricano					
160.383.717	Republic of South Africa Government Bond*	8,00%	31/01/2030	10.641.438	0,94
59.916.972	Republic of South Africa Government Bond*	8,25%	31/03/2032	3.828.467	0,34
313.847.237	Republic of South Africa Government Bond*	8,50%	31/01/2037	18.868.685	1,67
4.232.143	Republic of South Africa Government Bond*	8,75%	31/01/2044	250.756	0,02
25.531.869	Republic of South Africa Government Bond*	8,75%	28/02/2048	1.505.386	0,13
233.016.517	Republic of South Africa Government Bond*	8,88%	28/02/2035	14.796.878	1,31
77.801.320	Republic of South Africa Government Bond*	9,00%	31/01/2040	4.776.504	0,42
Total rand sudafricano				54.668.114	4,83
Baht tailandés					
125.000.000	Thailand Government Bond**	0,95%	17/06/2025	3.939.863	0,35
265.000.000	Thailand Government Bond**	1,45%	17/12/2024	8.499.368	0,75
66.425.000	Thailand Government Bond*	1,59%	17/12/2035	1.917.880	0,17
50.500.000	Thailand Government Bond**	1,60%	17/12/2029	1.576.842	0,14
10.000.000	Thailand Government Bond**	1,60%	17/06/2035	291.533	0,03
24.000	Thailand Government Bond**	2,00%	17/12/2022	765	0,00
63.100.000	Thailand Government Bond*	2,00%	17/12/2031	2.009.431	0,18
127.323.000	Thailand Government Bond**	2,13%	17/12/2026	4.221.809	0,37
154.618.000	Thailand Government Bond**	2,40%	17/12/2023	5.041.926	0,44
502.000	Thailand Government Bond**	2,88%	17/12/2028	17.309	0,00
8.831.000	Thailand Government Bond**	2,88%	17/06/2046	289.317	0,02
176.684.000	Thailand Government Bond**	3,30%	17/06/2038	6.211.022	0,55
136.278.000	Thailand Government Bond**	3,40%	17/06/2036	4.836.085	0,43
632.000	Thailand Government Bond**	3,63%	16/06/2023	20.902	0,00
191.325.000	Thailand Government Bond**	3,65%	20/06/2031	6.976.853	0,62
43.380.000	Thailand Government Bond**	3,78%	25/06/2032	1.605.507	0,14
88.188.000	Thailand Government Bond**	3,85%	12/12/2025	3.121.224	0,28
87.595.000	Thailand Government Bond**	4,88%	22/06/2029	3.425.918	0,30
Total baht tailandés				54.003.554	4,77
Lira turca					
7.896.564	Turkey Government Bond*	10,50%	11/08/2027	681.263	0,06
16.321.823	Turkey Government Bond*	10,60%	11/02/2026	1.475.775	0,13
61.627.000	Turkey Government Bond*	12,60%	01/10/2025	6.065.161	0,54
Total lira turca				8.222.199	0,73

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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 del Estado 65,13% (31 de diciembre de 2020: 65,07%) (cont.)					
Chelín ugandés					
8.769.700.000	Republic of Uganda Government Bonds*	14,25%	22/06/2034	2.478.374	0,22
Total chelín ugandés				2.478.374	0,22
Dólar estadounidense					
456.000	Abu Dhabi Government International Bond*	2,70%	02/09/2070	411.139	0,04
427.000	Angolan Government International Bond*	8,00%	26/11/2029	437.325	0,04
1.232.000	Angolan Government International Bond*	8,25%	09/05/2028	1.284.136	0,11
5.332.000	Angolan Government International Bond*	9,38%	08/05/2048	5.553.289	0,49
8.060.000	Argentine Republic Government International Bond*	0,13%	09/07/2030	2.907.323	0,26
4.935.086	Argentine Republic Government International Bond*	0,13%	09/01/2038	1.872.026	0,17
11.337.745	Argentine Republic Government International Bond*	0,13%	09/07/2041	4.064.582	0,36
265.400	Belize Government International Bond*	4,94%	20/02/2034	111.136	0,01
398.000	Bermuda Government International Bond*	2,38%	20/08/2030	398.995	0,04
1.514.000	Bermuda Government International Bond*	4,75%	15/02/2029	1.766.762	0,16
1.296.000	Brazilian Government International Bond*	5,00%	27/01/2045	1.315.148	0,12
2.860.000	Brazilian Government International Bond*	5,63%	07/01/2041	3.119.202	0,28
4.670.000	Colombia Government International Bond*	5,00%	15/06/2045	4.977.986	0,44
1.330.000	Colombia Government International Bond*	5,20%	15/05/2049	1.460.047	0,13
920.000	Colombia Government International Bond*	6,13%	18/01/2041	1.092.325	0,10
561.000	Corp Financiera de Desarrollo SA*	5,25%	15/07/2029	589.050	0,05
2.253.000	Costa Rica Government International Bond*	7,00%	04/04/2044	2.337.510	0,21
2.878.000	Costa Rica Government International Bond*	7,16%	12/03/2045	3.014.734	0,27
1.145.000	Development Bank of Mongolia LLC*	7,25%	23/10/2023	1.237.491	0,11
3.614.000	Dominican Republic International Bond*	5,88%	30/01/2060	3.615.321	0,31
650.000	Dominican Republic International Bond*	6,00%	19/07/2028	740.350	0,07
314.000	Dominican Republic International Bond*	6,40%	05/06/2049	339.183	0,03
219.000	Dominican Republic International Bond*	6,50%	15/02/2048	239.652	0,02
1.037.000	Dominican Republic International Bond*	6,85%	27/01/2045	1.177.043	0,10
219.844	Ecuador Government International Bond*	0,00%	31/07/2030	122.288	0,01
1.507.922	Ecuador Government International Bond*	0,50%	31/07/2030	1.293.058	0,11
3.799.917	Ecuador Government International Bond*	0,50%	31/07/2035	2.621.943	0,23
1.886.446	Ecuador Government International Bond*	0,50%	31/07/2040	1.176.671	0,10
965.000	Egypt Government International Bond*	7,50%	16/02/2061	907.534	0,08
492.000	Egypt Government International Bond*	8,15%	20/11/2059	493.557	0,04
2.144.000	Egypt Government International Bond*	8,50%	31/01/2047	2.240.212	0,20
2.800.000	Egypt Government International Bond*	8,70%	01/03/2049	2.965.340	0,26
1.219.000	El Salvador Government International Bond*	7,12%	20/01/2050	1.042.245	0,09
512.000	El Salvador Government International Bond*	7,75%	24/01/2023	508.262	0,04

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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 del Estado 65,13% (31 de diciembre de 2020: 65,07%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
1.693.000	El Salvador Government International Bond*	9,50%	15/07/2052	1.671.838	0,15
900.000	Ghana Government International Bond*	7,63%	16/05/2029	908.947	0,08
902.000	Ghana Government International Bond*	7,75%	07/04/2029	921.027	0,08
494.000	Ghana Government International Bond*	8,63%	07/04/2034	509.421	0,04
414.000	Ghana Government International Bond*	8,75%	11/03/2061	399.117	0,04
561.000	Ghana Government International Bond*	8,95%	26/03/2051	556.265	0,05
5.539.000	Ghana Government International Bond*	10,75%	14/10/2030	6.991.125	0,62
551.000	Honduras Government International Bond*	5,63%	24/06/2030	579.377	0,05
351.000	Honduras Government International Bond*	6,25%	19/01/2027	384.872	0,03
1.665.000	Indonesia Government International Bond*	5,13%	15/01/2045	2.065.415	0,18
934.000	Indonesia Government International Bond*	5,25%	17/01/2042	1.166.548	0,10
2.040.000	Indonesia Government International Bond*	8,50%	12/10/2035	3.270.000	0,29
1.057.875	Iraq International Bond*	5,80%	15/01/2028	1.026.779	0,09
481.000	Kenya Government International Bond*	6,30%	23/01/2034	479.243	0,04
4.139.000	Lebanon Government International Bond*	6,60%	27/11/2026	514.776	0,05
323.000	Lebanon Government International Bond*	6,65%	26/02/2030	40.664	0,00
965.000	Lebanon Government International Bond*	6,85%	25/05/2029	121.561	0,01
7.131.000	Lebanon Government International Bond*	8,25%	17/05/2034	891.945	0,08
2.790.000	Mexico Government International Bond*	5,75%	12/10/2110	3.344.289	0,30
340.000	Mongolia Government International Bond*	3,50%	07/07/2027	335.054	0,03
2.203.000	Mongolia Government International Bond*	8,75%	09/03/2024	2.541.200	0,22
552.000	Nigeria Government International Bond*	6,50%	28/11/2027	584.835	0,05
1.677.000	Nigeria Government International Bond*	7,88%	16/02/2032	1.803.010	0,16
1.353.000	Nigeria Government International Bond*	8,75%	21/01/2031	1.533.022	0,14
209.000	Nigeria Government International Bond*	9,25%	21/01/2049	238.807	0,02
4.090.000	Oman Government International Bond*	6,75%	17/01/2048	4.081.063	0,36
200.000	Oman Government International Bond*	7,00%	25/01/2051	202.829	0,02
485.000	Papua New Guinea Government International Bond*	8,38%	04/10/2028	486.018	0,04
1.238.000	Paraguay Government International Bond*	5,40%	30/03/2050	1.449.389	0,13
263.000	Paraguay Government International Bond*	5,60%	13/03/2048	310.011	0,03
778.000	Paraguay Government International Bond*	6,10%	11/08/2044	970.174	0,09
250.000	Peruvian Government International Bond*	8,75%	21/11/2033	393.102	0,03
363.163	Provincia de Cordoba*	5,00%	10/12/2025	282.069	0,02
3.448.000	Qatar Government International Bond*	4,82%	14/03/2049	4.448.079	0,39
751.000	Republic of Armenia International Bond*	3,60%	02/02/2031	708.039	0,06
370.000	Republic of Cameroon International Bond*	9,50%	19/11/2025	435.098	0,04
1.073.000	Republic of South Africa Government International Bond*	5,65%	27/09/2047	1.096.767	0,10
2.746.000	Republic of South Africa Government International Bond*	5,75%	30/09/2049	2.815.570	0,25

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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 del Estado 65,13% (31 de diciembre de 2020: 65,07%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
525.000	Republic of Uzbekistan Bond*	3,70%	25/11/2030	521.581	0,05
377.000	Republic of Uzbekistan Bond*	5,38%	20/02/2029	421.423	0,04
3.000.000	Russian Foreign Bond - Eurobond*	4,38%	21/03/2029	3.375.364	0,30
94.003	Russian Foreign Bond - Eurobond*	7,50%	31/03/2030	108.233	0,01
520.000	Senegal Government International Bond*	6,75%	13/03/2048	526.578	0,05
610.000	Serbia International Bond*	2,13%	01/12/2030	577.052	0,05
473.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,20%	11/05/2027	294.442	0,03
4.800.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,75%	18/04/2028	3.024.000	0,27
1.075.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,83%	18/07/2026	690.688	0,06
1.196.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,85%	14/03/2024	834.210	0,07
1.913.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,85%	03/11/2025	1.286.493	0,11
3.019.000	Sri Lanka Government International Bond*	7,55%	28/03/2030	1.932.160	0,17
2.426.000	Sri Lanka Government International Bond*	7,85%	14/03/2029	1.552.640	0,14
200.000	Turkey Government International Bond*	5,13%	17/02/2028	194.754	0,02
1.184.000	Turkey Government International Bond*	5,88%	26/06/2031	1.153.216	0,10
750.000	Turkey Government International Bond*	5,95%	15/01/2031	737.020	0,07
2.004.000	Turkey Government International Bond*	6,00%	25/03/2027	2.051.104	0,18
250.000	Turkey Government International Bond*	6,00%	14/01/2041	226.995	0,02
1.320.000	Turkey Government International Bond*	6,38%	14/10/2025	1.384.981	0,12
1.736.000	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*	5,38%	24/10/2023	1.782.872	0,16
695.000	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*	8,25%	24/01/2024	754.020	0,07
2.701.000	Ukraine Government International Bond*	1,26%	31/05/2040	3.200.685	0,28
472.000	Ukraine Government International Bond*	6,88%	21/05/2029	489.411	0,04
836.000	Ukraine Government International Bond*	7,25%	15/03/2033	868.803	0,08
2.706.000	Ukraine Government International Bond*	7,38%	25/09/2032	2.841.002	0,25
2.263.000	Ukraine Government International Bond*	9,75%	01/11/2028	2.693.597	0,24
1.039.166	Uruguay Government International Bond*	5,10%	18/06/2050	1.365.230	0,12
7.776.600	Venezuela Government International Bond*	8,25%	13/10/2024	820.431	0,07
793.000	Zambia Government International Bond*	8,97%	30/07/2027	497.157	0,04
Total dólar estadounidense				144.196.352	12,75
Peso uruguayo					
28.994.774	Uruguay Government International Bond*	4,38%	15/12/2028	791.615	0,07
174.644.000	Uruguay Government International Bond*	9,88%	20/06/2022	4.135.523	0,36
Total peso uruguayo				4.927.138	0,43

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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 del Estado 65,13% (31 de diciembre de 2020: 65,07%) (cont.)					
Kwacha zambiano					
99.204.000	Zambia Government Bond*	13,00%	25/01/2031	1.928.030	0,17
Total kwacha zambiano				1.928.030	0,17
Total bonos del Estado				736.863.164	65,13
Número de acciones	Descripción de los valores			Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Fondos de inversión 1,48% (31 de diciembre de 2020: 1,11%)					
Dólar estadounidense					
1.596.964	Neuberger Berman China Bond Fund			16.720.213	1,48
Total fondos de inversión µ				16.720.213	1,48
Total inversiones				1.140.720.187	100,83

Contratos de divisas a plazo 1,46% (31 de diciembre de 2020: 1,09%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
21.491.469 BRL	4.233.104 USD	02/07/2021	Citibank NA	1	49.899	0,01
24.496.488 BRL	4.635.594 USD	02/09/2021	Goldman Sachs International	2	209.686	0,02
22.005.200 BRL	3.968.548 USD	23/07/2021	Goldman Sachs International	1	407.214	0,04
254.021.414 BRL	46.490.010 USD	02/07/2021	HSBC Bank Plc	1	4.133.547	0,37
146.001.183 BRL	27.260.438 USD	02/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.617.846	0,14
4.767.861.500 CLP	6.475.521 USD	27/09/2021	Citibank NA	1	56.803	0,01
63.619.703 CNY	9.663.431 USD	09/07/2021	Citibank NA	3	178.194	0,02
8.700.000 CNY	1.336.562 USD	09/07/2021	Goldman Sachs International	1	9.281	0,00
10.347.930 CNY	1.592.865 USD	09/07/2021	HSBC Bank Plc	1	7.904	0,00
21.322.478 CNY	3.294.832 USD	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	5.427	0,00
82.115.275 CNY	12.598.039 USD	27/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	30.999	0,00
14.535.808 CNY	2.233.562 USD	08/10/2021	Morgan Stanley	1	292	0,00
19.972.762 CNY	3.087.481 USD	02/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	3.871	0,00
31.549.948 CZK	1.233.354 €	15/09/2021	HSBC Bank Plc	1	1.081	0,00
2.781.697 €	975.494.003 HUF	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	12.735	0,00
5.248.168 €	23.692.017 PLN	07/07/2021	Goldman Sachs International	1	973	0,00
5.212.802 €	23.478.156 PLN	07/07/2021	HSBC Bank Plc	1	15.206	0,00
2.793.234 €	975.495.051 HUF	15/09/2021	HSBC Bank Plc	1	26.435	0,00
1.286.626 €	32.837.245 CZK	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	2.378	0,00
5.264.532 €	134.006.027 CZK	15/09/2021	Morgan Stanley	3	26.237	0,00
1.818.643 €	631.817.794 HUF	15/09/2021	Morgan Stanley	1	28.400	0,00
1.063.572.766 HUF	2.983.854 €	15/09/2021	Citibank NA	1	44.323	0,00
1.078.552.949 HUF	3.030.955 €	15/09/2021	HSBC Bank Plc	1	38.921	0,00
288.635.723 INR	3.831.465 USD	09/07/2021	HSBC Bank Plc	1	48.308	0,01

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 1,46% (31 de diciembre de 2020: 1,09%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
7.118.809.114 KRW	6.278.717 USD	27/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	19.267	0,00
797.984.696 KZT	1.850.399 USD	14/07/2021	Goldman Sachs International	1	13.993	0,00
1.645.504.799 KZT	3.781.466 USD	24/09/2021	Goldman Sachs International	1	5.221	0,00
846.674.952 KZT	1.966.496 USD	14/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	11.655	0,00
131.298.250 MXN	6.414.549 USD	27/09/2021	Citibank NA	1	105.667	0,01
85.668.652 MXN	4.235.714 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	25.666	0,00
159.027.483 MXN	7.916.418 USD	23/07/2021	Goldman Sachs International	1	49.754	0,01
127.513.487 MXN	6.286.697 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	56.153	0,01
70.137.210 PHP	1.422.286 USD	10/09/2021	Morgan Stanley	1	5.913	0,00
30.246.653 PLN	6.575.955 €	06/07/2021	Citibank NA	2	146.133	0,01
21.762.326 PLN	4.812.883 €	07/07/2021	Citibank NA	1	8.389	0,00
117.647.862 PLN	26.007.209 €	15/09/2021	Goldman Sachs International	2	19.515	0,00
102.019.164 PLN	22.367.764 €	06/07/2021	Goldman Sachs International	3	270.309	0,02
35.790.240 PLN	7.853.696 €	06/07/2021	HSBC Bank Plc	2	86.926	0,01
30.762.318 PLN	6.765.811 €	07/07/2021	HSBC Bank Plc	1	56.310	0,01
12.424.121 PLN	2.748.201 €	02/07/2021	Morgan Stanley	1	4.401	0,00
18.399.730 PLN	4.049.824 €	06/07/2021	Morgan Stanley	2	30.165	0,00
9.205.099 RON	1.845.244 €	06/10/2021	Citibank NA	1	15.155	0,00
28.649.865 RON	5.750.675 €	06/10/2021	Goldman Sachs International	1	38.188	0,00
23.254.721 RON	4.667.846 €	06/10/2021	JPMorgan Chase Bank	2	30.879	0,00
422.896.733 RUB	5.540.374 USD	16/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	237.433	0,02
1.156.647.785 RUB	14.929.978 USD	16/07/2021	Morgan Stanley	1	872.668	0,08
71.464.232 RUB	965.866 USD	16/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	10.511	0,00
17.448.884 TRY	1.902.621 USD	22/09/2021	Barclays Bank Plc	1	22.716	0,00
10.778.766 TRY	1.187.166 USD	22/09/2021	HSBC Bank Plc	1	2.180	0,00
37.079.984 TWD	1.326.494 USD	26/07/2021	BNP Paribas	1	4.429	0,00
88.942.511 UAH	3.041.327 USD	22/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	198.221	0,02
699.817 USD	22.303.368 THB	29/09/2021	Barclays Bank Plc	1	4.181	0,00
9.108.721 USD	37.740.449 MYR	03/09/2021	Barclays Bank Plc	2	46.736	0,01
1.493.301 USD	21.449.775.185 IDR	27/07/2021	BNP Paribas	1	22.078	0,00
8.056.707 USD	159.027.483 MXN	23/07/2021	Citibank NA	1	90.535	0,01
721.757 USD	2.339.024 ILS	10/09/2021	Citibank NA	1	3.357	0,00
165.265 USD	184.893.588 KRW	19/07/2021	Citibank NA	1	1.647	0,00
1.091.163 USD	15.763.788 ZAR	01/10/2021	Citibank NA	1	324	0,00
12.600.482 USD	10.530.783 €	06/07/2021	Citibank NA	2	110.969	0,01
12.180.156 USD	888.385.680 RUB	16/07/2021	Citibank NA	2	42.628	0,00
4.196.527 USD	26.759.432 CNY	02/07/2021	Citibank NA	1	54.745	0,01
5.415.636 USD	400.732.177 INR	16/09/2021	Citibank NA	1	75.491	0,01

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 1,46% (31 de diciembre de 2020: 1,09%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
5.487.643 USD	77.533.948 ZAR	06/07/2021	Citibank NA	1	60.346	0,01
954.045 USD	46.649.929 PHP	10/09/2021	Citibank NA	1	4.115	0,00
56.229.342 USD	276.445.847 BRL	02/07/2021	Citibank NA	2	1.136.853	0,10
9.438.975 USD	296.315.982 THB	01/07/2021	Citibank NA	2	193.546	0,02
5.877.020 USD	29.215.406 BRL	02/09/2021	Citibank NA	2	98.362	0,01
3.518.408 USD	13.021.908.280 COP	15/09/2021	Credit Suisse International	1	45.820	0,00
832.223 USD	698.792 €	06/07/2021	Goldman Sachs International	2	3.455	0,00
2.913.912 USD	9.464.875 ILS	10/09/2021	Goldman Sachs International	1	6.899	0,00
4.584.028 USD	23.021.907 BRL	03/08/2021	Goldman Sachs International	1	11.644	0,00
5.670.208 USD	179.211.110 THB	01/07/2021	Goldman Sachs International	3	78.598	0,01
3.566.951 USD	99.300.357 TWD	26/07/2021	Goldman Sachs International	1	2.733	0,00
3.924.143 USD	108.745.853 TWD	21/07/2021	Goldman Sachs International	1	22.569	0,00
4.495.415 USD	63.296.995 ZAR	06/07/2021	Goldman Sachs International	1	64.690	0,01
1.757.619 USD	1.272.059.752 CLP	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	14.110	0,00
50.781.939 USD	254.021.414 BRL	02/07/2021	HSBC Bank Plc	1	158.382	0,01
4.155.219 USD	131.918.236 THB	01/07/2021	HSBC Bank Plc	1	39.206	0,00
2.819.056 USD	38.859.775 ZAR	06/07/2021	HSBC Bank Plc	1	98.911	0,01
7.823.652 USD	10.472.099 SGD	12/07/2021	HSBC Bank Plc	1	33.245	0,00
829.510 USD	5.308.698 CNY	09/07/2021	HSBC Bank Plc	1	8.283	0,00
3.846.834 USD	106.722.709 TWD	09/07/2021	HSBC Bank Plc	1	21.784	0,00
624.157 USD	522.262 €	06/07/2021	HSBC Bank Plc	1	4.754	0,00
32.500.964 USD	470.674.998.004 IDR	19/08/2021	HSBC Bank Plc	6	315.945	0,03
21.734.841 USD	18.249.105 €	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	3	91.394	0,01
3.351.433 USD	13.881.637 MYR	03/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	18.267	0,00
7.045.980 USD	25.397.657.007 COP	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	273.118	0,03
4.291.931 USD	60.738.425 ZAR	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	40.303	0,00
3.797.134 USD	24.443.205 CNY	09/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	15.903	0,00
4.300.202 USD	85.353.634 MXN	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	13.337	0,00
946.338 USD	792.118 €	06/07/2021	Morgan Stanley	1	6.885	0,00
3.526.034 USD	50.255.173 ZAR	06/07/2021	Morgan Stanley	1	8.223	0,00
2.117.913 USD	1.738.418 €	06/07/2021	Société Générale	1	56.148	0,01
4.107.360 USD	59.478.312.119 IDR	19/08/2021	Standard Chartered Bank	2	40.200	0,00
2.959.566 USD	2.477.116 €	06/07/2021	Standard Chartered Bank	1	21.705	0,00
30.070.622 USD	24.786.846 €	06/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	4	673.411	0,06
8.307.803 USD	29.829.166.957 COP	23/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	327.669	0,03
25.216.980 USD	20.930.333 €	04/08/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	378.395	0,03
88.591.369.105 VND	3.837.616 USD	24/08/2021	Citibank NA	1	5.031	0,00
119.126.116 ZAR	8.310.482 USD	06/07/2021	Goldman Sachs International	1	28.225	0,00

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 1,46% (31 de diciembre de 2020: 1,09%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
61.044.144 ZAR	4.181.049 USD	06/07/2021	Morgan Stanley	1	91.979	0,01
Clases AUD con cobertura						
827.075 USD	1.065.380 AUD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	12	27.173	0,00
1.982 USD	2.633 AUD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	5	0,00
Clases EUR con cobertura						
279 €	330 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	2	0	0,00
988.163 USD	825.712 €	15/09/2021	Citibank NA	1	7.402	0,00
159.076 USD	130.142 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	24	4.684	0,00
210.281.048 USD	175.295.320 €	15/09/2021	Westpac Banking Corp	16	2.069.578	0,18
Clases GBP con cobertura						
314.983 £	433.301 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	9	1.856	0,00
6.139 £	8.477 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	2	6	0,00
2.695.431 USD	1.921.299 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	26	41.117	0,01
5.752 USD	4.123 £	15/09/2021	Westpac Banking Corp	8	56	0,00
Clases SEK con cobertura						
24.760 SEK	2.869 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	2	28	0,00
2.381 USD	20.171 SEK	15/09/2021	Citibank NA	1	20	0,00
476.874 USD	3.939.875 SEK	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	15.857	0,00
2.399.707 USD	20.162.555 SEK	19/07/2021	Westpac Banking Corp	25	41.715	0,01
223.073 USD	1.857.781 SEK	15/09/2021	Westpac Banking Corp	10	5.690	0,00
Clases SGD con cobertura						
50.000 SGD	37.153 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	37	0,00
174.875 USD	231.360 SGD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	2	2.790	0,00
46.721 USD	62.068 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	11	547	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					16.489.472	1,46

Contratos de futuros 0,04% (31 de diciembre de 2020: 0,01%)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(130)	90-Day Eurodollar Future December 2023	32.500	0,00
(61)	South Korea 10-Year Bond Future September 2021	3.250	0,00
412	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2021	263.966	0,03
(59)	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2021	26.797	0,00
19	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2021	143.384	0,01
Plusvalía latente total sobre contratos de futuros ±		469.897	0,04

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de swap de tipos de interés 0,33% (31 de diciembre de 2020: 1,21%)

	Importe nocional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/ (Pagar)#	Tipo fijo	Tipo variable	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
BRL	9.000.000	02/01/2023	Goldman Sachs International	(Pagar)	11,99%	1D BROIS	966.465	0,09
CLP	3.154.502.226	05/06/2030	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	2,33%	1D CLICP	610.449	0,05
BRL	29.361.709	03/01/2022	Morgan Stanley	(Pagar)	5,79%	1D BROIS	294.721	0,03
BRL	4.999.220	02/01/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	9,26%	1D BROIS	213.460	0,02
BRL	19.142.113	02/01/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	6,77%	1D BROIS	195.529	0,02
CZK	144.448.883	10/02/2026	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,32%	6M PRIBOR	176.660	0,02
COP	4.932.951.935	08/07/2030	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	4,21%	1D COOVIBR	145.669	0,01
BRL	14.122.450	02/01/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	6,61%	1D BROIS	132.289	0,01
BRL	16.821.418	02/01/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	6,23%	1D BROIS	120.619	0,01
BRL	21.400.254	02/01/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,66%	1D BROIS	103.392	0,01
COP	5.065.705.838	16/03/2031	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	4,88%	1D COOVIBR	95.932	0,01
BRL	132.894.702	02/01/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	6,23%	1D BROIS	80.834	0,01
BRL	1.006.291	02/01/2023	Goldman Sachs International	(Pagar)	10,84%	1D BROIS	79.793	0,01
BRL	36.501.186	02/01/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,25%	1D BROIS	71.537	0,01
MXN	32.793.698	20/04/2027	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	7,51%	28D MXIBTIE	67.774	0,01
COP	3.586.027.631	23/04/2030	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	4,98%	1D COOVIBR	50.576	0,01
MXN	71.272.015	23/06/2022	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	6,75%	28D MXIBTIE	42.990	0,00
CLP	1.985.896.996	10/05/2022	JPMorgan Chase Bank	(Pagar)	3,43%	1D CLICP	42.487	0,00
CZK	180.497.486	13/05/2026	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,81%	6M PRIBOR	36.301	0,00
COP	6.822.651.000	11/03/2030	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	5,47%	1D COOVIBR	31.326	0,00
BRL	10.774.288	02/01/2025	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	6,82%	1D BROIS	30.039	0,00
COP	6.000.000.000	21/06/2029	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	5,37%	1D COOVIBR	29.318	0,00
BRL	4.858.219	02/01/2024	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	6,50%	1D BROIS	22.335	0,00
PLN	6.544.720	16/03/2026	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,13%	6M WIBOR	20.618	0,00
PLN	15.316.328	26/02/2030	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	1,75%	6M WIBOR	18.726	0,00
CZK	94.735.803	13/05/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	1,88%	6M PRIBOR	18.131	0,00
CZK	299.610.265	18/06/2024	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,70%	6M PRIBOR	15.052	0,00
COP	2.908.271.239	12/03/2030	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	5,45%	1D COOVIBR	14.458	0,00
PLN	3.640.719	18/05/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	1,91%	6M WIBOR	13.980	0,00
BRL	36.251.861	02/01/2025	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	7,73%	1D BROIS	9.363	0,00
MXN	59.914.381	12/09/2022	Goldman Sachs International	(Pagar)	5,90%	28D MXIBTIE	7.538	0,00
PLN	118.040.426	02/07/2023	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	1,17%	3M WIBOR	2.296	0,00
MXN	61.129.403	01/04/2025	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	6,45%	28D MXIBTIE	2.249	0,00
KRW	4.500.000.000	05/02/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,40%	3M KORIBOR	121	0,00
KRW	4.600.000.000	19/02/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,50%	3M KORIBOR	91	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de swap de tipos de interés[∞]							3.763.118	0,33

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de swap de tipos de interés 0,33% (31 de diciembre de 2020: 1,21%) (cont.)

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

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

¹Swap liquidada centralmente.

	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	1.161.442.674	102,66

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (2,08%) (31 de diciembre de 2020: (0,64%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patri- monio neto
254.954.378 BRL	50.968.449 USD	02/07/2021	Citibank NA	1	(158.964)	(0,01)
254.954.378 BRL	51.774.009 USD	03/08/2021	Citibank NA	1	(1.137.488)	(0,10)
20.558.505 BRL	4.109.893 USD	02/07/2021	Goldman Sachs International	1	(12.818)	(0,00)
14.768.154.736 CLP	20.571.256 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(329.746)	(0,03)
3.399.817.696 CLP	4.750.007 USD	15/09/2021	HSBC Bank Plc	1	(90.153)	(0,01)
8.129.214 CNY	1.267.648 USD	09/07/2021	Barclays Bank Plc	1	(10.103)	(0,00)
25.019.465 CNY	3.917.551 USD	09/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(47.175)	(0,01)
29.829.166.957 COP	8.072.846 USD	23/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(92.712)	(0,01)
104.199.668 CZK	4.092.785 €	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(19.473)	(0,00)
2.416.500 €	2.874.993 USD	06/07/2021	Barclays Bank Plc	1	(9.023)	(0,00)
1.530.365 €	7.582.275 RON	06/10/2021	BNP Paribas	1	(88)	(0,00)
1.093.047 €	385.411.056 HUF	15/09/2021	Brown Brothers Harriman	1	(2.074)	(0,00)
5.767.967 €	7.017.649 USD	06/07/2021	Brown Brothers Harriman	1	(176.838)	(0,02)
8.368.406 €	10.146.744 USD	06/07/2021	Citibank NA	2	(221.811)	(0,02)
6.566.926 €	7.878.720 USD	06/10/2021	Deutsche Bank AG	1	(74.914)	(0,01)
2.138.450 €	2.617.986 USD	04/08/2021	Deutsche Bank AG	1	(80.230)	(0,01)
16.098.876 €	72.703.038 PLN	07/07/2021	Goldman Sachs International	1	(4.167)	(0,00)
19.668.015 €	89.472.161 PLN	06/07/2021	Goldman Sachs International	4	(176.355)	(0,02)
3.130.670 €	1.109.571.987 HUF	15/09/2021	HSBC Bank Plc	2	(25.140)	(0,00)
10.269.609 €	46.637.991 PLN	30/09/2021	HSBC Bank Plc	3	(51.781)	(0,01)
19.559.701 €	89.109.248 PLN	06/07/2021	HSBC Bank Plc	3	(209.485)	(0,02)
3.446.488 €	17.082.689 RON	06/10/2021	HSBC Bank Plc	1	(1.847)	(0,00)
797.092 €	3.667.667 PLN	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(18.075)	(0,00)
1.208.978 €	1.440.292 USD	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(6.443)	(0,00)
24.878.708 €	29.637.568 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(113.341)	(0,01)
2.977.286 €	13.488.695 PLN	30/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(6.543)	(0,00)

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (2,08%) (31 de diciembre de 2020: (0,64%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
928.748 €	4.206.711 PLN	06/07/2021	Morgan Stanley	1	(3.528)	(0,00)
2.416.500 €	2.877.724 USD	06/07/2021	Société Générale	1	(11.754)	(0,00)
1.816.219 €	2.213.183 USD	04/08/2021	Standard Chartered Bank	1	(57.827)	(0,01)
6.169.848 €	7.539.127 USD	06/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(221.684)	(0,02)
17.201.320 €	21.057.744 USD	06/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(656.971)	(0,06)
10.558.078 €	12.653.059 USD	27/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(109.067)	(0,01)
3.535.094.227 HUF	10.113.560 €	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(85.305)	(0,01)
115.476.318.447 IDR	7.961.803 USD	27/07/2021	BNP Paribas	1	(41.377)	(0,00)
76.193.568.139 IDR	5.244.775 USD	19/08/2021	BNP Paribas	1	(34.616)	(0,00)
66.280.070.748 IDR	4.569.621 USD	19/08/2021	HSBC Bank Plc	1	(37.353)	(0,00)
67.368.324.033 IDR	4.700.225 USD	19/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(93.541)	(0,01)
48.519.481.614 IDR	3.372.922 USD	27/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(45.010)	(0,00)
106.064.864.246 IDR	7.369.391 USD	19/08/2021	Standard Chartered Bank	2	(116.617)	(0,01)
4.194.842 ILS	1.293.020 USD	10/09/2021	Standard Chartered Bank	1	(4.629)	(0,00)
8.929.707.872 KRW	8.039.278 USD	09/07/2021	Citibank NA	1	(136.741)	(0,01)
4.468.047.639 KRW	4.004.668 USD	16/07/2021	HSBC Bank Plc	1	(50.701)	(0,01)
7.912.338.983 KRW	7.006.038 USD	21/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(4.232)	(0,00)
45.906.700 MXN	2.288.868 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(5.351)	(0,00)
102.009.812 MXN	5.097.383 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	2	(23.152)	(0,00)
16.570.189 MYR	4.005.005 USD	03/09/2021	Goldman Sachs International	2	(26.283)	(0,00)
20.566.477 MYR	4.964.510 USD	03/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(26.225)	(0,00)
45.175.663 MYR	10.946.856 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(88.352)	(0,01)
47.243.664 MYR	11.461.662 USD	15/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(95.383)	(0,01)
15.286.319 PEN	4.058.494 USD	16/07/2021	Citibank NA	1	(65.203)	(0,01)
1.837.979 PEN	509.734 USD	16/07/2021	Goldman Sachs International	1	(29.593)	(0,00)
159.508.734 PHP	3.261.937 USD	26/07/2021	HSBC Bank Plc	1	(2.864)	(0,00)
159.812.420 PHP	3.272.833 USD	26/07/2021	Morgan Stanley	1	(7.555)	(0,00)
30.848.751 PLN	6.905.390 €	07/07/2021	Citibank NA	1	(86.529)	(0,01)
8.965.016 PLN	1.997.958 €	07/07/2021	Goldman Sachs International	1	(14.673)	(0,00)
50.821.018 PLN	11.357.832 €	30/09/2021	Goldman Sachs International	2	(142.151)	(0,01)
27.534.800 PLN	6.166.912 €	07/07/2021	Morgan Stanley	1	(81.194)	(0,01)
7.415.512 RON	1.497.086 €	06/10/2021	Goldman Sachs International	1	(365)	(0,00)
35.509.043 RON	7.006.449 €	30/06/2022	HSBC Bank Plc	2	(985)	(0,00)
133.098.127 RUB	1.833.515 USD	16/07/2021	Citibank NA	1	(15.068)	(0,00)
161.631.312 RUB	2.233.904 USD	16/07/2021	Goldman Sachs International	1	(25.624)	(0,00)
10.566.025 SGD	7.981.808 USD	12/07/2021	Goldman Sachs International	1	(121.528)	(0,01)
68.303.368 THB	2.147.763 USD	01/07/2021	Barclays Bank Plc	1	(16.612)	(0,00)
11.738.870 THB	376.728 USD	01/07/2021	Citibank NA	1	(10.460)	(0,00)

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (2,08%) (31 de diciembre de 2020: (0,64%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
319.630.824 THB	10.173.507 USD	01/07/2021	Goldman Sachs International	4	(200.626)	(0,02)
103.950.545 THB	3.261.705 USD	01/07/2021	HSBC Bank Plc	1	(18.318)	(0,00)
103.821.721 THB	3.252.244 USD	01/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(12.877)	(0,00)
106.314.144 TWD	3.852.311 USD	09/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(41.904)	(0,00)
127.326.163 UAH	4.462.887 USD	16/12/2021	Goldman Sachs International	1	(23.289)	(0,00)
1.858.170 USD	1.407.986.115 CLP	15/09/2021	BNP Paribas	1	(71.642)	(0,01)
3.490.402 USD	70.620.764 MXN	15/09/2021	BNP Paribas	1	(22.457)	(0,00)
1.525.402 USD	114.558.939 INR	16/09/2021	BNP Paribas	1	(1.207)	(0,00)
1.665.359 USD	6.941.717 MYR	03/09/2021	Brown Brothers Harriman	1	(1.440)	(0,00)
1.928.595 USD	146.594.458 RUB	16/07/2021	Citibank NA	1	(74.245)	(0,01)
12.422.121 USD	182.930.636.264 IDR	27/07/2021	Citibank NA	1	(124.942)	(0,01)
1.832.899 USD	1.349.948.102 CLP	15/09/2021	Citibank NA	1	(17.366)	(0,00)
2.167.452 USD	2.454.748.299 KRW	21/07/2021	Citibank NA	1	(4.809)	(0,00)
2.969.687 USD	11.141.017.897 COP	15/09/2021	Citibank NA	1	(1.319)	(0,00)
2.954.972 USD	61.591.855 MXN	15/09/2021	Citibank NA	1	(108.766)	(0,01)
7.147.326 USD	36.973.261 BRL	02/09/2021	Citibank NA	2	(165.795)	(0,02)
3.327.981 USD	21.564.206 CNY	09/07/2021	Citibank NA	1	(7.886)	(0,00)
1.980.385 USD	146.248.432 RUB	16/07/2021	Deutsche Bank AG	1	(17.728)	(0,00)
3.589.933 USD	4.826.847 SGD	26/07/2021	Goldman Sachs International	1	(726)	(0,00)
1.452.347 USD	1.060.147.563 CLP	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(711)	(0,00)
1.312.474 USD	11.965.204 TRY	22/09/2021	Goldman Sachs International	1	(7.786)	(0,00)
8.217.057 USD	119.126.116 ZAR	01/10/2021	Goldman Sachs International	1	(26.362)	(0,00)
4.166.547 USD	22.005.200 BRL	23/07/2021	Goldman Sachs International	1	(209.214)	(0,02)
3.615.166 USD	75.334.173 MXN	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(132.151)	(0,01)
3.906.679 USD	20.558.505 BRL	02/07/2021	Goldman Sachs International	1	(190.396)	(0,02)
10.166.525 USD	51.853.614 BRL	02/09/2021	Goldman Sachs International	2	(89.853)	(0,01)
2.523.494 USD	52.107.763 MXN	15/09/2021	HSBC Bank Plc	1	(68.481)	(0,01)
2.799.139 USD	18.184.824 CNY	09/07/2021	HSBC Bank Plc	2	(13.955)	(0,00)
1.016.196 USD	9.345.733 TRY	22/09/2021	HSBC Bank Plc	1	(15.027)	(0,00)
1.027.642 USD	15.038.755 ZAR	06/07/2021	HSBC Bank Plc	1	(25.055)	(0,00)
3.791.267 USD	12.358.998 ILS	10/09/2021	HSBC Bank Plc	2	(4.637)	(0,00)
2.323.415 USD	2.638.821.536 KRW	21/07/2021	HSBC Bank Plc	2	(11.737)	(0,00)
1.812.168 USD	6.877.523.554 COP	15/09/2021	HSBC Bank Plc	1	(21.879)	(0,00)
13.964.616 USD	203.085.262 ZAR	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(251.146)	(0,02)
3.105.043 USD	11.827.110.218 COP	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(48.924)	(0,01)
3.045.599 USD	20.073.652 CNY	09/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(59.686)	(0,01)
7.351.213 USD	540.130.376 RUB	16/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(28.293)	(0,00)
1.178.746 USD	32.368.371 UAH	22/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(205)	(0,00)

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (2,08%) (31 de diciembre de 2020: (0,64%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
2.430.366 USD	49.382.875 MXN	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(26.065)	(0,00)
2.248.628 USD	14.535.808 CNY	02/07/2021	Morgan Stanley	1	(1.201)	(0,00)
1.157.678 USD	497.454.354 KZT	14/07/2021	Morgan Stanley	1	(4.562)	(0,00)
1.933.779 USD	8.062.310 MYR	15/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(5.920)	(0,00)
3.585.376 USD	4.826.848 SGD	26/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(5.284)	(0,00)
3.929.274 USD	299.064.918 INR	09/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(90.686)	(0,01)
3.563.048 USD	99.300.358 TWD	26/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(1.170)	(0,00)
12.205.645 USD	245.931.029 MXN	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(27.600)	(0,00)
6.135.086 USD	31.088.154 BRL	02/09/2021	UBS AG	1	(13.992)	(0,00)
185.959.933 ZAR	13.231.673 USD	06/07/2021	Citibank NA	4	(214.667)	(0,02)
100.730.959 ZAR	7.425.355 USD	06/07/2021	Goldman Sachs International	1	(374.290)	(0,03)
41.947.181 ZAR	2.957.307 USD	06/07/2021	HSBC Bank Plc	1	(21.046)	(0,00)
Clases AUD con cobertura						
5.532.176 AUD	4.295.315 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(140.691)	(0,01)
57.540 AUD	44.755 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(1.553)	(0,00)
104.890 AUD	80.752 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	6	(2.000)	(0,00)
50.299 AUD	38.813 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	(1.039)	(0,00)
365.441 USD	488.199 AUD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	(1.193)	(0,00)
Clases EUR con cobertura						
200.972 €	240.514 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(1.804)	(0,00)
5.592.309 €	6.786.066 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(151.759)	(0,01)
5.194.780 €	6.260.977 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(98.270)	(0,01)
433.110.115 €	527.537.648 USD	15/09/2021	UBS AG	2	(13.100.102)	(1,16)
14.155.194 €	17.103.534 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	63	(310.844)	(0,03)
880.984 €	1.069.979 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	8	(23.568)	(0,00)
9.641.439 USD	8.118.142 €	15/09/2021	Westpac Banking Corp	2	(1.091)	(0,00)
Clases GBP con cobertura						
22.612 £	31.591 USD	15/09/2021	Citibank NA	2	(349)	(0,00)
589.986 £	823.056 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(7.979)	(0,00)
24.041.747 £	34.048.066 USD	15/09/2021	UBS AG	2	(829.947)	(0,07)
2.387.898 £	3.379.023 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	43	(80.098)	(0,01)
351.116 £	491.307 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	15	(6.177)	(0,00)
221 USD	161 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	(1)	(0,00)
Clases NOK con cobertura						
4.535.927 NOK	547.096 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	2	(19.819)	(0,00)
Clases SEK con cobertura						
192.443 SEK	23.287 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(781)	(0,00)
39.353.941 SEK	4.763.313 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(158.394)	(0,02)

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (2,08%) (31 de diciembre de 2020: (0,64%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases SEK con cobertura (cont.)						
1.412.873 SEK	168.530 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	19	(3.295)	(0,00)
89.776 SEK	10.544 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	3	(40)	(0,00)
8.793 USD	75.312 SEK	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	(15)	(0,00)
Clases SGD con cobertura						
815 SGD	616 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(9)	(0,00)
4.989 SGD	3.749 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	10	(37)	(0,00)
351.726 SGD	265.862 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	2	(4.250)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					(23.527.318)	(2,08)

Contratos de futuros (0,10%) (31 de diciembre de 2020: (0,02%))

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(40)	Euro-BOBL Future September 2021	(8.064)	(0,00)
(186)	Euro-Bund Future September 2021	(277.311)	(0,02)
(42)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2021	(176.319)	(0,02)
(212)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2021	(116.108)	(0,01)
43	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future September 2021	(15.117)	(0,00)
117	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2021	(29.883)	(0,00)
(102)	US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2021	(509.672)	(0,05)
Minusvalía latente total sobre contratos de futuros ±		(1.132.474)	(0,10)

Contratos de swaps de tipos de interés (0,56%) (31 de diciembre de 2020: (0,37%))

Importe notional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/ (Pagar)#	Tipo fijo	Tipo variable	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto	
CNY	34.000.000	01/07/2026	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	2,78%	7D CNRR007	(57)	(0,00)
INR	900.000.000	30/05/2023	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	4,50%	1D MIBOR	(643)	(0,00)
THB	265.000.000	01/03/2026	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,00%	6M BKIBOR	(679)	(0,00)
INR	3.000.000.000	07/02/2023	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	4,42%	1D MIBOR	(920)	(0,00)
MXN	8.944.028	21/05/2025	Goldman Sachs International	(Pagar)	6,36%	28D MXIBTIIE	(1.151)	(0,00)
THB	250.000.000	10/03/2026	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,10%	6M BKIBOR	(1.797)	(0,00)
PLN	26.666.517	02/07/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	2,12%	6M WIBOR	(4.436)	(0,00)
MXN	9.645.130	08/12/2025	Goldman Sachs International	(Pagar)	6,21%	28D MXIBTIIE	(5.979)	(0,00)
BRL	11.509.662	02/01/2025	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	6,46%	1D BROIS	(6.581)	(0,00)
BRL	75.470.037	02/01/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	6,97%	1D BROIS	(7.777)	(0,00)
COP	3.040.633.926	15/05/2029	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	5,93%	1D COOVIBR	(15.557)	(0,00)
RUB	500.000.000	06/12/2021	JPMorgan Chase Bank	(Pagar)	6,38%	3M MOSPRIME	(17.680)	(0,00)
MXN	144.900.054	31/08/2029	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	6,92%	28D MXIBTIIE	(21.058)	(0,00)
COP	5.209.366.074	15/05/2029	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	5,92%	1D COOVIBR	(25.293)	(0,00)
XN	37.080.494	05/03/2026	Goldman Sachs International	(Pagar)	6,17%	28D MXIBTIIE	(29.954)	(0,00)

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de swap de tipos de interés (0,56%) (31 de diciembre de 2020: (0,37%)) (cont.)

	Importe nocional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar)#	Tipo fijo	Tipo variable	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
MXN	60.000.000	16/09/2026	Goldman Sachs International	(Pagar)	6,38%	28D MXIBTIIE	(33.207)	(0,00)
CLP	7.794.281.686	12/12/2021	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	1,96%	1D CLICP	(41.231)	(0,00)
MXN	47.500.000	18/06/2026	JPMorgan Chase Bank	(Pagar)	6,13%	28D MXIBTIIE	(47.698)	(0,01)
BRL	67.978.000	03/01/2022	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	2,99%	1D BROIS	(82.614)	(0,01)
BRL	52.698.654	03/01/2022	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	2,89%	1D BROIS	(83.169)	(0,01)
RUB	1.900.000.000	14/12/2021	Goldman Sachs International	(Pagar)	6,29%	3M MOSPRIME	(95.834)	(0,01)
BRL	19.044.356	02/01/2024	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,72%	1D BROIS	(97.202)	(0,01)
BRL	29.000.000	04/01/2027	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	7,67%	1D BROIS	(108.338)	(0,01)
ZAR	50.897.013	28/02/2030	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	7,54%	3M JIBA3M	(108.641)	(0,01)
MXN	37.351.999	25/06/2025	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	4,85%	28D MXIBTIIE	(108.808)	(0,01)
CLP	1.254.313.506	23/01/2030	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	3,06%	1D CLICP	(132.831)	(0,01)
CLP	2.375.994.701	12/04/2026	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	2,48%	1D CLICP	(135.560)	(0,01)
MXN	87.839.103	06/04/2026	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,82%	28D MXIBTIIE	(138.286)	(0,01)
BRL	17.905.968	01/07/2024	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,92%	1D BROIS	(145.851)	(0,01)
BRL	14.656.887	02/01/2024	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	4,99%	1D BROIS	(149.137)	(0,01)
CZK	190.500.000	12/11/2030	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	1,40%	6M PRIBOR	(152.986)	(0,01)
CZK	190.437.025	13/11/2030	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	1,38%	6M PRIBOR	(158.704)	(0,02)
BRL	38.138.865	02/01/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	4,02%	1D BROIS	(223.432)	(0,02)
CLP	2.304.271.979	12/01/2026	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	1,63%	1D CLICP	(232.346)	(0,02)
BRL	80.387.623	02/01/2024	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,56%	1D BROIS	(235.349)	(0,02)
RUB	2.016.290.234	02/04/2023	Goldman Sachs International	(Pagar)	7,07%	3M MOSPRIME	(258.581)	(0,02)
MXN	485.634.477	19/06/2024	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,47%	28D MXIBTIIE	(281.098)	(0,03)
CLP	1.377.149.008	24/08/2030	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	2,15%	1D CLICP	(303.959)	(0,03)
MXN	481.971.075	22/02/2024	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,15%	28D MXIBTIIE	(341.840)	(0,03)
PLN	52.888.820	25/03/2024	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,99%	6M WIBO	(353.298)	(0,03)
MXN	465.969.180	22/11/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,01%	28D MXIBTIIE	(358.306)	(0,03)
CLP	5.863.427.735	17/06/2025	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	1,36%	1D CLICP	(556.308)	(0,05)
CLP	5.919.362.976	23/06/2025	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	1,16%	1D CLICP	(627.863)	(0,06)
BRL	68.736.587	02/01/2024	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	4,84%	1D BROIS	(640.197)	(0,06)
Minusvalía latente total sobre contratos de swap de tipos de interés[∞]							(6.372.236)	(0,56)

Recibir – El fondo recibe un tipo variable y paga un tipo fijo.

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

Swap liquidado centralmente.

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(31.032.028)	(2,74)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	1.130.410.646	99,92
Otro activo neto	934.361	0,08
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	1.131.345.007	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	861.352.818	68,50
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	253.850.779	20,19
† Otros valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario	8.796.377	0,70
μ Fondos de inversión	16.720.213	1,33
± Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	(662.577)	(0,05)
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(9.646.964)	(0,77)
Total inversiones	1.130.410.646	89,90

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
6.419.076.800	Mexico Cetes, 0.00%, 29/07/2021	31.771.621
4.961.496.000	Mexico Cetes, 0.00%, 20/05/2021	23.681.466
254.000.000.000	Indonesia Treasury Bond, 5.50%, 15/04/2026	17.835.409
309.112.043	Republic of South Africa Government Bond, 8.50%, 31/01/2037	17.347.992
54.469.193	Bank of Israel Bill - Makam, 0.00%, 02/09/2021	16.802.565
53.463.953	Bank of Israel Bill - Makam, 0.00%, 02/06/2021	16.217.953
1.204.917.000	Russian Federal Bond - OFZ, 4.50%, 16/07/2025	15.164.187
274.110.000	Mexican Bonos, 7.75%, 23/11/2034	14.701.910
952.229.000	Russian Federal Bond - OFZ, 6.90%, 23/05/2029	12.989.127
3.272.030.000	Hungary Government Bond, 3.25%, 22/10/2031	12.567.884
3.714.950.000	Hungary Government Bond, 2.25%, 20/04/2033	11.882.761
94.495.625	Turkey Government Bond, 11.70%, 13/11/2030	10.608.768
312.100.000	Thailand Government Bond, 2.00%, 17/12/2031	10.112.551
666.469.817	Russian Federal Inflation Linked Bond, 2.50%, 17/07/2030	9.140.882
164.760.000	Czech Republic Government Bond, 2.40%, 17/09/2025	7.986.730
129.740.000	Mexican Bonos, 10.00%, 05/12/2024	7.519.994
107.634.855	Republic of South Africa Government Bond, 8.88%, 28/02/2035	6.808.215
484.081.000	Russian Federal Bond - OFZ, 7.25%, 10/05/2034	6.759.127
61.627.000	Turkey Government Bond, 12.60%, 01/10/2025	6.050.973
107.553.307	Republic of South Africa Government Bond, 9.00%, 31/01/2040	5.938.652

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

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
59.437.000	Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2026	17.079.781
1.143.299.000	Russian Federal Bond - OFZ, 7.25%, 10/05/2034	15.936.227
327.233.000	Petroleos Mexicanos, 7.47%, 12/11/2026	14.524.156
252.815.977	Republic of South Africa Government Bond, 8.75%, 28/02/2048	14.123.505
183.000.000.000	Indonesia Treasury Bond, 5.50%, 15/04/2026	12.833.764
3.410.390.000	Hungary Government Bond, 3.25%, 22/10/2031	12.709.577
3.714.950.000	Hungary Government Bond, 2.25%, 20/04/2033	12.022.710
34.211.000	Republic of Poland Government Bond, 2.75%, 25/10/2029	10.509.819
94.495.625	Turkey Government Bond, 11.70%, 13/11/2030	9.904.952
167.730.000	Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031	9.397.532
63.000.000	China Government Bond, 2.68%, 21/05/2030	9.292.960
124.600.000.000	Indonesia Treasury Bond, 7.50%, 15/04/2040	8.938.010
135.063.380	Republic of South Africa Government Bond, 9.00%, 31/01/2040	8.605.209
63.692.328	Turkey Government Bond, 12.20%, 18/01/2023	8.424.166
189.070.000	Czech Republic Government Bond, 0.95%, 15/05/2030	8.337.634
6.920.000	Southern Gas Corridor CJSC, 6.88%, 24/03/2026	8.324.408
31.220.000	Malaysia Government Bond, 3.89%, 15/08/2029	8.051.265
112.650.000.000	Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/09/2030	8.050.486
249.000.000	Thailand Government Bond, 2.00%, 17/12/2031	8.050.071
51.000.000	China Government Bond, 3.12%, 05/12/2026	7.948.451
565.838.000	Russian Federal Bond - OFZ, 6.90%, 23/05/2029	7.732.174

Neuberger Berman European High Yield Bond Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I EUR en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 3,43%. Durante el mismo periodo, el ICE BofA European Currency Non-Financial High Yield 3% Constrained Index (Total Return, EUR) (el "Índice") se anotó una rentabilidad del 2,90%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

En general, el tono del mercado en el segundo trimestre fue similar al observado en los primeros tres meses de 2021, en concreto un tono dominado por el optimismo cauto mientras los países europeos avanzaban en sus campañas de vacunación y procedían a una reapertura, lenta aunque progresiva, de sus economías. Los datos económicos fueron heterogéneos y las cuentas posicionadas en gran medida para beneficiarse de la reapertura se abstuvieron por lo general de aumentar el nivel de riesgo. En esta coyuntura, el riesgo idiosincrásico jugó un papel generalmente secundario en el panorama macroeconómico. A pesar de esta evolución positiva del entorno económico, el Banco Central Europeo ("BCE") reiteró su intención de mantener una política monetaria acomodaticia y también su confianza en el carácter transitorio del aumento de la inflación. Los diferenciales de crédito, que se habían ampliado al comienzo de la pandemia el pasado año, experimentaron una contracción significativa durante el periodo analizado. El mercado de alta rentabilidad también se caracterizó por la dispersión de rentabilidades entre las diferentes calidades crediticias durante el periodo. A pesar de que la parte del mercado que atravesó dificultades experimentó un fuerte repunte partiendo de unos niveles muy bajos, muchos de los emisores perjudicados a más largo plazo y que afrontan desafíos seculares todavía no satisfacen nuestros estrictos estándares de suscripción de crédito. Por otra parte, desde la perspectiva de la selección de títulos de crédito individuales, encontramos oportunidades de inversión atractivas en el segmento del crédito de la región y en el universo de alta rentabilidad europeo.

La cifra de emisiones nuevas ha sido muy elevada en el primer semestre, dado que los emisores trataron de refinanciar a rentabilidades más bajas. En lo que va de año, el volumen de emisiones nuevas de deuda de alta rentabilidad no denominada en USD alcanzó el equivalente a 86.900 millones de dólares estadounidenses, lo que contrasta con los 43.500 millones del mismo periodo de 2020. Para poner esto en contexto, cabe señalar que el volumen de emisiones nuevas no denominadas en USD alcanzó en total el equivalente a 100.500 millones de dólares estadounidenses en el conjunto del ejercicio 2020.

Habida cuenta de la creciente proporción de mejora de las calificaciones y del descenso de las rebajas de calificación, prevemos que las tasas de impago de las emisiones del mercado de alta rentabilidad seguirán moderándose respecto de los niveles actuales. Nuestras estimaciones para la tasa de impagos de 2021 ya apuntan solo a un 1%, lo que supone 230 pb menos que en 2020.

La Cartera batió a su Índice de referencia en el periodo analizado. Durante el periodo, la selección de valores y una infraponderación en servicios de asistencia, la selección de valores en automoción y componentes, así como una infraponderación y la selección de valores en telecomunicaciones realizaron la mayor contribución a la rentabilidad. Por contra, los mayores lastres para los resultados procedieron de una infraponderación del sector del acero, de la selección de valores en grandes superficies minoristas, así como de la selección de valores y una sobreponderación del sector de la energía. En lo que respecta a nuestro posicionamiento por calificaciones crediticias, lo que más benefició a la rentabilidad fue la sobreponderación a emisores con calificación CCC e inferior, la selección de valores en emisores con calificación B y BB y la infraponderación de emisores con calificación BB, así como la sobreponderación de emisores con calificación B, mientras que el principal lastre fue la selección de valores en emisores con calificación CCC e inferior.

Los diferenciales del mercado de alta rentabilidad europeo se han estrechado en lo que va de año, pero creemos que las valoraciones compensan a los inversores por unas perspectivas de impago cada vez más benignas. La recuperación económica sigue su curso y creemos que la evolución positiva del crecimiento y de la capacidad de fijación de precios favorecerá a los fundamentales de los emisores. El constante progreso de las campañas de vacunación, unido a la demanda acumulada de los consumidores en los segmentos de los viajes, el ocio y los servicios, la reposición de inventarios y contrataciones por parte de las empresas, así como un BCE paciente aunque vigilante deberían seguir favoreciendo a la actividad económica de cara al futuro. A pesar de que las nuevas variantes de la COVID-19 y la preocupación por la inflación dan lugar a episodios de volatilidad a corto plazo, creemos que nuestro análisis fundamental del crédito, con un enfoque bottom-up y centrado en la selección de títulos individuales, al tiempo que trata de evitar el deterioro del crédito y de incluir solo nuestras "mejores ideas" en las carteras, nos permite estar bien posicionados para aprovechar cualquier volatilidad.

Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 EUR	A 31 de diciembre de 2020 EUR
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		31.752.023	32.344.204
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	981.905	1.228.819
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		539.524	325.894
Cuentas a percibir por acciones emitidas		–	619
Ingresos a percibir y otros activos		462.431	471.011
Activos totales		33.735.883	34.370.547
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		207.571	1.491.943
Descubierto bancario	3	530	394
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		4.820	–
Gastos devengados		34.364	31.518
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		663.000	3
Otras cuentas por pagar		36.694	22.353
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		946.979	1.546.211
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		32.788.904	32.824.336

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 EUR	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 EUR
Ingresos			
Ingresos por intereses		739.157	715.958
Ingresos por préstamo de valores	15	2.931	–
Ingresos varios		–	27
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		1.446.094	(2.708.073)
		2.188.182	(1.992.088)
Gastos			
Comisión de gestión	5	45.419	105.441
Comisión de distribución	5	2.124	2.714
Comisión de administración	5	49.848	70.573
Comisión de compromiso	16	2.389	1.876
Comisión de depósito	5	4.981	6.377
Comisión del Depositario	5	804	1.661
Honorarios profesionales	7	38.335	22.172
Honorarios de los Consejeros	6	2.128	2.150
Costes de transacciones	7	13.532	23.063
Honorarios de auditoría	7	8.554	10.163
Reembolso de IVA		(154)	(108)
Otros gastos	7	4.318	6.965
Gastos no asumidos	5	(90.036)	(108.794)
Gastos totales		82.242	144.253
Costes financieros			
Gastos por intereses		1	9
Repartos de dividendos abonados	1	33.229	18.789
		33.230	18.798
Impuestos retenidos en origen		–	1.247
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		2.072.710	(2.156.386)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	EUR	EUR
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	32.824.336	39.837.504
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	2.072.710	(2.156.386)
Suscripciones	1.630.863	15.472.975
Reembolsos	(3.739.005)	(22.474.953)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	32.788.904	30.679.140

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Importe principal	Descripción de los valores	Cupón	Fecha de vencimiento	Valor razonable EUR	% del Patrimonio neto
Valores respaldados por activos 1,28% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)					
Dólar estadounidense					
250.000	Ares XXVII CLO Ltd Series 2013-2X Class E	6,68%	28/07/2029	208.966	0,64
250.000	Flatiron CLO 17 Ltd Series 2017-1X Class E	6,06%	15/05/2030	210.798	0,64
Total valores respaldados por activos **				419.764	1,28
Bonos de empresa 93,38% (31 de diciembre de 2020: 93,74%)					
Euro					
100.000	Abertis Infraestructuras Finance BV*	3,25%	29/12/2049	103.622	0,32
700.000	Accor SA*	2,63%	29/12/2049	686.900	2,09
100.000	Adevinta ASA*	3,00%	15/11/2027	103.936	0,32
100.000	Aedas Homes Opco SLU*	4,00%	15/08/2026	102.498	0,31
100.000	Afflelou SAS*	4,25%	19/05/2026	102.303	0,31
300.000	Altice Finco SA*	4,75%	15/01/2028	293.920	0,90
149.000	Altice France Holding SA*	4,00%	15/02/2028	143.506	0,44
300.000	Altice France Holding SA*	8,00%	15/05/2027	324.216	0,99
100.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc*	3,00%	01/09/2029	99.990	0,30
200.000	Ashland Services BV**	2,00%	30/01/2028	203.220	0,62
301.000	Autostrade per l'Italia SpA*	1,88%	26/09/2029	311.234	0,95
200.000	Avis Budget Finance Plc**	4,75%	30/01/2026	204.875	0,62
493.000	Banjay Group SAS**	6,50%	01/03/2026	510.193	1,56
317.000	BK LC Lux Finco1 Sarl*	5,25%	30/04/2029	325.020	0,99
431.000	Bormioli Pharma SpA*	3,50%	15/11/2024	429.868	1,31
107.000	Brunello Bidco SpA*	3,50%	15/02/2028	107.206	0,33
236.000	Carnival Corp*	7,63%	01/03/2026	261.910	0,80
200.000	Carnival Corp**	10,13%	01/02/2026	233.754	0,71
120.000	Casino Guichard Perrachon SA*	1,08%	29/12/2049	54.150	0,17
547.000	Casino Guichard Perrachon SA*	6,63%	15/01/2026	579.136	1,77
114.000	Cedacri Mergeco SpA*	4,63%	15/05/2028	115.710	0,35
215.000	Centurion Bidco SpA*	5,88%	30/09/2026	225.141	0,69
130.000	Chrome Holdco SASU*	5,00%	31/05/2029	133.421	0,41
440.000	CMA CGM SA*	7,50%	15/01/2026	490.486	1,50
212.000	Constellium SE*	3,13%	15/07/2029	211.046	0,64
139.000	CPI Property Group SA*	4,88%	29/12/2049	147.184	0,45
100.000	Diamond BC BV**	5,63%	15/08/2025	101.930	0,31
136.000	doValue SpA**	5,00%	04/08/2025	142.740	0,44
185.000	Dufry One BV**	2,00%	15/02/2027	174.826	0,53
100.000	Dufry One BV*	3,38%	15/04/2028	99.500	0,30
100.000	eG Global Finance Plc*	4,38%	07/02/2025	98.901	0,30
249.000	eG Global Finance Plc*	6,25%	30/10/2025	255.704	0,78

Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (cont.)

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 EUR	% del Patrimonio neto
Bonos de empresa 93,38% (31 de diciembre de 2020: 93,74%) (cont.)					
Euro (cont.)					
362.000	Encore Capital Group Inc*	4,88%	15/10/2025	383.352	1,17
140.000	Energizer Gamma Acquisition BV**	3,50%	30/06/2029	139.696	0,43
164.000	Foncia Management SASU**	3,38%	31/03/2028	163.447	0,50
100.000	Gruenthal GmbH*	3,63%	15/11/2026	102.992	0,31
100.000	Gruenthal GmbH**	4,13%	15/05/2028	103.290	0,32
273.000	Grupo Antolin-Irausa SA*	3,50%	30/04/2028	272.666	0,83
241.000	Guala Closures SpA*	3,25%	15/06/2028	242.127	0,74
100.000	House of Finance NV**	4,38%	15/07/2026	101.875	0,31
128.000	House of HR**	7,50%	15/01/2027	136.880	0,42
100.000	INEOS Quattro Finance 1 Plc*	3,75%	15/07/2026	103.069	0,31
100.000	Infinion Technologies AG*	3,63%	29/12/2049	110.154	0,34
125.000	International Design Group SpA*	4,25%	15/05/2026	126.238	0,38
418.000	Intrum AB*	3,00%	15/09/2027	414.545	1,26
150.000	IPD 3 BV*	5,50%	01/12/2025	156.480	0,48
100.000	IPD 3 BV REG S*	5,50%	01/12/2025	101.875	0,31
151.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	4,50%	15/01/2026	160.432	0,49
370.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	6,88%	15/11/2026	431.522	1,32
336.000	Kapla Holding SAS*	3,38%	15/12/2026	335.866	1,02
324.000	Kleopatra Holdings 2 SCA*	6,50%	01/09/2026	316.247	0,96
506.000	La Financiere Atalian SASU*	4,00%	15/05/2024	504.001	1,54
317.000	Laboratoire Eimer Selas**	5,00%	01/02/2029	323.791	0,99
400.000	LeasePlan Corp NV*	7,38%	29/12/2049	448.710	1,37
4.000	LHMC Finco 2 Sarl*	7,25%	02/10/2025	4.008	0,01
100.000	Lincoln Financing Sarl**	3,63%	01/04/2024	101.373	0,31
152.000	Loxam SAS*	5,75%	15/07/2027	158.745	0,48
467.000	Maxeda DIY Holding BV**	5,88%	01/10/2026	480.430	1,47
455.000	Modulaire Global Finance Plc**	6,50%	15/02/2023	465.740	1,42
420.000	Motion Bondco DAC*	4,50%	15/11/2027	411.338	1,25
315.000	NH Hotel Group SA*	4,00%	02/07/2026	315.275	0,96
450.000	Nidda BondCo GmbH**	5,00%	30/09/2025	452.869	1,38
252.000	Nobel Bidco BV**	3,13%	15/06/2028	252.504	0,77
144.000	Nomad Foods Bondco Plc*	2,50%	24/06/2028	145.530	0,44
234.000	Nouryon Holding BV*	6,50%	01/10/2026	245.273	0,75
100.000	Novelis Sheet Ingot GmbH*	3,38%	15/04/2029	102.782	0,31
304.000	Ontex Group NV*	3,50%	15/07/2026	303.992	0,93
162.000	Paprec Holding SA*	3,50%	31/03/2025	162.405	0,50
200.000	Paprec Holding SA*	4,00%	31/03/2025	204.125	0,62
318.000	Paysafe Finance Plc/Paysafe Holdings US Corp**	3,00%	15/06/2029	314.279	0,96

Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (cont.)

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 EUR	% del Patrimonio neto
Bonos de empresa 93,38% (31 de diciembre de 2020: 93,74%) (cont.)					
Euro (cont.)					
200.000	PCF GmbH*	4,75%	15/04/2026	204.547	0,62
480.000	Petroleos Mexicanos*	4,75%	26/02/2029	476.998	1,45
624.000	Petroleos Mexicanos*	4,88%	21/02/2028	634.504	1,94
118.000	Picard Bondco SA**	5,38%	01/07/2027	118.000	0,36
485.000	Platin 1426 GmbH**	5,38%	15/06/2023	489.377	1,49
154.000	Playtech Plc*	4,25%	07/03/2026	158.658	0,48
100.000	Renault SA*	2,00%	28/09/2026	99.796	0,30
226.000	Repsol International Finance BV*	4,25%	29/12/2049	249.173	0,76
156.000	Sappi Papier Holding GmbH*	3,63%	15/03/2028	156.405	0,48
622.000	Sazka Group AS**	3,88%	15/02/2027	630.273	1,92
200.000	Schaeffler AG*	3,38%	12/10/2028	220.931	0,67
100.000	Schoeller Packaging BV**	6,38%	01/11/2024	104.212	0,32
350.000	Scientific Games International Inc**	5,50%	15/02/2026	357.875	1,09
300.000	SGL Carbon SE*	4,63%	30/09/2024	307.180	0,94
356.000	Sofima Holding SpA*	3,75%	15/01/2028	358.412	1,09
100.000	SpA Holdings 3 Oy*	3,63%	04/02/2028	101.000	0,31
230.000	Summer BC Holdco B Sarl**	5,75%	31/10/2026	241.210	0,74
300.000	Summer BidCo BV**	9,00%	15/11/2025	307.075	0,94
100.000	Sunshine Mid BV*	6,50%	15/05/2026	103.643	0,32
100.000	Telefonica Europe BV*	2,88%	29/12/2049	102.864	0,31
200.000	Tendam Brands SAU*	5,25%	15/09/2024	198.747	0,61
370.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	1,63%	15/10/2028	327.471	1,00
627.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	1,88%	31/03/2027	576.807	1,76
194.000	TI Automotive Finance Plc**	3,75%	15/04/2029	198.163	0,60
255.000	United Group BV**	3,13%	15/02/2026	248.625	0,76
100.000	UPC Holding BV*	3,88%	15/06/2029	101.598	0,31
436.000	Verisure Midholding AB*	5,25%	15/02/2029	449.080	1,37
430.000	Vertical Holdco GmbH**	6,63%	15/07/2028	459.094	1,40
226.000	Victoria Plc*	3,63%	24/08/2026	229.504	0,70
100.000	Vivion Investments Sarl*	3,00%	08/08/2024	99.903	0,30
100.000	Vivion Investments Sarl*	3,50%	01/11/2025	101.720	0,31
400.000	Wintershall Dea Finance 2 BV*	3,00%	29/12/2049	394.600	1,20
500.000	ZF Europe Finance BV*	3,00%	23/10/2029	524.063	1,60
Total euro				26.009.477	79,32
Libra esterlina					
269.000	AA Bond Co Ltd*	6,50%	31/01/2026	326.251	1,00
100.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc*	4,75%	15/07/2027	118.787	0,36

Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (cont.)

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 EUR	% del Patrimonio neto
Bonos de empresa 93,38% (31 de diciembre de 2020: 93,74%) (cont.)					
Libra esterlina (cont.)					
319.000	Bellis Finco Plc**	4,00%	16/02/2027	372.531	1,14
200.000	CPUK Finance Ltd**	6,50%	28/08/2026	247.371	0,75
174.000	Deuce Finco Plc**	5,50%	15/06/2027	203.094	0,62
100.000	Encore Capital Group Inc*	5,38%	15/02/2026	123.150	0,38
120.000	Iceland Bondco Plc**	4,38%	15/05/2028	132.045	0,40
300.000	Iceland Bondco Plc*	4,63%	15/03/2025	344.882	1,05
100.000	National Express Group Plc*	4,25%	29/12/2049	121.298	0,37
100.000	Petrobras Global Finance BV*	5,38%	01/10/2029	128.359	0,39
362.000	Pinnacle Bidco Plc*	6,38%	15/02/2025	431.619	1,32
140.000	Premier Foods Finance Plc*	3,50%	15/10/2026	163.367	0,50
436.000	RAC Bond Co Plc*	5,00%	06/11/2022	508.901	1,55
670.000	Rolls-Royce Plc*	5,75%	15/10/2027	856.405	2,61
150.000	Virgin Media Secured Finance Plc*	4,25%	15/01/2030	174.568	0,53
300.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC**	4,88%	15/07/2028	355.803	1,09
Total libra esterlina				4.608.431	14,06
Total bonos de empresa				30.617.908	93,38
Préstamos a plazo 0,91% (31 de diciembre de 2020: 3,09%)					
Euro					
94.016	Aernnova Aerospace SAU Facility B1 Term Loan	3,00%	26/02/2027	90.593	0,28
24.107	Aernnova Aerospace SAU Facility B2 Term Loan	3,00%	26/02/2027	23.229	0,07
100.000	Rain Carbon Inc	3,00%	16/01/2025	99.209	0,30
Total euro				213.031	0,65
Libra esterlina					
74.743	BBD Bidco Ltd	4,81%	13/11/2026	86.920	0,26
Total libra esterlina				86.920	0,26
Total préstamos a plazo †				299.951	0,91
Total inversiones				31.337.623	95,57

Contratos de divisas a plazo 1,27% (31 de diciembre de 2020: 1,71%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto
101.241 £	116.970 €	19/07/2021	UBS AG	1	929	0,00
200.655 £	232.299 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	1.370	0,01
29.168 USD	24.337 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	250	0,00
Clases SGD con cobertura						
5.230 SGD	3.262 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	17	0,00
5.143 SGD	3.208 €	19/07/2021	UBS AG	1	17	0,00

Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 1,27% (31 de diciembre de 2020: 1,71%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto
SGD Hedged Classes (continued)						
122.205 SGD	76.272 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	17	359	0,00
Clases USD con cobertura						
15.891.070 USD	13.254.750 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	140.435	0,43
15.475.083 USD	12.913.281 €	19/07/2021	UBS AG	1	131.252	0,40
16.220.622 USD	13.533.205 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	24	139.771	0,43
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					414.400	1,27
					Valor razonable EUR	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados					31.752.023	96,84

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,64%) (31 de diciembre de 2020: (4,55%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto
5.088.819 €	4.422.800 £	19/07/2021	UBS AG	1	(61.685)	(0,19)
499.718 €	598.776 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(5.013)	(0,01)
161.925 €	139.628 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(676)	(0,00)
480.495 €	572.327 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(1.941)	(0,01)
Clases SGD con cobertura						
6.410 €	10.323 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	(63)	(0,00)
Clases USD con cobertura						
4.416.871 €	5.295.302 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(46.741)	(0,15)
4.418.699 €	5.295.302 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(44.912)	(0,14)
4.530.746 €	5.430.156 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	13	(46.537)	(0,14)
66.700 USD	56.227 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(3)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					(207.571)	(0,64)
					Valor razonable EUR	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados					(207.571)	(0,64)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados					31.544.452	96,20
Otro activo neto					1.244.452	3,80
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables					32.788.904	100,00

Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

Análisis de la cartera	EUR	% de los Activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	21.545.448	63,86
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	9.492.224	28,14
† Otros valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario	299.951	0,89
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	206.829	0,61
Total inversiones	31.544.452	93,50

Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste EUR
600.000	Wintershall Dea Finance 2 BV, 3.00%, 29/12/2049	595.725
547.000	Casino Guichard Perrachon SA, 6.63%, 15/01/2026	570.357
419.000	Bellis Finco Plc, 4.00%, 16/02/2027	482.862
436.000	Verisure Midholding AB, 5.25%, 15/02/2029	441.624
400.000	LeasePlan Corp NV, 7.38%, 29/12/2049	433.680
370.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc, 6.88%, 15/11/2026	418.840
400.000	ZF Europe Finance BV, 3.00%, 23/10/2029	416.850
350.000	Organon Finance 1 LLC, 2.88%, 30/04/2028	350.000
330.000	Wizz Air Finance Co, 1.35%, 19/01/2024	330.000
324.000	Kleopatra Holdings 2 SCA, 6.50%, 01/09/2026	326.214
317.000	Laboratoire Eimer Selas, 5.00%, 01/02/2029	322.317
317.000	BK LC Lux Finco1 Sarl, 5.25%, 30/04/2029	321.752
318.000	Paysafe Finance Plc/Paysafe Holdings US Corp, 3.00%, 15/06/2029	318.000
315.000	NH Hotel Group SA, 4.00%, 02/07/2026	315.250
269.000	AA Bond Co Ltd, 6.50%, 31/01/2026	310.488
304.000	Ontex Group NV, 3.50%, 15/07/2026	304.000
300.000	Casino Guichard-Perrachon, 4.50%, 07/03/2024	296.445
300.000	Abertis Finance BV, 2.63%, 29/12/2049	295.788
271.000	Autostrade per l'Italia SpA, 1.88%, 26/09/2029	277.163
273.000	Grupo Antolin-Irausa SA, 3.50%, 30/04/2028	273.190
252.000	Nobel Bidco BV, 3.13%, 15/06/2028	252.000
245.000	Intrum AB, 3.00%, 15/09/2027	244.388
241.000	Guala Closures SpA, 3.25%, 15/06/2028	241.000
230.000	Summer BC Holdco B Sarl, 5.75%, 31/10/2026	240.350
226.000	Victoria Plc, 3.63%, 24/08/2026	226.000
212.000	Constellium SE, 3.13%, 15/07/2029	212.000
250.000	Flatiron CLO 17 Ltd Series 2017-1X Class ER, 6.06%, 15/05/2030	205.778
250.000	Flatiron CLO 17 Ltd Series 2017-1X Class E, 8.34%, 15/05/2030	204.384
250.000	Ares XXVII CLO Ltd Series 2013-2X Class E, 6.68%, 28/07/2029	203.105
200.000	Ashland Services BV, 2.00%, 30/01/2028	202.750
174.000	Deuce Finco Plc, 5.50%, 15/06/2027	202.732
200.000	PCF GmbH, 4.75%, 15/04/2026	201.125
200.000	SpA Holdings 3 Oy, 3.63%, 04/02/2028	200.000
200.000	Abanca Corp Bancaria SA, 6.00%, 20/04/2170	200.000
200.000	International Consolidated Airlines Group SA, 3.75%, 25/03/2029	200.000
195.000	Sofima Holding SpA, 3.75%, 15/01/2028	197.340
194.000	TI Automotive Finance Plc, 3.75%, 15/04/2029	194.000
200.000	Casino Guichard-Perrachon, 3.58%, 07/02/2025	182.584
169.000	easyJet Finco BV, 1.88%, 03/03/2028	167.633
164.000	Foncia Management SASU, 3.38%, 31/03/2028	164.000

Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (cont.)

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
850.000	Miller Homes Group Holdings Plc, 5.50%, 15/10/2024	1.002.717
521.000	Altice France Holding SA, 4.00%, 15/02/2028	500.859
459.000	DKT Finance ApS, 7.00%, 17/06/2023	470.131
417.000	House of Finance NV, 4.38%, 15/07/2026	419.998
300.000	Netflix Inc, 3.63%, 15/06/2030	358.650
350.000	Loxam SAS, 6.00%, 15/04/2025	355.775
350.000	Organon Finance 1 LLC, 2.88%, 30/04/2028	354.813
350.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co, 4.75%, 15/04/2024	352.148
337.000	Playtech Plc, 4.25%, 07/03/2026	349.431
328.000	CeramTec BondCo GmbH, 5.25%, 15/12/2025	335.597
327.000	Lincoln Financing Sarl, 3.63%, 01/04/2024	330.504
330.000	Wizz Air Finance Co, 1.35%, 19/01/2024	330.413
320.000	Autostrade per l'Italia SpA, 1.88%, 26/09/2029	330.400
317.000	3AB Optique Developpement SAS, 4.00%, 01/10/2023	320.994
320.513	Froneri International Ltd, 5.75%, 31/01/2028	320.513
287.000	HT Troplast GmbH, 9.25%, 15/07/2025	312.895
300.000	Casino Guichard-Perrachon, 4.50%, 07/03/2024	304.650
272.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 6.00%, 31/01/2025	300.750
300.000	Abertis Finance BV, 2.63%, 29/12/2049	297.750
267.000	Encore Capital Group Inc, 4.88%, 15/10/2025	282.120
270.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc, 2.20%, 15/01/2024	261.571
210.000	Petroleos Mexicanos, 3.75%, 16/11/2025	237.849
230.000	Intrum AB, 3.50%, 15/07/2026	235.463
216.000	Adient Global Holdings Ltd, 3.50%, 15/08/2024	223.068
200.000	doValue SpA, 5.00%, 04/08/2025	211.410
215.000	Carnival Corp, 1.88%, 07/11/2022	210.877
200.000	Telefonica Europe BV, 2.88%, 29/12/2049	207.340
200.000	ZF Europe Finance BV, 3.00%, 23/10/2029	206.840
185.000	Sigma Holdco BV, 4.04%, 02/07/2025	205.725
200.000	Constellium SE, 4.25%, 15/02/2026	203.910
200.000	Wintershall Dea Finance 2 BV, 3.00%, 29/12/2049	200.500
200.000	Abanca Corp Bancaria SA, 6.00%, 20/04/2170	200.400
200.000	International Consolidated Airlines Group SA, 3.75%, 25/03/2029	200.400
172.000	SoftBank Group Corp, 5.00%, 15/04/2028	200.380
200.000	Rossini Sarl, 3.88%, 30/10/2025	200.290
196.785	Solenis Holdings LLC, 4.75%, 26/06/2025	197.523
200.000	Casino Guichard-Perrachon, 3.58%, 07/02/2025	195.720
181.000	Tereos Finance Groupe I SA, 7.50%, 30/10/2025	191.408
169.000	easyJet Finco BV, 1.88%, 03/03/2028	168.155
132.000	Fiat Chrysler Automobiles NV, 4.50%, 07/07/2028	167.125
162.000	Kronos International Inc, 3.75%, 15/09/2025	164.754
155.000	Smurfit Kappa Treasury ULC, 1.50%, 15/09/2027	163.758

Neuberger Berman Global Equity Fund

Balance

	Nota	A 31 de diciembre de 2020* USD
Activo circulante		
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	3.726
Ingresos a percibir y otros activos		23.301
Activos totales		27.027
Pasivo circulante		
Descubierto bancario	3	5.330
Gastos devengados		6.564
Otras cuentas por pagar		15.133
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		27.027
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		–

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global Equity Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Periodo finalizado el 30 de junio de 2020* USD
Ingresos		
Ingresos por intereses		167
Ingresos por dividendos		7.834
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(209.219)
		(201.218)
Gastos		
Comisión de gestión	5	2.429
Comisión de administración	5	3.759
Comisión de compromiso	16	168
Comisión de depósito	5	9.003
Comisión del Depositario	5	90
Honorarios profesionales	7	5.320
Honorarios de los Consejeros	6	2.841
Costes de transacciones	7	7.986
Honorarios de auditoría	7	6.209
Reembolso de IVA		(5)
Otros gastos	7	15.219
Gastos no asumidos	5	(46.761)
Gastos totales		6.258
Impuestos retenidos en origen		1.489
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		(208.965)

*La Cartera se liquidó el 15 de mayo de 2020.

Todos los beneficios y pérdidas proceden exclusivamente de operaciones interrumpidas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global Equity Fund (cont.)

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

	Periodo finalizado el 30 de junio de 2020*
	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	1.422.397
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	(208.965)
Reembolsos	(1.213.432)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	-

*La Cartera se liquidó el 15 de mayo de 2020.

Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 14,51%. Durante el mismo periodo, el índice MSCI All-Country World (ACWI) (Total Return, Net of Tax, USD) (el "Índice principal") y el índice MSCI ACWI Value (Total Return, Net of Tax, USD) (el "Índice secundario") rindieron un 12,30% y un 14,13%, respectivamente. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso.)

Los mercados de renta variable global cerraron el primer semestre de 2021 con sólidos resultados, tras haber alcanzado nuevos máximos a finales de junio. La pandemia de la COVID-19 continuó y muchos mercados no estadounidenses con tasas de vacunación más bajas atravesaron dificultades para contener la variante Delta. El índice de precios al consumo (IPC) estadounidense mantuvo su tendencia ascendente este año, avivando la preocupación por la inflación, mientras que el giro restrictivo de la Reserva Federal estadounidense también pesó sobre las perspectivas para la inflación. Las acciones de valor continuaron su recuperación durante gran parte de este año, hasta que se produjo un giro que provocó el dominio de sus homólogas de crecimiento hacia finales del periodo. Los datos económicos fueron heterogéneos en el primer semestre de 2021: se observó una dispersión del crecimiento económico mundial, dado que los PMI de manufacturas mejoraron en América del Norte y Europa, mientras que en los mercados desarrollados asiáticos se mantuvieron relativamente sin cambios. La tasa de desempleo estadounidense continuó con la tendencia de estancamiento de finales de 2020. La rentabilidad del bono del Tesoro estadounidense a 10 años subió por encima del 1% en los primeros días de 2021 y se estabilizó en torno al 1,5% en el segundo trimestre de 2021, lo que apunta a una mejora sostenida del sentimiento del mercado. Una agresiva campaña de vacunación contra la COVID-19 en EE. UU. logró la inmunización de aproximadamente el 47% de la población para mediados de año, lo que permitió una reducción de las restricciones y la reapertura de la economía.

Durante el semestre cerrado el 30 de junio de 2021, el sesgo hacia el valor de la Cartera se benefició de la recuperación de este estilo del año en curso y esta demostró resiliencia durante la repentina rotación de junio en favor de las acciones de crecimiento, batiendo tanto al índice principal como al secundario. Por regiones, nuestra rentabilidad superior respecto al índice principal se debió principalmente a la selección de valores en EE. UU. y Canadá. Los sectores de consumo discrecional y finanzas lideraron la rentabilidad superior de la Cartera, mientras que la selección de valores en servicios de comunicación se situó a la zaga respecto del índice principal. Desde el punto de vista de los factores, la rentabilidad de la cartera fue superior a la del Índice principal debido a la renta variable de estilo de valor, de rentas y de bajo riesgo, mientras que los factores de calidad y momentum generaron una rentabilidad inferior.

Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		10.299.318	8.323.945
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	26.694	44.692
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		1	-
Cuentas a percibir por acciones emitidas		12.000	-
Ingresos a percibir y otros activos		27.389	22.076
Activos totales		10.365.402	8.390.713
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		34.079	62.308
Descubierto bancario	3	25	3
Gastos devengados		17.762	36.555
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		876	-
Otras cuentas por pagar		67.014	20.956
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		119.756	119.822
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		10.245.646	8.270.891

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Systematic Global Equity Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		–	346
Ingresos por dividendos		126.608	610.685
Ingresos por préstamo de valores	15	10	183
Ingresos varios		108	–
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		1.103.819	(3.780.542)
		1.230.545	(3.169.328)
Gastos			
Comisión de gestión	5	9.295	293.700
Comisión de distribución	5	4.920	7.382
Comisión de administración	5	25.773	44.966
Comisión de compromiso	16	769	1.208
Comisión de depósito	5	5.890	6.792
Comisión del Depositario	5	224	2.019
Honorarios profesionales	7	38.598	23.853
Honorarios de los Consejeros	6	2.413	2.375
Costes de transacciones	7	42.780	107.332
Honorarios de auditoría	7	9.246	8.666
Reembolso de IVA		(39)	(142)
Otros gastos	7	3.574	5.053
Gastos no asumidos	5	(107.618)	(104.415)
Gastos totales		35.825	398.789
Costes financieros			
Gastos por intereses		52	–
		52	–
Impuestos retenidos en origen		24.055	128.118
Impuesto sobre las plusvalías		–	(5.200)
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		1.170.613	(3.691.035)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Systematic Global Equity Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	8.270.891	31.667.374
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	1.170.613	(3.691.035)
Suscripciones	1.715.433	15.634.420
Reembolsos	(911.291)	(1.896.693)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	10.245.646	41.714.066

Neuberger Berman Systematic Global Equity Fund (cont.)

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 89,70% (31 de diciembre de 2020: 88,43%)			
Dólar australiano			
3.723	Aurizon Holdings Ltd*	10.398	0,10
1.541	Australia & New Zealand Banking Group Ltd*	32.567	0,32
559	BlueScope Steel Ltd*	9.216	0,09
1.670	Brambles Ltd*	14.343	0,14
759	Coles Group Ltd*	9.738	0,09
3.258	Fortescue Metals Group Ltd*	57.088	0,56
7.560	Telstra Corp Ltd*	21.341	0,21
	Total dólar australiano	154.691	1,51
Dólar canadiense			
691	Bank of Nova Scotia*	44.988	0,44
451	Canadian Imperial Bank of Commerce*	51.393	0,50
2.374	Enbridge Inc*	95.148	0,93
120	George Weston Ltd**	11.450	0,11
549	Great-West Lifeco Inc**	16.324	0,16
654	Hydro One Ltd**	15.823	0,16
328	Magna International Inc*	30.400	0,30
1.624	Manulife Financial Corp*	32.000	0,31
63	Power Corp of Canada**	1.993	0,02
312	Toronto-Dominion Bank*	21.888	0,21
	Total dólar canadiense	321.407	3,14
Corona danesa			
9	AP Moller - Maersk A/S Class B*	25.871	0,25
148	Novo Nordisk A/S Class B*	12.401	0,12
172	Pandora A/S*	23.123	0,23
	Total corona danesa	61.395	0,60
Euro			
182	Allianz SE*	45.390	0,44
102	Arkema SA*	12.798	0,12
1.264	Assicurazioni Generali SpA*	25.340	0,25
534	Bayerische Motoren Werke AG*	56.558	0,55
879	BNP Paribas SA*	55.112	0,54
677	Cie de Saint-Gobain*	44.590	0,44
295	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA*	47.054	0,46
1.522	Credit Agricole SA*	21.324	0,21
604	Daimler AG*	53.936	0,53

Neuberger Berman Systematic Global Equity Fund (cont.)

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 89,70% (31 de diciembre de 2020: 88,43%) (cont.)			
Euro (cont.)			
1.155	Deutsche Post AG*	78.567	0,77
4.040	EDP - Energias de Portugal SA*	21.416	0,21
396	Enagas SA*	9.150	0,09
231	HeidelbergCement AG*	19.817	0,19
117	Henkel AG & Co KGaA – Preferred Shares*	12.354	0,12
1.907	Koninklijke Ahold Delhaize NV*	56.696	0,55
292	Koninklijke Philips NV*	14.471	0,14
151	Merck KGaA*	28.956	0,28
62	MTU Aero Engines AG*	15.359	0,15
241	NN Group NV*	11.370	0,11
205	Orion OYJ Class B*	8.813	0,08
361	Publicis Groupe SA*	23.092	0,23
198	Randstad NV*	15.145	0,15
872	Red Electrica Corp SA*	16.189	0,16
731	SAP SE*	103.021	1,01
361	Smurfit Kappa Group Plc*	19.586	0,19
3.694	Snam SpA*	21.356	0,21
754	Societe Generale SA*	22.229	0,21
141	Solvay SA*	17.925	0,17
690	Telefonica SA*	3.225	0,03
910	Tenaris SA*	9.920	0,10
43	Wolters Kluwer NV*	4.320	0,04
	Total euro	895.079	8,73
Dólar de Hong Kong			
6.500	BOC Hong Kong Holdings Ltd*	22.055	0,22
58.000	China Construction Bank Corp - H Shares*	45.633	0,45
4.000	Sino Land Co Ltd*	6.305	0,06
2.000	Sun Hung Kai Properties Ltd*	29.797	0,29
15.000	WH Group Ltd*	13.482	0,13
	Total dólar de Hong Kong	117.272	1,15
Yen japonés			
700	Ajinomoto Co Inc*	18.189	0,18
3.200	Astellas Pharma Inc*	55.774	0,55
100	Bridgestone Corp*	4.554	0,04
400	Brother Industries Ltd*	7.990	0,08
600	Daiwa House Industry Co Ltd*	18.029	0,18

Neuberger Berman Systematic Global Equity Fund (cont.)

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 89,70% (31 de diciembre de 2020: 88,43%) (cont.)			
Yen japonés (cont.)			
3.100	Daiwa Securities Group Inc*	17.040	0,17
200	FUJIFILM Holdings Corp*	14.846	0,14
400	Fujitsu Ltd*	74.962	0,73
800	Honda Motor Co Ltd*	25.588	0,25
1.100	Kajima Corp*	13.945	0,14
1.800	KDDI Corp*	56.194	0,55
2.500	Mitsubishi Electric Corp*	36.321	0,35
300	Mitsui Chemicals Inc*	10.366	0,10
2.500	Mizuho Financial Group Inc*	35.758	0,35
1.372	Nippon Telegraph & Telephone Corp*	35.781	0,35
300	Nippon Yusen KK*	15.218	0,15
200	Nitto Denko Corp*	14.938	0,14
4.500	Nomura Holdings Inc*	23.021	0,22
1.300	Obayashi Corp*	10.342	0,10
200	Otsuka Holdings Co Ltd*	8.302	0,08
3.200	Resona Holdings Inc*	12.317	0,12
900	Sekisui House Ltd*	18.476	0,18
400	Sony Group Corp*	38.976	0,38
2.100	Sumitomo Chemical Co Ltd*	11.144	0,11
400	Taisei Corp*	13.118	0,13
300	Yamato Holdings Co Ltd*	8.541	0,08
Total yen japonés		599.730	5,85
Nuevo dólar taiwanés			
5.031	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd*	107.436	1,05
Total nuevo dólar taiwanés		107.436	1,05
Dólar de Nueva Zelanda			
2.681	Spark New Zealand Ltd*	8.992	0,09
Total dólar de Nueva Zelanda		8.992	0,09
Corona noruega			
643	DNB ASA*	14.018	0,14
1.056	Equinor ASA*	22.356	0,22
106	Yara International ASA*	5.583	0,05
Total corona noruega		41.957	0,41

Neuberger Berman Systematic Global Equity Fund (cont.)

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 89,70% (31 de diciembre de 2020: 88,43%) (cont.)			
Libra esterlina (cont.)			
455	Anglo American Plc*	18.055	0,18
373	Ashtead Group Plc*	27.640	0,27
8.598	Barclays Plc*	20.325	0,20
9.188	BT Group Plc Class A*	24.624	0,24
331	Bunzl Plc*	10.924	0,11
122	DCC Plc*	9.974	0,10
341	Ferguson Plc*	47.343	0,46
2.539	GlaxoSmithKline Plc*	49.785	0,49
2.547	J Sainsbury Plc*	9.563	0,09
367	Johnson Matthey Plc*	15.580	0,15
3.927	Kingfisher Plc*	19.774	0,19
5.000	M&G Plc*	15.811	0,15
818	Mondi Plc*	21.482	0,21
344	Persimmon Plc*	14.057	0,14
324	Reckitt Benckiser Group Plc*	28.632	0,28
235	Schroders Plc*	11.405	0,11
529	Unilever Plc*	30.916	0,30
1.319	United Utilities Group Plc*	17.755	0,17
Total libra esterlina		393.645	3,84
Dólar de Singapur			
1.200	Singapore Exchange Ltd*	9.981	0,10
Total dólar de Singapur		9.981	0,10
Won de Corea del Sur			
1.665	Samsung Electronics Co Ltd*	119.314	1,16
Total won de Corea del Sur		119.314	1,16
Corona sueca			
294	Kinnevik AB Class B*	11.778	0,11
2.202	Nordea Bank Abp*	24.527	0,24
555	Skanska AB Class B*	14.731	0,14
2.861	Svenska Handelsbanken AB Class A*	32.303	0,32
1.597	Telefonaktiebolaget LM Ericsson Class B*	20.085	0,20
Total corona sueca		103.424	1,01
Franco suizo			
304	Adecco Group AG*	20.673	0,20
4	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG*	39.833	0,39

Neuberger Berman Systematic Global Equity Fund (cont.)

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 89,70% (31 de diciembre de 2020: 88,43%) (cont.)			
Franco suizo (cont.)			
325	Julius Baer Group Ltd*	21.230	0,21
175	Logitech International SA*	21.223	0,21
335	Roche Holding AG*	126.320	1,23
85	Swiss Prime Site AG*	8.442	0,08
3	Swisscom AG*	1.714	0,02
Total franco suizo		239.435	2,34
Dólar estadounidense			
562	3M Co*	111.630	1,09
898	AbbVie Inc*	101.151	0,99
256	Accenture Plc Class A*	75.466	0,74
239	Activision Blizzard Inc*	22.810	0,22
794	Aflac Inc*	42.606	0,42
558	Allstate Corp*	72.786	0,71
85	Alphabet Inc Class A*	207.552	2,03
24	Amazon.com Inc*	82.564	0,81
214	American Water Works Co Inc*	32.984	0,32
70	Amgen Inc*	17.063	0,17
183	Anthem Inc*	69.869	0,68
1.705	Apple Inc*	233.517	2,28
536	Applied Materials Inc*	76.326	0,74
122	Arrow Electronics Inc*	13.887	0,14
2.552	AT&T Inc*	73.447	0,71
222	Atmos Energy Corp*	21.337	0,21
327	Baidu Inc ADR*	66.676	0,65
243	Becton Dickinson & Co*	59.095	0,58
443	Best Buy Co Inc*	50.936	0,50
210	Booz Allen Hamilton Holding Corp Class A*	17.888	0,17
1.415	Bristol-Myers Squibb Co*	94.550	0,92
122	Broadcom Inc*	58.174	0,57
256	Brookfield Renewable Corp Class A*	10.737	0,11
125	Capital One Financial Corp*	19.336	0,19
627	CBRE Group Inc Class A*	53.753	0,53
167	Celanese Corp Class A*	25.317	0,25
303	Cerner Corp*	23.683	0,23
163	Cigna Corp*	38.642	0,38
1.784	Cisco Systems Inc*	94.552	0,92
1.686	Citigroup Inc*	119.284	1,17
793	Citizens Financial Group Inc*	36.375	0,35

Neuberger Berman Systematic Global Equity Fund (cont.)

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 89,70% (31 de diciembre de 2020: 88,43%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
150	Citrix Systems Inc*	17.591	0,17
398	Coca-Cola Co*	21.536	0,21
989	Cognizant Technology Solutions Corp Class A*	68.498	0,67
605	Colgate-Palmolive Co*	49.217	0,48
1.954	Comcast Corp Class A*	111.417	1,09
200	Comerica Inc*	14.268	0,14
872	Conagra Brands Inc*	31.723	0,31
634	Consolidated Edison Inc*	45.470	0,44
89	Constellation Brands Inc Class A*	20.816	0,20
227	Crown Holdings Inc*	23.202	0,22
264	Cummins Inc*	64.366	0,63
341	CVS Health Corp*	28.453	0,28
151	Deere & Co*	53.259	0,52
22	Dell Technologies Inc Class C*	2.193	0,02
214	Dover Corp*	32.228	0,31
38	Dow Inc*	2.404	0,02
366	DR Horton Inc*	33.075	0,32
253	Eastman Chemical Co*	29.538	0,29
1.302	eBay Inc*	91.413	0,89
333	Electronic Arts Inc*	47.895	0,47
781	Emerson Electric Co*	75.163	0,74
449	Essential Utilities Inc*	20.519	0,20
661	Eversource Energy*	53.039	0,52
192	Exxon Mobil Corp*	12.111	0,12
206	Fortune Brands Home & Security Inc*	20.520	0,20
481	Fox Corp Class A*	17.860	0,18
540	Franklin Resources Inc*	17.275	0,17
1.092	General Mills Inc*	66.536	0,65
312	General Motors Co*	18.461	0,18
166	Genuine Parts Co*	20.994	0,20
913	Gilead Sciences Inc*	62.869	0,61
233	Goldman Sachs Group Inc*	88.430	0,86
388	Hologic Inc*	25.887	0,25
446	Howmet Aerospace Inc*	15.374	0,15
1.485	HP Inc*	44.832	0,44
128	Humana Inc*	56.668	0,55
1.991	Intel Corp*	111.775	1,09
500	International Business Machines Corp*	73.295	0,72

Neuberger Berman Systematic Global Equity Fund (cont.)

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 89,70% (31 de diciembre de 2020: 88,43%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
575	International Paper Co*	35.253	0,34
726	Interpublic Group of Cos Inc*	23.588	0,23
152	JM Smucker Co*	19.695	0,19
85	Jones Lang LaSalle Inc*	16.614	0,16
231	JPMorgan Chase & Co*	35.930	0,35
951	KeyCorp*	19.638	0,19
236	Kimberly-Clark Corp*	31.572	0,31
3.879	Kinder Morgan Inc*	70.714	0,69
91	KLA Corp*	29.503	0,29
1.409	Kroger Co*	53.979	0,53
321	L Brands Inc*	23.131	0,23
25	Lam Research Corp*	16.268	0,16
498	LKQ Corp*	24.512	0,24
357	Masco Corp*	21.031	0,21
176	McDonald's Corp*	40.654	0,40
5.453	Media General Inc CVRØ	0	0,00
337	Medtronic Plc*	41.832	0,41
484	MetLife Inc*	28.967	0,28
859	Microsoft Corp*	232.703	2,27
113	Mohawk Industries Inc*	21.717	0,21
124	Morgan Stanley*	11.370	0,11
151	Motorola Solutions Inc*	32.744	0,32
357	Newmont Corp*	22.627	0,22
294	Northern Trust Corp*	33.992	0,33
214	Nucor Corp*	20.529	0,20
859	ONEOK Inc*	47.795	0,47
1.032	Oracle Corp*	80.331	0,78
169	Owens Corning*	16.545	0,16
71	Parker-Hannifin Corp*	21.805	0,21
247	PepsiCo Inc*	36.598	0,36
125	PPG Industries Inc*	21.221	0,21
443	Principal Financial Group Inc*	27.993	0,27
474	Procter & Gamble Co*	63.957	0,62
439	Progressive Corp*	43.114	0,42
576	QUALCOMM Inc*	82.328	0,80
203	Quest Diagnostics Inc*	26.790	0,26
90	ResMed Inc*	22.187	0,22
171	Seagate Technology Holdings Plc*	15.036	0,15

Neuberger Berman Systematic Global Equity Fund (cont.)

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 89,70% (31 de diciembre de 2020: 88,43%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
231	Sealed Air Corp*	13.687	0,13
22	Skyworks Solutions Inc*	4.219	0,04
82	Snap-on Inc*	18.321	0,18
74	Starbucks Corp*	8.274	0,08
98	STERIS Plc*	20.217	0,20
849	Synchrony Financial*	41.194	0,40
235	T Rowe Price Group Inc*	46.523	0,45
501	Target Corp*	121.112	1,18
175	TE Connectivity Ltd*	23.662	0,23
52	Teledyne Technologies Inc*	21.779	0,21
23	Teradyne Inc*	3.081	0,03
9	Tesla Inc*	6.117	0,06
416	Texas Instruments Inc*	79.997	0,78
234	Thermo Fisher Scientific Inc*	118.046	1,15
1.296	TJX Cos Inc*	87.376	0,86
349	Travelers Cos Inc*	52.249	0,51
482	Tyson Foods Inc Class A*	35.552	0,35
96	Union Pacific Corp*	21.113	0,21
139	United Rentals Inc*	44.342	0,43
168	UnitedHealth Group Inc*	67.274	0,66
46	Vail Resorts Inc*	14.560	0,14
1.066	Verizon Communications Inc*	59.728	0,58
92	Whirlpool Corp*	20.058	0,20
2.222	Williams Cos Inc*	58.994	0,57
Total dólar estadounidense		6.015.901	58,72
Total valores de renta variable		9.189.659	89,70
Fondos de inversión inmobiliaria 1,83% (31 de diciembre de 2020: 1,49%)			
Dólar australiano			
1.684	Dexus	13.490	0,13
1.404	Goodman Group	22.314	0,22
3.699	Stockland	12.941	0,13
Total dólar australiano		48.745	0,48
Dólar estadounidense			
1.032	AGNC Investment Corp	17.431	0,17
2.410	Annaly Capital Management Inc	21.401	0,21
457	Iron Mountain Inc	19.340	0,19

Neuberger Berman Systematic Global Equity Fund (cont.)

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
Fondos de inversión inmobiliaria 1,83% (31 de diciembre de 2020: 1,49%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
1.057	VICI Properties Inc	32.788	0,32
1.381	Weyerhaeuser Co	47.534	0,46
Total dólar estadounidense		138.494	1,35
Total fondos de inversión inmobiliaria *		187.239	1,83
Fondos de inversión 8,84% (31 de diciembre de 2020: 9,45%)			
Dólar estadounidense			
77.187	iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	452.393	4,41
6.203	Vanguard FTSE Emerging Markets UCITS ETF Class USD Distributing	454.060	4,43
Total fondos de inversión #		906.453	8,84
Total inversiones		10.283.351	100,37

Contratos de divisas a plazo 0,15% (31 de diciembre de 2020: 1,27%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases EUR con cobertura						
470.954 USD	392.718 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	5.063	0,05
477.016 USD	398.062 €	19/07/2021	UBS AG	4	4.785	0,05
571.895 USD	476.914 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	11	6.119	0,05
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					15.967	0,15
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados					10.299.318	100,52

Pasivo financiero al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,33%) (31 de diciembre de 2020: (0,75%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases EUR con cobertura						
755.999 €	907.139 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	10	(10.276)	(0,10)
702.305 €	841.935 USD	19/07/2021	UBS AG	5	(8.772)	(0,08)
1.135.753 €	1.362.405 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	16	(15.031)	(0,15)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					(34.079)	(0,33)

Neuberger Berman Systematic Global Equity Fund (cont.)

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	(34.079)	(0,33)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	10.265.239	100,19
Otro pasivo neto	(19.593)	(0,19)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	10.245.646	100,00

Análisis de la cartera	USD	% de los Total neto
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	9.331.308	90,02
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	45.590	0,44
μ Fondos de inversión	906.453	8,74
∅ Otros valores	0	0,00
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(18.112)	(0,17)
Total inversiones	10.265.239	99,03

Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
1.296	TJX Cos Inc	87.448
4.800	Astellas Pharma Inc	79.560
576	QUALCOMM Inc	78.019
1.056	Vanguard FTSE Emerging Markets UCITS ETF	75.188
1.302	eBay Inc	75.158
561	SAP SE	74.781
1.124	Bristol-Myers Squibb Co	72.881
1.203	BNP Paribas SA	71.502
1.519	Total SE	71.063
233	Goldman Sachs Group Inc	71.036
636	Emerson Electric Co	58.276
24.973	Barclays Plc	58.232
661	Eversource Energy	53.605
4.349	Food Motor Co	52.307
658	Rio Tinto PLC	52.153
604	Daimler AG	51.086
443	Best Buy Co Inc	50.385
2.222	Williams Cos Inc	49.684
5.346	Nordea Bank Abp	48.691
23	Alphabet Inc Class A	48.600

Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund (cont.)

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
1.318	Rio Tinto Plc	122.162
362	Home Depot Inc	111.377
248	Lockheed Martin Corp	95.264
35.146	Barclays Plc	84.930
993	EOG Resources Inc	84.210
1.363	Public Service Enterprise Group Inc	82.950
1.519	TotalEnergies SE	71.445
27.922	Intesa Sanpaolo SpA	70.847
345	Lowe's Cos Inc	67.733
2.437	Schlumberger Ltd	67.564
21	Amazon.com Inc	65.636
85	Tesla Inc	58.103
229	Amgen Inc	55.417
361	Schneider Electric SE	55.142
1.184	CRH Plc	53.505
1.143	Exelon Corp	52.989
264	L3Harris Technologies Inc	51.676
292	Capgemini SE	51.065
4.349	Ford Motor Co	49.274
4.046	Skandinaviska Enskilda Banken AB Class A	48.855
186	Ameriprise Financial Inc	46.236
1.200	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	41.819
20	Alphabet Inc Class A	39.600
663	BNP Paribas SA	39.112
341	Best Buy Co Inc	38.905

Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 14,99%. En el mismo periodo, el índice de referencia, el FTSE EPRA/Nareit Developed Index (USD Total Return, Net of Tax) (el "Índice") rindió un 15,66%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso.)

El mercado mundial de acciones generó excelentes resultados durante el período analizado. El mercado se vio favorecido por unos beneficios corporativos generalmente positivos, unos fuertes estímulos fiscales y monetarios, una sólida demanda de los inversores y una intensificación de la actividad económica a medida que avanzaba la campaña de vacunación contra la COVID-19. Como ya hemos señalado, el mercado bursátil global medido por el índice MSCI All Country World Index (Net) se anotó una rentabilidad del 12,30% en el periodo analizado. En cambio, el Índice rindió un 15,66%.

La Cartera generó una rentabilidad inferior a la del Índice durante el período analizado. En general, la selección de valores perjudicó a la rentabilidad relativa. Las posiciones de la Cartera en los sectores de infraestructuras, residencial y de artículos de lujo fueron las que más rentabilidad restaron. Por el contrario, las posiciones en venta minorista, oficinas y atención sanitaria fueron las que más contribuyeron a los resultados. En conjunto, el posicionamiento por países favoreció a la rentabilidad de la Cartera. En particular, las infraponderaciones en Alemania, Suecia y Bélgica fueron las que más valor aportaron. Por el contrario, una posición ajena al índice de referencia en China, la sobreponderación de Reino Unido y una infraponderación de EE. UU. fue lo que más perjudicó a los resultados.

En nuestra opinión, la aprobación de varias vacunas contra la COVID-19 constituyó un punto de inflexión importante en la lucha contra la pandemia mundial y causó una fuerte repunte del mercado. A pesar de que podría ser pronto para decir que la crisis de la COVID-19 ha concluido en EE. UU., creemos que la vacunación de la mayoría de la población estadounidense mayor de 12 años aumenta la visibilidad de un entorno pospandemia y podría dar lugar a una recuperación sostenible del mercado. Los desafíos que plantea la variante Delta entre otras, muchas de ellas con una mayor capacidad de contagio, nos recuerdan que la incertidumbre y la volatilidad del mercado podrían persistir. El nivel excepcional de estímulos fiscales, la aceleración de la reapertura de la economía estadounidense y el posible aumento del gasto en infraestructuras han provocado un aumento de la inflación general. Sin embargo, los comentarios benévolos del Tesoro estadounidense y de la Reserva Federal han aliviado estos temores y cabe esperar que mantengan los tipos en niveles próximos a sus mínimos históricos. A más largo plazo, los datos de la política relacionados con el gasto deficitario, la política fiscal y el comercio mundial podrían mermar la confianza de los inversores. El aumento de la inflación se puede considerar positivo para los propietarios de activos inmobiliarios, dado que pueden beneficiarse de ello a través del aumento de los alquileres que cobran a los arrendatarios.

En el extranjero, el mercado inmobiliario de Europa Continental se ha situado a la zaga este año, lastrado por el mercado residencial alemán, al que estamos expuestos. A pesar de que el sector se mostró extremadamente resiliente durante la crisis y se consideraba un refugio seguro, no se benefició del "reflation trade". Tenemos una opinión bastante favorable del sector y creemos que el atractivo de sus fundamentales permanece intacto. También seguimos confiando en la logística de Europa Continental y mantenemos en cartera posiciones centradas en este sector. En Reino Unido, la campaña de vacunación ha sido particularmente rápida y existen grandes esperanzas de que la vida comience a volver a la normalidad durante el verano. A más largo plazo, creemos que el cambio estructural será la clave para la rentabilidad a largo plazo de las empresas inmobiliarias británicas y seguimos confiando en las acciones que mantenemos en cartera.

Los mercados asiáticos siguieron a sus homólogos estadounidenses en la rotación de sectores de alto crecimiento hacia otros más afectados por la COVID-19, en previsión de un escenario de normalización. Las acciones del sector residencial y de la venta minorista de Asia rebotaron con fuerza, aunque creemos que las rentabilidades más atractivas se encuentran en las empresas de alta calidad y crecimiento superior que demuestren resiliencia frente a los cambios seculares futuros. También apostamos por determinadas acciones bien gestionadas que nos parecen bastante infravaloradas por los compradores de inmuebles privados.

Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		16.832.141	6.503.697
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	388.085	61.118
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		13	–
Cuentas a percibir por acciones emitidas		103.965	54.905
Ingresos a percibir y otros activos		51.657	58.123
Activos totales		17.375.861	6.677.843
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		19.668	1.674
Descubierto bancario	3	4	–
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		–	12.842
Gastos devengados		27.682	26.141
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		177.474	–
Otras cuentas por pagar		43.587	18.355
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		268.415	59.012
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		17.107.446	6.618.831

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		–	5.935
Ingresos por dividendos		171.369	732.349
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		1.299.164	(13.046.126)
		1.470.533	(12.307.842)
Gastos			
Comisión de gestión	5	52.719	368.509
Comisión de distribución	5	3.308	2.745
Comisión de administración	5	26.712	41.899
Comisión de compromiso	16	1.394	3.482
Comisión de depósito	5	5.976	6.262
Comisión del Depositario	5	259	2.593
Honorarios profesionales	7	38.193	24.983
Honorarios de los Consejeros	6	2.413	2.375
Costes de transacciones	7	40.010	77.441
Honorarios de auditoría	7	8.853	7.320
Reembolso de IVA		(35)	(80)
Otros gastos	7	3.224	5.298
Gastos no asumidos	5	(93.758)	(26.911)
Gastos totales		89.268	515.916
Costes financieros			
Gastos por intereses		50	881
Repartos de dividendos abonados	1	565	49.322
		615	50.203
Impuestos retenidos en origen		11.738	141.238
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		1.368.912	(13.015.199)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	6.618.831	67.705.165
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	1.368.912	(13.015.199)
Suscripciones	9.951.534	13.721.210
Reembolsos	(831.831)	(52.661.660)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	17.107.446	15.749.516

Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (cont.)

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 19,38% (31 de diciembre de 2020: 19,25%)			
Dólar canadiense			
3.343	Brookfield Asset Management Inc Class A	170.727	1,00
22	Brookfield Asset Management Reinsurance Partners Ltd Class A	1.164	0,01
Total dólar canadiense		171.891	1,01
Euro			
3.729	Cellnex Telecom SA	237.562	1,39
4.749	Deutsche Wohnen SE	290.490	1,70
5.806	Vonovia SE	375.389	2,19
Total euro		903.441	5,28
Dólar de Hong Kong			
61.000	China Resources Land Ltd	247.037	1,44
11.800	GDS Holdings Ltd Class A	116.847	0,68
31.883	Sun Hung Kai Properties Ltd	475.011	2,78
Total dólar de Hong Kong		838.895	4,90
Yen japonés			
32.906	Mitsubishi Estate Co Ltd	532.621	3,11
21.160	Nomura Real Estate Holdings Inc	537.246	3,14
Total yen japonés		1.069.867	6,25
Dólar de Singapur			
61.000	UOL Group Ltd	331.275	1,94
Total dólar de Singapur		331.275	1,94
Total valores de renta variable *		3.315.369	19,38
Fondos de inversión inmobiliaria 79,00% (31 de diciembre de 2020: 78,79%)			
Dólar australiano			
57.513	Charter Hall Long Wale REIT	205.095	1,20
27.313	Goodman Group	434.096	2,54
Total dólar australiano		639.191	3,74
Dólar canadiense			
3.364	Allied Properties Real Estate Investment Trust	122.384	0,72
3.591	Canadian Apartment Properties REIT	168.545	0,98
17.316	Summit Industrial Income REIT	248.490	1,45
Total dólar canadiense		539.419	3,15

Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (cont.)

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
Fondos de inversión inmobiliaria 79,00% (31 de diciembre de 2020: 78,79%) (cont.)			
Euro			
1.727	ARGAN SA	210.949	1,23
Total euro		210.949	1,23
Yen japonés			
235	LaSalle Logiport REIT	397.207	2,32
62	Mitsui Fudosan Logistics Park Inc	330.696	1,94
Total yen japonés		727.903	4,26
Libra esterlina			
18.423	Land Securities Group Plc	171.892	1,00
31.789	Safestore Holdings Plc	415.874	2,43
47.470	Segro Plc	717.745	4,20
32.864	UNITE Group Plc	487.596	2,85
Total libra esterlina		1.793.107	10,48
Dólar de Singapur			
72.170	Keppel DC REIT	133.688	0,78
40.766	Mapletree Industrial Trust	85.826	0,50
Total dólar de Singapur		219.514	1,28
Dólar estadounidense			
3.857	American Homes 4 Rent Class A	149.845	0,88
3.328	American Tower Corp	899.026	5,25
5.399	Apartment Income REIT Corp	256.075	1,50
2.312	Boston Properties Inc	264.932	1,55
3.397	Crown Castle International Corp	662.755	3,87
1.948	CyrusOne Inc	139.321	0,82
2.246	Digital Realty Trust Inc	337.933	1,97
4.407	Douglas Emmett Inc	148.163	0,87
5.447	Duke Realty Corp	257.915	1,51
728	Equinix Inc	584.293	3,42
4.682	Equity LifeStyle Properties Inc	347.919	2,04
6.425	Equity Residential	494.725	2,89
1.040	Essex Property Trust Inc	312.010	1,82
1.466	Extra Space Storage Inc	240.160	1,40
8.192	Healthcare Trust of America Inc Class A	218.726	1,28
7.045	Healthpeak Properties Inc	234.528	1,37
6.642	Host Hotels & Resorts Inc	113.512	0,66

Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (cont.)

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
Fondos de inversión inmobiliaria 79,00% (31 de diciembre de 2020: 78,79%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
5.308	Invitation Homes Inc	197.935	1,16
2.257	Kilroy Realty Corp	157.178	0,92
2.680	National Retail Properties Inc	125.638	0,74
5.610	Prologis Inc	670.563	3,92
1.463	Public Storage	439.910	2,57
5.909	Regency Centers Corp	378.590	2,21
4.943	Retail Opportunity Investments Corp	87.293	0,51
876	SBA Communications Corp Class A	279.181	1,63
2.627	Simon Property Group Inc	342.771	2,00
3.975	Spirit Realty Capital Inc	190.164	1,11
4.277	VICI Properties Inc	132.672	0,77
2.410	Vornado Realty Trust	112.475	0,66
4.399	Welltower Inc	365.557	2,14
7.080	Weyerhaeuser Co	243.694	1,42
Total dólar estadounidense		9.385.459	54,86
Total fondos de inversión inmobiliaria *		13.515.542	79,00
Total inversiones		16.830.911	98,38

Contratos de divisas a plazo 0,01% (31 de diciembre de 2020: 0,22%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases EUR con cobertura						
4.990 €	5.919 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
14.419 USD	12.054 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	119	0,00
38.572 USD	32.091 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	6	500	0,01
Clases GBP con cobertura						
33.204 £	45.706 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	166	0,00
30.764 £	42.351 USD	19/07/2021	UBS AG	1	150	0,00
30.305 £	41.700 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	166	0,00
2.209 USD	1.589 £	19/07/2021	UBS AG	2	13	0,00
8.955 USD	6.398 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	116	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					1.230	0,01

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	16.832.141	98,39

Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,12%) (31 de diciembre de 2020: (0,02%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases EUR con cobertura						
127.893 €	153.761 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	14	(2.040)	(0,01)
94.673 €	113.569 USD	19/07/2021	UBS AG	4	(1.256)	(0,01)
550.246 €	668.742 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	31	(15.969)	(0,10)
5.767 USD	4.863 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(2)	(0,00)
Clases GBP con cobertura						
3.070 £	4.301 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	(60)	(0,00)
3.201 £	4.481 USD	19/07/2021	UBS AG	5	(59)	(0,00)
10.622 £	14.956 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	11	(281)	(0,00)
910 USD	659 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(1)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					(19.668)	(0,12)

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(19.668)	(0,12)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	16.812.473	98,27
Otro activo neto	294.973	1,73
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	17.107.446	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	16.830.911	96,86
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(18.438)	(0,11)
Total inversiones	16.812.473	96,75

Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
2.084	American Tower Corp	508.964
26.300	Mitsubishi Estate Co Ltd	446.777
28.965	Segro Plc	408.238
5.806	Vonovia SE	377.748
15.300	Nomura Real Estate Holdings Inc	371.369
3.262	Prologis Inc	368.922
62.000	UOL Group Ltd	356.615
1.972	Crown Castle International Corp	354.972
471	Equinix Inc	344.858
22.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	335.149
203	LaSalle Logiport REIT	320.323
4.308	Equity Residential	306.199
18.955	UNITE Group Plc	285.984
4.828	Deutsche Wohnen SE	264.236
15.748	Goodman Group	230.979
3.791	Cellnex Telecom SA	228.236
850	Public Storage	227.175
18.333	Safestore Holdings Plc	225.512
3.728	Regency Centers Corp	218.557
44.000	China Resources Land Ltd	205.006
1.801	Simon Property Group Inc	204.867
2.983	Equity LifeStyle Properties Inc	203.387
1.305	Digital Realty Trust Inc	193.969
37	Mitsui Fudosan Logistics Park Inc	189.970
674	Essex Property Trust Inc	188.096
2.557	Welltower Inc	187.766
18.423	Land Securities Group Plc	180.535
3.887	Apartment Income REIT Corp	174.828
6.114	Healthcare Trust of America Inc Class A	171.598
1.521	Boston Properties Inc	162.704
2.257	Kilroy Realty Corp	157.323
506	SBA Communications Corp Class A	147.906
3.288	Duke Realty Corp	146.145
4.120	Weyerhaeuser Co	145.623
4.098	Healthpeak Properties Inc	133.630
970	Extra Space Storage Inc	133.289
4.307	VICI Properties Inc	128.762
10.113	Summit Industrial Income REIT	126.370
33.169	Charter Hall Long Wale REIT	121.390
2.410	Vornado Realty Trust	115.846

Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (cont.)

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
53.000	Henderson Land Development Co Ltd	238.116
9.495	Mitsui Fudosan Co Ltd	208.993
3.920	Shurgard Self Storage SA	169.568
45.914	CapitaLand Ltd	118.871
59.024	Mirvac Group	113.618
15.129	British Land Co Plc	109.374
791	LEG Immobilien AG	105.543
17	Nippon Accommodations Fund Inc Class A	91.566
5.359	Hufvudstaden AB Class A	89.596
2.053	Highwoods Properties Inc	88.899
6.484	Segro Plc	82.493
13	Japan Real Estate Investment Corp	72.747
660	Camden Property Trust	69.256
1.695	Omega Healthcare Investors Inc	63.058
3.609	Host Hotels & Resorts Inc	61.159
5.716	Merlin Properties Socimi SA	54.427
441	Simon Property Group Inc	47.911
38.335	Ascendas India Trust	44.553
1.019	National Retail Properties Inc	44.018
281	Digital Realty Trust Inc	37.468
1.159	American Homes 4 Rent Class A	34.767
33	Equinix Inc	22.294

Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund

Informe del Gestor de inversiones

En el semestre finalizado el 30 de junio de 2021, la rentabilidad total de las acciones de la Clase de Acumulación USD I fue del 24,58%. En el mismo periodo, el índice Russell 2000 (Total Return, Net of Tax, USD) registró una rentabilidad del 26,43%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

A pesar de que muchas de las acciones tecnológicas de la cartera generaron excelentes resultados, una importante sobreponderación del sector de tecnología de la información fue lo que más perjudicó a la rentabilidad relativa durante el semestre, dado que, en general, estos títulos se hundieron durante el primer trimestre, aunque posteriormente se recuperaron en el segundo. Una infraponderación del sector energético también perjudicó, dado que rebotó en consonancia con la subida de los precios del petróleo provocada por los bajos niveles de reservas y los recortes de producción.

Los años de experiencia en los mercados financieros pueden ser una bendición heterogénea. A finales de la década de los ochenta, después de que el valor del índice Nikkei se multiplicase por 20, un estratega de una empresa de corretaje japonesa anunció que la empresa iba a prescindir de los agentes y analistas más experimentados porque sus recuerdos de unos precios notablemente más bajos les impedían vender eficazmente las "nuevas" recomendaciones de inversión. Los economistas conductuales lo denominan generalmente "sesgo de anclaje", que se refiere a que el primer recuerdo o un recuerdo anterior de los precios influye de forma desproporcionada en la visión del valor. El "sesgo de inmediatez" también puede suponer un problema en un entorno de recuperación de una crisis. Este sesgo sobrestima la importancia de los recuerdos más recientes de la memoria. Habida cuenta de la corriente de ventas de la pandemia, la recuperación del mercado alimentada por las vacunas y el entorno de tres años de sólida rentabilidad, tenemos que ser conscientes de poderosos sesgos que pueden influir en nuestras opiniones acerca de las oportunidades del mercado actual.

Si analizamos la rentabilidad a partir del segundo trimestre, las acciones de pequeña capitalización avanzaron bastante. Prácticamente todos los periodos de rentabilidad de la clase de activos y de nuestra cartera parecen favorables y sólidos. Se ha producido un amplio debate acerca de la rentabilidad superior del crecimiento, pero la rentabilidad de la estrategia de crecimiento a largo plazo sugiere resultados similares. Una revisión de fondos de inversión de pequeña capitalización de cinco estrellas pone de manifiesto que muchos pequeños gestores de crecimiento avanzaron entre el 15% y el 20% durante 10 años (demasiado, en nuestra opinión) y batieron claramente a sus homólogos de valor, pero si consideramos un periodo de 20 años se sitúan asombrosamente cerca de los fondos de valor de cinco estrellas, en torno al 12%.

Con independencia del sesgo, sea hacia el crecimiento o el valor, los retrocesos significativos han formado parte integral de la rentabilidad histórica del 12%. Conscientes de que las correcciones del mercado son una posibilidad pero resultan imposibles de predecir, nuestra estrategia de centra en construir una cartera de empresas preparadas para sobrevivir a las correcciones del mercado y capaces al mismo tiempo de beneficiarse de una economía marcada por una significativa disrupción impulsada por la tecnología. La búsqueda de empresas que no se benefician del favor de los inversores en los sectores de la tecnología, la atención sanitaria y en empresas industriales avanzadas nos ayudó a superar la reciente tormenta de la COVID-19 y a prosperar cuando la inversión en valor volvió a verse favorecida. Muchos han puesto en duda el potencial exceso de rentabilidad a largo plazo de empresas que se han quedado rezagadas, pero nosotros no: basta con aplicar cuidadosamente la reversión a la media. Las empresas que no gozan del favor de los inversores, que son fundamentales para nuestro proceso, pueden revertir su trayectoria y generar una rentabilidad relativa claramente mejorada. Si analizamos nuestras 10 posiciones que más han contribuido a la rentabilidad en los últimos 10 años y comparamos sus resultados con los de la década anterior se obtiene un claro patrón de giro fructífero o reversión a la media.

Si analizamos fuentes de riesgo futuras, son muchas las que nos vienen a la mente —inflación, regulación y política fiscal desfavorables para las empresas, acontecimientos geopolíticos y variantes de la COVID-19, entre otras—. También surgirán problemas que todavía no se han puesto de manifiesto, aunque lo primero en lo que pensamos es en las relaciones entre EE. UU. y China. La inflación es un riesgo del mercado del que se habla con frecuencia, sobre todo por sus implicaciones para los tipos de interés y, de forma secundaria, por el problema que puede suponer para los márgenes de beneficios. La idea de moda por lo que respecta a la inflación es que será de carácter "transitorio", aunque nosotros no estamos tan seguros. Estamos aumentando nuestra inversión en algunas empresas de industrias básicas con una capacidad de fijación de precios recientemente descubierta. Durante años, la principal amenaza para la inversión en materias primas y sectores cíclicos ha sido el riesgo de un gasto de capital excesivo. En nuestra opinión, la aparición de la inversión ESG y de la preocupación por estas cuestiones está obstaculizando las entradas de capital de inversión en las industrias básicas con huellas de CO2. Esto creará una oportunidad para que las empresas más limpias y mejor capitalizadas se beneficien de periodos prolongados de precios más elevados. Hemos aumentado nuestra posición en el principal productor estadounidense de acero, Cleveland-Cliffs, y en una de las mayores empresas de gas y petróleo independientes del país, Devon Energy.

Se ha prestado mucha atención al riesgo asociado a las variantes de la COVID-19 y, a pesar de que han causado problemas, la buena noticia es que la ciencia también nos ha demostrado que puede vencer esta batalla. Las drásticas mejoras del acceso a activos fijos, puntos de atención rápida, pruebas de diagnóstico sin prescripción y, lo que es más importante, una nueva plataforma de tecnología de vacunación (ARNm) rápida y flexible frente a las variantes reducirán en riesgo de sobrecalentamiento de nuestros sistemas sanitarios. En nuestra opinión, el mayor riesgo procede de la mala respuesta de los políticos en la gestión de la COVID-19, más que del propio virus en sí.

La actividad de fusiones y adquisiciones ha sido sólida durante el semestre. En total, se han producido 10 operaciones en la cartera que proporcionan capital para reinvertir. En este sentido, nuestra nueva cadencia de ideas está regresando a los niveles previos a la COVID-19. Históricamente hemos generado entre 15 y 20 ideas al año. La cifra cayó hasta 10 en el periodo del 31/3/2020 al 31/3/2021. Durante el segundo trimestre añadimos cinco nuevas empresas a la cartera: cuatro empresas de crecimiento interrumpido en el sector tecnológico y de atención sanitaria, y una de venta minorista de artículos de consumo que representa una idea asociada a la recuperación de la COVID-19.

Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund (cont.)

Informe del Gestor de inversiones (cont.)

Nuestro descuento respecto del valor intrínseco al cierre del periodo se situaba en el 25% —aproximadamente un 10% por debajo de las medias históricas— y llama a la prudencia. En este contexto seguiremos manteniendo un equilibrio en la cartera entre las nuevas ideas contrarias a la tendencia y las inversiones consolidadas en empresas que han demostrado su capacidad para competir en una economía mundial marcada por una variada lista de riesgos y perturbaciones impulsadas por la tecnología.

En general, estamos satisfechos con la rentabilidad. Hace un año, nos habríamos visto muy presionados a considerar la posibilidad de que las acciones se recuperasen hasta alcanzar máximos históricos. A pesar de que nada podría hacernos más felices, seguimos teniendo en cuenta la posibilidad de eventos inesperados que puedan hacer retroceder a los mercados. Debemos ser francos con respecto a las valoraciones, estar preparados para los retrocesos y confiar en que podemos superar los desafíos.

Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		136.730.987	92.446.153
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	13.070.106	4.292.591
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		7.090.771	–
Cuentas a percibir por acciones emitidas		317.689	336.305
Ingresos a percibir y otros activos		39.187	20.440
Activos totales		157.248.740	97.095.489
Pasivo circulante			
Descubierto bancario	3	168	–
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		302.825	41.520
Gastos devengados		131.652	89.446
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		119.631	50.676
Otras cuentas por pagar		31.242	18.199
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		585.518	199.841
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		156.663.222	96.895.648

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		651	15.436
Ingresos por dividendos		254.980	274.726
Ingresos varios		533	–
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		25.342.663	(13.725.879)
		25.598.827	(13.435.717)
Gastos			
Comisión de gestión	5	532.117	571.568
Comisión de distribución	5	455	188.441
Comisión de administración	5	50.076	56.946
Comisión de compromiso	16	5.072	43.680
Comisión de depósito	5	5.812	5.825
Comisión del Depositario	5	3.018	4.831
Honorarios profesionales	7	26.561	22.237
Honorarios de los Consejeros	6	2.248	841
Costes de transacciones	7	49.441	45.308
Honorarios de auditoría	7	7.509	7.085
Reembolso de IVA		(484)	(331)
Otros gastos		9.978	9.204
Gastos totales		691.803	955.635
Costes financieros			
Gastos por intereses		207	133
		207	133
Impuestos retenidos en origen		63.408	59.693
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		24.843.409	(14.451.178)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	96.895.648	105.825.695
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	24.843.409	(14.451.178)
Suscripciones	42.262.844	40.316.588
Reembolsos	(7.338.679)	(40.824.160)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	156.663.222	90.866.945

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund (cont.)

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 87,26% (31 de diciembre de 2020: 95,41%)			
Dólar estadounidense			
38.581	Acadia Healthcare Co Inc	2.420.958	1,55
176.339	Accuray Inc	797.052	0,51
39.560	AerCap Holdings NV	2.025.868	1,29
118.010	Amneal Pharmaceuticals Inc	604.211	0,39
20.702	AtriCure Inc	1.642.289	1,05
16.225	Avanos Medical Inc	590.103	0,38
17.004	Avery Dennison Corp	3.574.921	2,28
21.891	Avis Budget Group Inc	1.705.090	1,09
232.419	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	1.831.462	1,17
53.495	BankUnited Inc	2.283.702	1,46
31.836	Bloom Energy Corp Class A	855.433	0,55
41.581	Box Inc Class A	1.062.395	0,68
20.207	Caleres Inc	551.449	0,35
15.923	CEVA Inc	753.158	0,48
10.978	Charles River Laboratories International Inc	4.060.982	2,59
67.802	Chico's FAS Inc	446.137	0,28
9.147	Children's Place Inc	851.220	0,54
57.045	Ciena Corp	3.245.290	2,07
13.264	Clean Harbors Inc	1.235.409	0,79
139.812	Cleveland-Cliffs Inc	3.014.347	1,92
43.753	Cognyte Software Ltd	1.071.949	0,69
26.527	Comerica Inc	1.892.436	1,21
427.950	Conduent Inc	3.209.625	2,05
136.206	Covanta Holding Corp	2.398.588	1,53
122.757	Criteo SA ADR	5.552.299	3,54
42.908	Crown Holdings Inc	4.385.627	2,80
29.613	CytoSorbents Corp	223.578	0,14
78.996	Devon Energy Corp	2.305.893	1,47
80.952	Diebold Nixdorf Inc	1.039.424	0,66
19.939	Dril-Quip Inc	674.536	0,43
77.571	EMCORE Corp	715.205	0,46
12.385	Emergent BioSolutions Inc	780.131	0,50
30.885	Energpac Tool Group Corp Class A	822.159	0,53
9.730	Entegris Inc	1.196.498	0,76
122.342	FireEye Inc	2.473.755	1,58
152.355	Fluidigm Corp	938.507	0,60
13.016	Haemonetics Corp	867.386	0,55

Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund (cont.)

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 87,26% (31 de diciembre de 2020: 95,41%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
33.958	Hain Celestial Group Inc	1.362.395	0,87
103.288	Harsco Corp	2.109.141	1,35
141.257	Huntington Bancshares Inc	2.015.737	1,29
7.736	II-VI Inc	561.556	0,36
8.757	Impinj Inc	451.774	0,29
96.090	Infinera Corp	980.118	0,62
133.116	International Game Technology Plc	3.189.459	2,04
34.171	Intersect ENT Inc	583.983	0,37
11.773	ION Geophysical Corp	24.606	0,02
24.541	Itron Inc	2.453.609	1,56
41.942	KAR Auction Services Inc	736.082	0,47
61.334	KBR Inc	2.339.892	1,49
48.677	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	3.119.222	1,99
12.301	MEDNAX Inc	370.875	0,24
9.343	Mercury Systems Inc	619.254	0,40
7.546	Molina Healthcare Inc	1.909.591	1,22
9.719	New Relic Inc	650.881	0,41
37.085	ODP Corp	1.780.451	1,14
92.646	Oil States International Inc	727.271	0,47
53.538	OneSpan Inc	1.367.360	0,87
71.405	OraSure Technologies Inc	724.047	0,46
21.179	Ormat Technologies Inc	1.472.576	0,94
10.471	OSI Systems Inc	1.064.272	0,68
30.843	PAE Inc	274.503	0,18
27.334	Patterson Cos Inc	830.680	0,53
28.242	Patterson-UTI Energy Inc	280.725	0,18
271.190	Quantum Corp	1.868.499	1,19
13.257	Radware Ltd	408.050	0,26
108.005	Rambus Inc	2.560.798	1,63
132.281	Resideo Technologies Inc	3.968.430	2,53
103.062	Ribbon Communications Inc	784.302	0,50
7.436	Ryder System Inc	552.718	0,35
17.116	SeaWorld Entertainment Inc	854.773	0,55
16.805	Spirit AeroSystems Holdings Inc Class A	793.028	0,51
29.505	Stericycle Inc	2.111.083	1,35
66.969	Stratasys Ltd	1.731.819	1,11
3.099	Teledyne Technologies Inc	1.297.954	0,83
45.734	Tempur Sealy International Inc	1.792.315	1,14

Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund (cont.)

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 87,26% (31 de diciembre de 2020: 95,41%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
87.912	TETRA Technologies Inc	381.538	0,24
30.699	Texas Capital Bancshares Inc	1.949.080	1,25
31.159	TreeHouse Foods Inc	1.387.199	0,89
14.729	Twin Discount Inc	209.593	0,13
131.556	Unisys Corp	3.329.682	2,12
4.071	Valmont Industries Inc	960.960	0,61
26.557	Varex Imaging Corp	712.259	0,45
111.588	Veeco Instruments Inc	2.682.575	1,71
39.611	Verint Systems Inc	1.785.268	1,14
34.488	Viasat Inc	1.718.882	1,10
86.933	Viavi Solutions Inc	1.535.237	0,98
80.476	Vistra Corp	1.492.830	0,95
38.232	Vonage Holdings Corp	550.923	0,35
142.959	Xperi Holding Corp	3.179.408	2,03
Total valores de renta variable *		136.698.335	87,26

Importe principal	Descripción de los valores	Cupón	Fecha de vencimiento	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Bonos de empresa 0,02% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)					
Dólar estadounidense					
32.000	ION Geophysical Corp	8,00%	15/12/2025	32.652	0,02
Total bonos de empresa *				32.652	0,02
Total inversiones				136.730.987	87,28

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	136.730.987	87,28
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	136.730.987	87,28
Otro activo neto	19.932.235	12,72
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	156.663.222	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	136.730.987	86,95
Total inversiones	136.730.987	86,95

Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
213.815	Quantum Corp	1.475.209
231.250	Conduent Inc	1.424.014
65.160	Xperi Holding Corp	1.415.704
91.517	Covanta Holding Corp	1.373.115
69.454	Cleveland-Cliffs Inc	1.306.925
55.024	International Game Technology Plc	1.241.444
194.148	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	1.218.395
42.796	Devon Energy Corp	1.173.444
51.752	Veeco Instruments Inc	1.164.055
41.005	Unisys Corp	1.009.331
20.301	ODP Corp	972.701
19.084	Viasat Inc	791.254
12.385	Emergent BioSolutions Inc	775.951
17.559	TreeHouse Foods Inc	771.516
56.017	Cloudera Inc	708.332
23.872	Resideo Technologies Inc	697.637
41.942	KAR Auction Services Inc	690.945
13.016	Haemonetics Corp	685.554
7.683	Ormat Technologies Inc	644.061
73.894	Oil States International Inc	604.945
15.394	Criteo SA ADR	593.933
26.803	Stratasys Ltd	586.730
26.557	Varex Imaging Corp	564.916
22.004	OneSpan Inc	545.431
26.880	Harsco Corp	544.442
5.381	Crown Holdings Inc	540.100
77.571	EMCORE Corp	515.673
28.601	Vistra Corp	496.751
36.102	Huntington Bancshares Inc	489.129
20.207	Caleres Inc	471.213
1.377	Charles River Laboratories International Inc	464.086
2.132	Avery Dennison Corp	461.788
11.463	Dril-Quip Inc	432.609
7.153	Ciena Corp	405.131
34.355	OraSure Technologies Inc	367.951

Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Total ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
69.764	Nuance Communications Inc	3.766.596
215.199	Cloudera Inc	3.393.836
37.799	Lydall Inc	2.291.869
44.059	Welbilt Inc	1.044.262
27.345	Luminex Corp	1.006.271
13.271	CoreLogic Inc	987.063
12.497	Talend SA ADR	801.745
2.499	Charles River Laboratories International Inc	799.469
21.422	MEDNAX Inc	685.003
8.513	Avis Budget Group Inc	661.892
197.149	Atlantic Power Corp	572.832
10.334	Stratasys Ltd	496.199
9.462	Patterson Cos Inc	314.861
3.141	Impinj Inc	219.276
2.914	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	179.501
1.766	AtriCure Inc	135.000
33.110	Express Inc	125.656
2.611	Forum Energy Technologies Inc	62.244

Neuberger Berman Asian Debt – Hard Currency Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 0,22%. En el mismo periodo, el JP Morgan Asia Credit Index (JACI) (Total Return, USD) registró una rentabilidad del -0,12%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Los títulos de crédito asiáticos se enfrentaron a un contexto volátil en la primera mitad del año al verse favorecidos los activos de riesgo por la sólida recuperación económica y las continuas campañas de vacunación mundial, a pesar de la presión que ejerció el "reflation trade" en los mercados de renta fija. Los títulos del Tesoro estadounidense fueron objeto de bruscas ventas masivas que elevaron las rentabilidades de los títulos a 10 años a un máximo del 1,74% al final de marzo; esto quedó parcialmente contrarrestado a finales del segundo trimestre, a pesar del giro "hawkish" que adoptó la Reserva Federal (la "Fed") a mediados de junio. Los precios del petróleo tuvieron un buen comportamiento durante todo el periodo, mientras que los metales preciosos atravesaron dificultades, en ambos casos como consecuencia del sentimiento económico positivo. El dólar estadounidense avanzó en gran medida en consonancia con las rentabilidades de los bonos del Tesoro, aunque experimentó un gran salto tras la reunión de la Fed del mes de junio. El JACI rindió un -0,12% en el primer semestre de 2021, gracias a que la rentabilidad total se vio favorecida por un avance significativo de las rentabilidades del Tesoro estadounidense, aun cuando los diferenciales de crédito se contrajeron durante el mismo periodo. Los diferenciales del índice de referencia de crédito asiático se contrajeron 23 puntos básicos y cerraron el periodo en 273 puntos básicos. En el espacio corporativo asiático, los mercados se vieron afectados por titulares negativos en el primer semestre. Salvo por algunos puntos débiles idiosincrásicos, los fundamentales del crédito se mantuvieron estables y el entorno macroeconómico continuó siendo benigno. Sin embargo, la actual campaña de desapalancamiento en China se aceleró y dio lugar a varios eventos de crédito y titulares en los sectores inmobiliario y financiero chinos. Esto no repercutió en otros mercados asiáticos y la propagación a otros sectores de China fue limitada, dado que la solidez de los factores técnicos contribuye a compartimentar estos riesgos. Los factores técnicos fueron favorables y los flujos de fondos positivos, mientras que la emisión neta tuvo una buena acogida.

La Cartera se anotó una rentabilidad positiva del 0,22% en el primer semestre de 2021 y batió a su índice de referencia. Tanto la asignación por países como la selección de valores contribuyeron a la rentabilidad. El posicionamiento descendente también favoreció en cierta medida durante el periodo. Por países, las principales contribuciones a la rentabilidad procedieron de las posiciones de la Cartera en Sri Lanka, la India, Macao e Indonesia. En Sri Lanka, la sobreponderación de la Cartera favoreció a los resultados, gracias a que los bonos se recuperaron de las pérdidas del pasado año cuando las autoridades reforzaron la financiación exterior para aliviar los problemas de liquidez a corto plazo. La sobreponderación de la Cartera en Indonesia también realizó una contribución positiva. En la India y Macao, las exposiciones de la Cartera a deuda corporativa generaron una rentabilidad superior y contribuyeron a sus resultados. Por otra parte, el mayor lastre para la rentabilidad de la Cartera procedió de su exposición a deuda corporativa china, como consecuencia de las constantes presiones de Huarong, para la que los inversores prevén un largo camino hasta la recuperación. Por sectores, el financiero fue el que más perjudicó a los resultados. Nuestras posiciones en el sector financiero generaron una rentabilidad inferior debido a nuestra sobreponderación de una sociedad financiera china propiedad del gobierno central, al cuestionar los mercados el nivel de ayudas públicas de la entidad. Nuestras posiciones en metales y minería, transporte y consumo fueron las que más favorecieron a los resultados. La sobreponderación de la Cartera en metales y minería se vio favorecida por la recuperación de los precios de las materias primas. Nuestra sobreponderación en consumo se benefició de la apertura de las economías y de una recuperación del gasto de los consumidores. Nuestras posiciones en un par de aerolíneas en recuperación contribuyeron a la rentabilidad en el sector de los transportes.

De cara al futuro, nuestras perspectivas para los bonos asiáticos en monedas fuertes son prudentemente optimistas, dado que ofrecen valoraciones atractivas en comparación con los de mercados desarrollados —y, en nuestra opinión, un entorno exterior más favorable ya que los bancos centrales y los gobiernos de todo el mundo mantienen por ahora las políticas acomodaticias—. Sin embargo, el constante resurgimiento de variantes de la COVID-19 mantendrá un elevado nivel de incertidumbre, y las economías irán reabriendo a distinta velocidad y dependerán en gran medida de las campañas de vacunación. Nuestra principal hipótesis es que veremos una recuperación a lo largo de la segunda mitad del año, suponiendo que la vacuna siga siendo eficaz para contener el virus y que no vuelvan a imponerse confinamientos nacionales en las principales economías. La tendencia general de los fundamentales macroeconómicos de la deuda soberana asiática debería mejorar más avanzado el año a medida que las economías se normalicen, gracias también a la sólida demanda externa procedente de las economías desarrolladas. La mayoría de las principales economías asiáticas han gestionado relativamente bien la COVID-19, lo cual debería ayudarlas a generar mejores resultados que otras regiones. Preferimos países donde vemos que las reformas estructurales aportan mejoras significativas en los fundamentales (Indonesia, India y Mongolia). También apostamos por Sri Lanka, donde los niveles actuales nos parecen atractivos dado que el mercado sobrevalora los riesgos bajistas que afronta el país. Mantenemos una infraponderación en países en los que observamos una mayor preocupación por la evolución de los fundamentales a corto plazo (Pakistán). Pensamos que los fundamentales del crédito corporativo asiático se mantendrán estables durante el resto del año gracias a la coyuntura económica, que continúa beneficiando a los bonos corporativos asiáticos. También creemos que las tendencias de las calificaciones se mantendrán estables en la segunda mitad del año, aunque las tasas de impago del año completo serán más altas que las del año pasado, lideradas por los bonos corporativos chinos. A fecha de finales de junio, estamos sobreponderados en el sector financiero, ya que los sistemas financieros asiáticos se ven favorecidos por la recuperación económica. También estamos sobreponderados en el sector de consumo ante la resiliencia y adaptabilidad a la COVID-19 que ha demostrado. Otros sectores donde estamos sobreponderados son metales y minería, pues los altos precios de los metales vienen sustentados por la sólida demanda mundial y las restricciones de oferta. En el sector inmobiliario mantenemos una ponderación neutral al permanecer sólidas las ventas de inmuebles en China, aunque cada vez somos más selectivos debido al endurecimiento del crédito y la normativa para las compañías inmobiliarias chinas.

Neuberger Berman Asian Debt – Hard Currency Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		18.092.371	17.587.672
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	31.205	332.929
Cuentas por cobrar de intermediarios		73.362	70.430
Ingresos a percibir y otros activos		216.915	243.274
Activos totales		18.413.853	18.234.305
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		57.959	11.233
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		–	15.736
Gastos devengados		35.168	36.099
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		705.267	–
Otras cuentas por pagar		20.693	13.851
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		819.087	76.919
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		17.594.766	18.157.386

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Asian Debt – Hard Currency Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		378.371	539.373
Ingresos por préstamo de valores	15	731	–
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(260.221)	(649.306)
		118.881	(109.933)
Gastos			
Comisión de gestión	5	78.165	92.574
Comisión de distribución	5	12.357	18.180
Comisión de administración	5	40.246	39.943
Comisión de compromiso	16	1.732	1.043
Comisión de depósito	5	5.943	5.984
Comisión del Depositario	5	460	1.105
Honorarios profesionales	7	31.475	19.540
Honorarios de los Consejeros	6	2.431	2.375
Costes de transacciones	7	8.915	4.907
Honorarios de auditoría	7	8.756	7.632
Reembolso de IVA		(86)	(75)
Otros gastos	7	14	5.211
Gastos no asumidos	5	(76.136)	(63.939)
Gastos totales		114.272	134.480
Costes financieros			
Gastos por intereses		6	1.091
Repartos de dividendos abonados	1	414.268	672.500
		414.274	673.591
Impuestos retenidos en origen		8	–
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		(409.673)	(918.004)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Asian Debt – Hard Currency Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	18.157.386	25.246.523
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	(409.673)	(918.004)
Suscripciones	2.825.708	5.925.421
Reembolsos	(2.978.655)	(8.326.836)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	17.594.766	21.927.104

Neuberger Berman Asian Debt – Hard Currency Fund (cont.)

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 de empresa 91,43% (31 de diciembre de 2020: 89,03%)					
Dólar estadounidense					
200.000	ABJA Investment Co Pte Ltd*	5,45%	24/01/2028	215.530	1,23
200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd**	4,38%	03/07/2029	209.998	1,19
200.000	AIA Group Ltd*	2,70%	29/12/2049	203.100	1,15
200.000	Alibaba Group Holding Ltd*	4,00%	06/12/2037	225.038	1,28
200.000	Bangkok Bank PCL**	3,73%	25/09/2034	207.894	1,18
200.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*	3,75%	30/03/2026	204.055	1,16
200.000	BOC Aviation Ltd*	3,00%	11/09/2029	205.608	1,17
200.000	CAS Capital No 1 Ltd*	4,00%	29/12/2049	201.400	1,14
200.000	CDBL Funding 2*	2,00%	04/03/2026	199.712	1,14
200.000	Celestial Miles Ltd*	5,75%	29/12/2049	212.924	1,21
200.000	Champion Path Holdings Ltd*	4,85%	27/01/2028	209.585	1,19
200.000	China Construction Bank Corp*	2,45%	24/06/2030	204.359	1,16
200.000	China Evergrande Group*	8,75%	28/06/2025	134.125	0,76
200.000	China Huadian Overseas Development Management Co Ltd*	4,00%	29/12/2049	209.707	1,19
200.000	China Resources Land Ltd*	4,13%	26/02/2029	219.334	1,25
200.000	Chinalco Capital Holdings Ltd*	2,13%	03/06/2026	199.098	1,13
200.000	CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd*	2,00%	26/01/2026	199.162	1,13
200.000	CIFI Holdings Group Co Ltd*	5,95%	20/10/2025	211.501	1,20
200.000	CLP Power HK Finance Ltd*	3,55%	29/12/2049	209.531	1,19
300.000	CMB International Leasing Management Ltd*	1,88%	12/08/2025	297.995	1,69
200.000	Dua Capital Ltd*	2,78%	11/05/2031	199.430	1,13
200.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd*	3,38%	12/05/2026	204.110	1,16
200.000	Formosa Group Cayman Ltd*	3,38%	22/04/2025	212.176	1,21
200.000	Franshion Brilliant Ltd*	4,25%	23/07/2029	199.770	1,14
200.000	FWD Group Ltd*	5,75%	09/07/2024	205.501	1,17
200.000	Greenland Global Investment Ltd*	6,75%	25/06/2022	185.750	1,06
200.000	Haidilao International Holding Ltd*	2,15%	14/01/2026	197.923	1,13
200.000	Haitong International Securities Group Ltd*	3,38%	19/07/2024	210.318	1,20
200.000	Hanwha Life Insurance Co Ltd*	4,70%	29/12/2049	209.516	1,19
200.000	HPHT Finance 21 Ltd*	2,00%	19/03/2026	203.442	1,16
288.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd*	4,00%	29/12/2049	179.640	1,02
200.000	Huarong Finance II Co Ltd*	5,50%	16/01/2025	148.514	0,84
200.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT*	3,40%	09/06/2031	203.117	1,15
200.000	JMH Co Ltd*	2,50%	09/04/2031	202.679	1,15
200.000	JSW Hydro Energy Ltd*	4,13%	18/05/2031	203.188	1,15
200.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	9,38%	30/06/2024	189.250	1,08
200.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	11,70%	11/11/2025	189.039	1,07

Neuberger Berman Asian Debt – Hard Currency Fund (cont.)

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 91,43% (31 de diciembre de 2020: 89,03%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
200.000	Kookmin Bank*	2,50%	04/11/2030	199.314	1,13
200.000	Krung Thai Bank PCL*	4,40%	29/12/2049	203.201	1,15
200.000	LG Chem Ltd*	2,38%	07/07/2031	200.068	1,14
250.000	MCC Holding Hong Kong Corp Ltd*	3,25%	29/12/2049	254.375	1,45
200.000	Medco Oak Tree Pte Ltd*	7,38%	14/05/2026	219.191	1,25
200.000	Meituan*	3,05%	28/10/2030	198.093	1,13
200.000	Melco Resorts Finance Ltd*	5,75%	21/07/2028	211.500	1,20
300.000	Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd*	3,38%	29/12/2049	308.107	1,75
200.000	NWD MTN Ltd*	4,13%	18/07/2029	209.172	1,19
200.000	Oil India Ltd*	5,13%	04/02/2029	224.798	1,28
200.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd**	1,83%	10/09/2030	200.552	1,14
200.000	Periama Holdings LLC*	5,95%	19/04/2026	217.390	1,24
200.000	Pertamina Persero PT*	6,50%	27/05/2041	259.569	1,48
200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	4,88%	17/07/2049	218.530	1,24
200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	6,25%	25/01/2049	252.826	1,44
200.000	Philippine National Bank*	3,28%	27/09/2024	210.503	1,20
200.000	Power Finance Corp Ltd*	3,95%	23/04/2030	206.517	1,17
200.000	RKPF Overseas 2020 A Ltd*	5,20%	12/01/2026	202.047	1,15
200.000	Saka Energi Indonesia PT*	4,45%	05/05/2024	190.148	1,08
200.000	Sands China Ltd*	5,40%	08/08/2028	232.438	1,32
200.000	Shanghai Port Group BVI Development 2 Co Ltd*	2,38%	13/07/2030	201.296	1,14
200.000	Shinhan Financial Group Co Ltd*	5,88%	29/12/2049	215.372	1,22
200.000	Shriram Transport Finance Co Ltd*	4,40%	13/03/2024	200.950	1,14
200.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*	2,30%	08/01/2031	199.639	1,13
200.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*	4,25%	12/09/2028	228.333	1,30
200.000	SK Battery America Inc*	2,13%	26/01/2026	198.508	1,13
200.000	SK Hynix Inc*	2,38%	19/01/2031	195.159	1,11
200.000	SriLankan Airlines Ltd*	7,00%	25/06/2024	136.330	0,77
200.000	Studio City Finance Ltd*	6,50%	15/01/2028	214.741	1,22
200.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd*	3,75%	25/02/2029	220.932	1,26
200.000	Sunac China Holdings Ltd*	6,50%	26/01/2026	193.269	1,10
200.000	Sunac China Holdings Ltd*	7,00%	09/07/2025	196.761	1,12
200.000	Tencent Holdings Ltd*	3,60%	19/01/2028	219.265	1,25
200.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd*	3,75%	18/06/2050	191.539	1,09
200.000	TNB Global Ventures Capital Bhd*	4,85%	01/11/2028	233.424	1,33
200.000	United Overseas Bank Ltd*	2,00%	14/10/2031	200.324	1,14
200.000	Vedanta Resources Ltd*	7,13%	31/05/2023	185.602	1,05
308.000	West China Cement Ltd*	4,95%	08/07/2026	312.235	1,77

Neuberger Berman Asian Debt – Hard Currency Fund (cont.)

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 91,43% (31 de diciembre de 2020: 89,03%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
200.000	Zhejiang Seaport International Co Ltd*	1,98%	17/03/2026	200.816	1,14
200.000	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd*	3,13%	16/07/2025	200.637	1,14
Total dólar estadounidense				16.086.490	91,43
Total bonos de empresa				16.086.490	91,43
Bonos del Estado 11,15% (31 de diciembre de 2020: 7,74%)					
Euro					
200.000	Indonesia Government International Bond	1,10%	12/03/2033	232.483	1,32
200.000	Philippine Government International Bond	1,75%	28/04/2041	235.439	1,34
Total euro				467.922	2,66
Dólar estadounidense					
195.000	Indonesia Government International Bond	7,75%	17/01/2038	295.482	1,68
160.000	Indonesia Government International Bond	8,50%	12/10/2035	256.572	1,46
200.000	Korea Resources Corp	1,75%	15/04/2026	200.936	1,14
200.000	Mongolia Government International Bond	3,50%	07/07/2027	197.091	1,12
200.000	Mongolia Government International Bond	5,13%	05/12/2022	209.003	1,19
200.000	Sri Lanka Government International Bond	5,75%	18/01/2022	184.118	1,05
200.000	Sri Lanka Government International Bond	5,75%	18/04/2023	150.500	0,85
Total dólar estadounidense				1.493.702	8,49
Total bonos del Estado *				1.961.624	11,15
Total inversiones				18.048.114	102,58

Contratos de divisas a plazo 0,13% (31 de diciembre de 2020: 0,07%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
1.250.914 CNY	189.833 USD	09/07/2021	Citibank NA	1	3.676	0,02
650.000 CNY	99.858 USD	09/07/2021	Goldman Sachs International	1	693	0,00
584.071 CNY	90.270 USD	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	132	0,00
6.731 CNY	1.034 USD	08/10/2021	Morgan Stanley	1	0	0,00
7.115.949 INR	94.439 USD	09/07/2021	Citibank NA	1	1.212	0,01
470.676 USD	387.871 €	28/07/2021	BNP Paribas	1	10.447	0,06
194.354 USD	6.093.006 THB	01/07/2021	Citibank NA	1	4.245	0,02
90.511 USD	577.340 CNY	02/07/2021	Citibank NA	1	1.151	0,01
191.451 USD	256.237 SGD	12/07/2021	Citibank NA	1	831	0,01
89.841 USD	2.501.627 TWD	26/07/2021	Citibank NA	1	49	0,00
88.038 USD	2.442.096 TWD	09/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	511	0,00
89.785 USD	2.488.391 TWD	21/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	507	0,00

Neuberger Berman Asian Debt – Hard Currency Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,13% (31 de diciembre de 2020: 0,07%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
7.633 USD	242.783 THB	01/07/2021	Standard Chartered Bank	1	58	0,00
2.215.341.308 VND	95.965 USD	24/08/2021	Citibank NA	1	126	0,00
Clases SGD con cobertura						
29 USD	40 SGD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	0	0,00
139 USD	186 SGD	15/09/2021	UBS AG	1	0	0,00
76.609 USD	102.950 SGD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	2	36	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					23.674	0,13

Contratos de futuros 0,12% (31 de diciembre de 2020: 0,02%)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
1	US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2021	3.937	0,02
2	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2021	16.641	0,10
Plusvalía latente total sobre contratos de futuros ±		20.578	0,12

Contratos de swap de tipos de interés 0,00% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)

Importe notional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/ (Pagar)#	Tipo fijo	Tipo variable	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto	
KRW	100.000.000	05/02/2031	LCH Clearnet Ltd1	Recibir	1,40%	3M KORIBOR	3	0,00
KRW	112.000.000	19/02/2031	LCH Clearnet Ltd1	Recibir	1,50%	3M KORIBOR	2	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de swap de tipos de interés∞						5	0,00	

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

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

1Swap liquidada centralmente.

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	18.092.371	102,83

Neuberger Berman Asian Debt – Hard Currency Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,15%) (31 de diciembre de 2020: (0,05%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
800.000 CNY	124.712 USD	09/07/2021	Morgan Stanley	1	(957)	(0,01)
14.156.983 INR	191.322 USD	16/09/2021	Citibank NA	1	(2.667)	(0,01)
10.051.046 KRW	8.983 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(89)	(0,00)
106.977.127 KRW	95.866 USD	16/07/2021	Citibank NA	1	(1.198)	(0,01)
171.954.523 KRW	154.791 USD	09/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(2.616)	(0,01)
195.064.814 KRW	172.731 USD	21/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(113)	(0,00)
800.485 MYR	194.204 USD	15/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(1.616)	(0,01)
8.794.547 PHP	180.014 USD	26/07/2021	Citibank NA	2	(324)	(0,00)
255.314 SGD	192.864 USD	12/07/2021	Citibank NA	1	(2.930)	(0,02)
5.722.338 THB	179.482 USD	01/07/2021	Citibank NA	2	(938)	(0,01)
613.451 THB	19.687 USD	01/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(547)	(0,00)
2.868.646 TWD	103.940 USD	09/07/2021	Citibank NA	1	(1.125)	(0,01)
95.360 USD	7.256.911 INR	09/07/2021	Citibank NA	1	(2.186)	(0,01)
418.803 USD	2.757.244 CNY	09/07/2021	Citibank NA	1	(7.728)	(0,04)
90.332 USD	121.601 SGD	26/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(126)	(0,00)
89.767 USD	2.501.627 TWD	26/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(25)	(0,00)
1.041 USD	6.731 CNY	02/07/2021	Morgan Stanley	1	(0)	(0,00)
90.449 USD	121.600 SGD	26/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(9)	(0,00)
Clases SGD con cobertura						
295 SGD	220 USD	15/09/2021	Standard Chartered Bank	1	(0)	(0,00)
191.831 SGD	144.466 USD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	5	(1.782)	(0,01)
46 SGD	35 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	(0)	(0,00)
64.612 USD	86.894 SGD	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	(20)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					(26.996)	(0,15)

Contratos de futuros (0,18%) (31 de diciembre de 2020: (0,01%))

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(1)	Euro-Bund Future September 2021	(1.708)	(0,01)
(1)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2021	(5.455)	(0,03)
(34)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2021	(23.734)	(0,14)
Minusvalía latente total sobre contratos de futuros ±		(30.897)	(0,18)

Neuberger Berman Asian Debt – Hard Currency Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de swaps de tipos de interés (0,00%) (31 de diciembre de 2020: (0,00%))

Importe nocional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar)#	Tipo fijo	Tipo variable	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto	
CNY	1.200.000	01/07/2026	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	2,78%	7D CNRR007	(2)	(0,00)
THB	6.600.000	01/03/2026	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,00%	6M BKIBOR	(17)	(0,00)
THB	6.500.000	10/03/2026	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,10%	6M BKIBOR	(47)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de swap de tipos de interés[∞]						(66)	(0,00)	

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

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

¹Swap liquidada centralmente.

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(57.959)	(0,33)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	18.034.412	102,50
Otro pasivo neto	(439.646)	(2,50)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	17.594.766	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	17.429.670	94,66
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	618.444	3,36
± Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	(10.319)	(0,06)
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(3.383)	(0,02)
Total inversiones	18.034.412	97,94

Neuberger Berman Asian Debt – Hard Currency Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
520.000	Haidilao International Holding Ltd, 2.15%, 14/01/2026	519.261
500.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT, 3.40%, 09/06/2031	500.000
400.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 6.35%, 13/01/2027	400.000
400.000	CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd, 2.00%, 26/01/2026	399.868
400.000	Bharti Airtel International Netherlands BV, 3.25%, 03/06/2031	399.632
400.000	SK Hynix Inc, 2.38%, 19/01/2031	395.952
320.000	GLP China Holdings Ltd, 2.95%, 29/03/2026	316.739
308.000	West China Cement Ltd, 4.95%, 08/07/2026	308.000
200.000	Pertamina Persero PT, 6.50%, 27/05/2041	256.000
250.000	Malaysia Wakala Sukuk, 6.25%, 08/06/2024	250.000
250.000	China Hongqiao Group Ltd, 3.08%, 28/04/2051	250.000
200.000	Indonesia Government International Bond, 1.10%, 12/03/2033	243.480
200.000	Philippine Government International Bond, 1.75%, 28/04/2041	238.285
200.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 8.30%, 27/05/2025	215.500
200.000	CIFI Holdings Group Co Ltd, 5.95%, 20/10/2025	212.000
200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd, 4.38%, 03/07/2029	211.616
200.000	FWD Group Ltd, 5.75%, 09/07/2024	211.450
200.000	Mongolia Government International Bond, 5.13%, 05/12/2022	209.800
200.000	Melco Resorts Finance Ltd, 5.63%, 17/07/2027	208.900
200.000	BOC Aviation Ltd, 3.00%, 11/09/2029	205.000
200.000	JSW Hydro Energy Ltd, 4.13%, 18/05/2031	200.000
200.000	Vedanta Resources, 8.95%, 11/03/2025	200.000
200.000	Studio City Finance Ltd, 5.00%, 15/01/2029	200.000
200.000	Continuum Energy Levante, 4.50%, 09/02/2027	200.000
200.000	Islamic Republic of Pakistan, 7.38%, 08/04/2031	200.000
200.000	AIA Group Ltd, 2.70%, 29/12/2049	200.000
200.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT, 3.75%, 30/03/2026	200.000
200.000	Greenko Dutch BV, 3.85%, 29/03/2026	200.000
200.000	Powerchina Real Estate Group Ltd, 3.08%, 29/12/2049	200.000
200.000	China Oil & Gas Group, 4.70%, 30/06/2026	200.000
200.000	Krung Thai Bank PCL, 4.40%, 29/12/2049	200.000
200.000	Sunac China Holdings Ltd, 6.50%, 26/01/2026	200.000
200.000	Shimao Group Holdings Ltd, 3.45%, 11/01/2031	200.000
200.000	Indian Railway Finance, 2.80%, 10/02/2031	200.000
200.000	Champion Path Holdings, 4.50%, 27/01/2026	200.000

Neuberger Berman Asian Debt – Hard Currency Fund (cont.)

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	Dua Capital Ltd, 2.78%, 11/05/2031	200.000
200.000	CAS Capital No 1 Ltd, 4.00%, 29/12/2049	200.000
200.000	RKPF Overseas 2020 A Ltd, 5.20%, 12/01/2026	200.000
200.000	Champion Path Holdings Ltd, 4.85%, 27/01/2028	200.000
200.000	Shriram Transport Finance Co Ltd, 4.40%, 13/03/2024	199.980
200.000	Alibaba Group Holding Ltd, 3.25%, 09/02/2061	199.956
200.000	Sunac China Holdings Ltd, 5.95%, 26/04/2024	199.936
200.000	LG Chem Ltd, 2.38%, 07/07/2031	199.912
200.000	Country Garden Holding, 2.70%, 12/07/2026	199.888
200.000	CDBL Funding 2, 2.00%, 04/03/2026	199.868
200.000	China Overseas Property Holdings Ltd, 2.45%, 09/02/2026	199.832
200.000	Sinopec Group Overseas Development 201 Ltd, 1.45%, 08/01/2026	199.732
200.000	HPHT Finance 21 Ltd, 2.00%, 19/03/2026	199.726
200.000	Alibaba Group Holding Ltd, 2.13%, 09/02/2031	199.678
200.000	NAVER Corp, 1.50%, 29/03/2026	199.588
200.000	Zhejiang Seaport, 1.98%, 17/03/2026	199.574
200.000	Hana Bank, 1.25%, 16/12/2026	199.524
200.000	REC Limited, 2.25%, 01/09/2026	199.456
200.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd, 3.38%, 12/05/2026	199.316
200.000	Singapore Airlines Ltd, 3.00%, 20/07/2026	199.146
200.000	SK Battery America Inc, 2.13%, 26/01/2026	199.124
200.000	United Overseas Bank Ltd, 2.00%, 14/10/2031	199.110
200.000	Korea Resources Corp, 1.75%, 15/04/2026	199.020
200.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 2.30%, 08/01/2031	198.972
200.000	Chinalco Capital Holdings Ltd, 2.13%, 03/06/2026	198.890
200.000	JMH Co Ltd, 2.50%, 09/04/2031	198.040
200.000	Indonesia Government International Bond, 3.05%, 12/03/2051	198.040
200.000	China Cinda Management 2020 I Ltd, 3.00%, 20/01/2031	197.918
200.000	BOC Aviation Ltd, 1.75%, 21/01/2026	197.782
200.000	GC Treasury Center Co Ltd, 2.98%, 18/03/2031	197.356
200.000	Mongolia Government International Bond, 3.50%, 07/07/2027	197.336
200.000	China Cinda 2020 I Management, 2.50%, 20/01/2028	197.288
200.000	Yunda Holding Investment Ltd, 2.25%, 19/08/2025	197.000
200.000	China Evergrande Group, 6.25%, 28/06/2021	196.000
200.000	China Evergrande Group, 8.25%, 23/03/2022	188.700
200.000	Kaisa Group Holdings Ltd, 9.38%, 30/06/2024	186.500
200.000	Vedanta Resources Ltd, 7.13%, 31/05/2023	185.750

Neuberger Berman Asian Debt – Hard Currency Fund (cont.)

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
500.000	Yunda Holding Investment Ltd, 2.25%, 19/08/2025	493.020
500.000	China Evergrande Group, 6.25%, 28/06/2021	489.600
400.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 6.35%, 13/01/2027	400.200
400.000	Bharti Airtel International Netherlands BV, 3.25%, 03/06/2031	398.336
400.000	Vedanta Resources Ltd, 6.38%, 30/07/2022	377.200
400.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 8.30%, 27/05/2025	372.000
200.000	Indonesia Government International Bond, 8.50%, 12/10/2035	322.175
320.000	GLP China Holdings Ltd, 2.95%, 29/03/2026	319.910
320.000	Haidilao International Holding Ltd, 2.15%, 14/01/2026	319.565
300.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT, 3.40%, 09/06/2031	300.000
250.000	Reliance Industries Ltd, 3.67%, 30/11/2027	270.648
250.000	Nanyang Commercial Bank Ltd, 3.80%, 20/11/2029	261.665
250.000	Malaysia Wakala Sukuk, 3.08%, 28/04/2051	255.243
250.000	China Hongqiao Group Ltd, 6.25%, 08/06/2024	252.625
200.000	Petronas Capital Ltd, 4.55%, 21/04/2050	240.580
200.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4.25%, 19/06/2024	219.368
200.000	CNOOC Ltd, 4.25%, 30/04/2024	217.486
200.000	Mongolia Government International Bond, 5.13%, 07/04/2026	214.600
200.000	Minera y Metalurgica del Boleo SAPI de CV, 3.25%, 17/04/2024	213.876
200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd, 4.20%, 04/08/2027	213.830
200.000	Network i2i Ltd, 5.65%, 29/12/2049	213.750
200.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT, 3.75%, 11/04/2024	212.770
200.000	Baidu Inc, 3.08%, 07/04/2025	211.584
200.000	Studio City Finance Ltd, 6.00%, 15/07/2025	211.100
200.000	Hyundai Capital America, 3.00%, 10/02/2027	210.488
200.000	Sunac China Holdings Ltd, 8.35%, 19/04/2023	210.000
200.000	Melco Resorts Finance Ltd, 5.63%, 17/07/2027	209.750
200.000	Country Garden Holdings Co Ltd, 4.80%, 06/08/2030	209.702
200.000	Agile Group Holdings Ltd, 5.75%, 02/01/2025	206.250
200.000	Singapore Airlines Ltd, 3.00%, 20/07/2026	204.984
200.000	Greenko Dutch BV, 3.85%, 29/03/2026	204.640
200.000	Champion Path Holdings Ltd, 4.50%, 27/01/2026	204.600
200.000	CK Hutchison Capital Securities 17 Ltd, 4.00%, 29/12/2049	204.000
200.000	Tencent Holdings Ltd, 3.24%, 03/06/2050	203.964
200.000	Continuum Energy Levante, 4.50%, 09/02/2027	203.100
200.000	Contemporary Ruiding Development Ltd, 1.88%, 17/09/2025	202.350
200.000	Islamic Republic of Pakistan, 7.38%, 08/04/2031	202.320
200.000	China Oil & Gas Group, 4.70%, 30/06/2026	201.800
200.000	AYC Finance Ltd, 4.85%, 29/12/2049	201.750

Neuberger Berman Asian Debt – Hard Currency Fund (cont.)

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
200.000	Bluestar Finance Holdings Ltd, 3.38%, 16/07/2024	201.720
200.000	Shimao Group Holdings Ltd, 3.45%, 11/01/2031	201.600
200.000	China Overseas Property Holdings Ltd, 2.45%, 09/02/2026	201.488
200.000	SK Hynix Inc, 2.38%, 19/01/2031	201.350
200.000	Sinopec Group Overseas Development 201 Ltd, 1.45%, 08/01/2026	201.304
200.000	Indonesia Government International Bond, 3.05%, 12/03/2051	201.100
200.000	Alibaba Group Holding Ltd, 2.13%, 09/02/2031	201.060
200.000	Sunac China Holdings Ltd, 5.95%, 26/04/2024	200.750
200.000	CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd, 2.00%, 26/01/2026	200.250
200.000	Studio City Finance Ltd, 5.00%, 15/01/2029	200.100
200.000	Powerchina Real Estate Group Ltd, 3.08%, 29/12/2049	200.020
200.000	Kaisa Group Holdings Ltd, 11.25%, 16/04/2025	200.000
200.000	Country Garden Holding, 2.70%, 12/07/2026	199.800
200.000	Sinopec Group Overseas Development 201 Ltd, 3.35%, 13/05/2050	199.722
200.000	Hana Bank, 1.25%, 16/12/2026	199.660
200.000	NAVER Corp, 1.50%, 29/03/2026	199.560
200.000	GC Treasury Centre Co, 2.98%, 18/03/2031	199.446
200.000	BOC Aviation Ltd, 1.75%, 21/01/2026	198.778
200.000	China Cinda Management 2020 I Ltd, 3.00%, 20/01/2031	198.398
200.000	AIA Group Ltd, 3.20%, 16/09/2040	197.368
200.000	Indian Railway Finance, 2.80%, 10/02/2031	197.000
200.000	REC Ltd, 2.25%, 01/09/2026	195.128
200.000	Vedanta Resources Ltd, 8.95%, 11/03/2025	194.600
200.000	China Evergrande Group, 8.25%, 23/03/2022	193.660
200.000	China Cinda Management 2020 I Ltd, 2.50%, 20/01/2028	192.680
200.000	MTR Corp Ltd, 1.63%, 19/08/2030	189.880
200.000	Alibaba Group Holding Ltd, 3.25%, 09/02/2061	184.794
130.000	Indonesia Government International Bond, 1.40%, 30/10/2031	167.077

Neuberger Berman China Bond Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de Distribución CNY I en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 2,08%. En el mismo periodo, el índice FTSE Chinese Government and Policy Bank Bond 0-1 Year Select (CNY, Total Return) avanzó un 1,41%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Los activos de renta fija de China continental rindieron un 2,6%* en CNY y un 3,1% en USD durante el periodo analizado, una sólida rentabilidad en comparación con otras clases de activos de renta fija global. Los bonos continentales chinos sufrieron una fuerte corriente de ventas en el primer trimestre, al igual que sus homólogos globales, pero con una beta mucho más baja. La economía china ya experimentó un pronunciado rebote inicial pospandemia el pasado año y se prevé un ritmo de crecimiento más sostenible para este. Habida cuenta de que es probable que la dinámica de crecimiento económico ya haya tocado techo y que el banco central adopte una postura más neutral (en comparación con su benevolencia previa), las rentabilidades cedieron terreno en el segundo trimestre. Los títulos de crédito con calificación elevada se han comportado bien, en consonancia con el repunte de los bonos de deuda soberana. Sin embargo, los inversores se han mostrado más cautos con los bonos de alta rentabilidad. Los reguladores han tenido mano dura con el endeudamiento excesivo de las empresas inmobiliarias. La idea de las garantías públicas implícitas siguió poniéndose en duda, tal y como se puso de manifiesto en el conocido caso de Huarong Asset Management, la mayor gestora de deuda en dificultades de empresas públicas. En general, los bonos de alta rentabilidad denominados en USD de China no continental se vieron más afectados que sus homólogos continentales.

La Cartera ha mantenido una duración baja durante el periodo analizado y la mayor parte de la rentabilidad superior procedió del carry y de la contracción de los diferenciales. La significativa asignación al sector inmobiliario experimentó presiones, pero la rentabilidad fue aceptable debido al sesgo hacia una duración corta y a la selección de valores. Las posiciones en sectores relacionados con las materias primas realizaron una contribución positiva a los resultados.

Habida cuenta de la ralentización del impulso del crédito y de las reformas en múltiples frentes, desde el endeudamiento de las constructoras y empresas públicas locales/vehículos de financiación del gobierno local ("LGFV") hasta la protección del medio ambiente y las empresas tecnológicas, la idea de consenso es que la dinámica del crecimiento ha empezado a moderarse. Sin embargo, un crecimiento del PIB a un ritmo del 5-6% y una financiación agregada superior al 10% interanual siguen siendo unos buenos datos. Por otra parte, las autoridades disponen de margen para realizar ajustes políticos que eviten a la economía aterrizajes forzosos. Asimismo, creemos que es posible que los precios de producción hayan tocado techo en mayo, con una lectura interanual de junio ya más moderada. La combinación de ralentización del crecimiento y contención de la inflación favorece a los activos de renta fija. Los impagos siguen acaparando los titulares, pero la tasa de impagos parte de un nivel muy bajo hacia las normas internacionales, ya que las garantías estatales implícitas ya no son tan generalizadas como antes. Esto es positivo a medio y largo plazo. El RMB registró un excelente comportamiento, reflejando los sólidos fundamentales de la economía. Seguimos siendo optimistas con respecto a sus fundamentales.

Nota:

*medido por el índice China Bond New Composite Total Return.

Neuberger Berman China Bond Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 CNY	A 31 de diciembre de 2020 CNY
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		650.612.695	562.439.245
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	18.243.962	8.167.583
Cuentas a percibir por acciones emitidas		349.423	–
Cuentas por cobrar de intermediarios		506.388	236.640
Ingresos a percibir y otros activos		14.342.887	11.534.649
Activos totales		684.055.355	582.378.117
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		3.447.279	3.760.596
Descubierto bancario	3	–	59
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		–	1.033.056
Gastos devengados		510.844	412.936
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		4.471.103	257
Otras cuentas por pagar		347.811	192.322
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		8.777.037	5.399.226
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		675.278.318	576.978.891

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman China Bond Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 CNY	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 CNY
Ingresos			
Ingresos por intereses		14.579.937	22.244.311
Ingresos por préstamo de valores	15	35.674	29.201
Ingresos varios		64.668	–
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(7.477.562)	8.638.693
		7.202.717	30.912.205
Gastos			
Comisión de gestión	5	798.065	2.283.601
Comisión de distribución	5	5.054	1.262.553
Comisión de administración	5	413.244	575.552
Comisión de compromiso	16	70.749	44.370
Comisión de depósito	5	219.577	191.381
Comisión del Depositario	5	16.005	41.238
Honorarios profesionales	7	318.854	233.919
Honorarios de los Consejeros	6	16.458	16.623
Costes de transacciones	7	259.732	471.907
Honorarios de auditoría	7	101.782	83.640
Reembolso de IVA		(2.800)	(3.156)
Otros gastos	7	23.832	74.430
Gastos no asumidos	5	(609.377)	(651.238)
Gastos totales		1.631.175	4.624.820
Costes financieros			
Gastos por intereses		6.380	3.382
Repartos de dividendos abonados	1	230.275	939.704
		236.655	943.086
Impuestos retenidos en origen		–	410
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		5.334.887	25.343.889

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman China Bond Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 CNY	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 CNY
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	576.978.891	816.862.588
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	5.334.887	25.343.889
Suscripciones	112.450.493	317.286.021
Reembolsos	(19.485.953)	(399.372.685)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	675.278.318	760.119.813

Neuberger Berman China Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Importe principal	Descripción de los valores	Cupón	Fecha de vencimiento	Valor razonable CNY	% del Patrimonio neto
Certificado de depósito 14,43% (31 de diciembre de 2020: 20,50%)					
Yuan renminbi chino					
30.000.000	Bank of Communications Co Ltd*	3,01%	10/03/2022	29.146.680	4,32
30.000.000	China Construction Bank Corp*	0,00%	07/04/2022	29.150.160	4,32
10.000.000	China Construction Bank Corp*	0,00%	22/04/2022	9.713.365	1,44
30.000.000	China Merchants Bank Co Ltd*	0,00%	26/11/2021	29.387.265	4,35
Total certificado de depósito				97.397.470	14,43
Bonos de empresa 73,49% (31 de diciembre de 2020: 69,66%)					
Yuan renminbi chino					
7.000.000	Aoyuan Corp. Group Ltd*	5,85%	12/10/2021	6.969.820	1,03
6.000.000	BYD Co Ltd*	4,60%	22/02/2024	6.069.441	0,90
30.000.000	Central Huijin Investment Ltd**	2,92%	19/06/2023	29.880.015	4,43
20.000.000	Central Huijin Investment Ltd**	3,52%	26/09/2024	20.132.290	2,98
2.290.000	China Everbright Bank Co Ltd*	1,80%	17/03/2023	2.656.400	0,39
10.000.000	Everbright Securities Co Ltd*	3,70%	28/08/2023	10.102.010	1,50
10.000.000	Fusun Hi-Tech Group*	4,98%	28/01/2022	9.995.650	1,48
10.000.000	Fusun Hi-Tech Group*	5,15%	22/02/2024	10.018.675	1,48
10.000.000	Giant Leap*	4,27%	08/01/2025	10.064.245	1,49
5.000.000	Giant Leap*	4,28%	15/09/2024	5.058.325	0,75
920.000	Giant Leap Technologies A/S*	3,90%	21/10/2023	921.572	0,13
10.000.000	Henan Energy & Chemical Industry Group Co Ltd**	7,00%	20/09/2023	3.297.000	0,49
10.000.000	Henan Energy & Chemical Industry Group Co Ltd**	7,20%	06/09/2021	3.220.500	0,48
17.000.000	Hengyi Petrochem Regd**	0,00%	13/03/2023	16.958.469	2,51
8.000.000	Jinke Properties Group Co Ltd*	6,00%	20/02/2023	8.025.760	1,19
13.000.000	Jizhong Energy Group Co Ltd**	5,40%	14/11/2021	11.535.550	1,71
7.000.000	Nanshan Group Co Ltd*	4,50%	29/08/2021	6.965.837	1,03
17.000.000	Order Group Co Ltd*	4,70%	22/08/2023	16.978.452	2,51
16.000.000	Rongxin Fujian Investment Group Co Ltd*	6,45%	03/07/2023	16.033.912	2,37
10.000.000	Seazen Holdings Co Ltd**	5,25%	14/04/2022	10.043.865	1,49
10.000.000	Seazen Holdings Co Ltd**	5,90%	20/03/2024	10.031.155	1,49
10.000.000	Shandong Iron & Steel Group Co Ltd*	4,71%	15/09/2021	9.990.600	1,48
20.000.000	Shandong Weiqiao Aluminum & Power Co Ltd*	4,00%	17/10/2023	19.938.850	2,95
5.982.000	Shanghai Powerlong Industrial Development Group Co Ltd*	6,67%	20/01/2025	5.997.224	0,89
11.500.000	Shanghai Powerlong Industrial Development Group Co Ltd*	7,20%	20/11/2024	11.570.679	1,71
20.000.000	Shanghai Shimao Jianshe Co Ltd*	4,15%	16/10/2022	19.785.840	2,93
18.000.000	Shanghai Yuyuan Tourist Mart Group Co Ltd*	4,97%	26/11/2023	18.125.064	2,68
20.000.000	Shanxi Coal Import & Export Group Co Ltd*	3,95%	25/08/2021	19.951.310	2,95
10.000.000	Shenzhen Investment Holdings Co Ltd*	2,29%	07/05/2023	9.883.575	1,46
9.760.000	Sunac Real Estate Group Co Ltd*	4,00%	16/08/2023	9.749.933	1,44

Neuberger Berman China Bond Fund (cont.)

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 CNY	% del Patrimonio neto
Bonos de empresa 73,49% (31 de diciembre de 2020: 69,66%) (cont.)					
Yuan renminbi chino (cont.)					
9.000.000	Sunac Real Estate Group Co Ltd*	4,78%	01/04/2024	8.929.490	1,32
5.000.000	Sunshine City Group Shaanxi Industrial Co Ltd*	7,00%	31/10/2022	4.924.412	0,73
20.000.000	Times China Holding Ltd*	8,10%	10/12/2023	20.310.640	3,01
10.000.000	Yango Group Co Ltd**	7,40%	24/03/2022	9.958.820	1,48
5.000.000	Zhejiang Hengyi Group Co Ltd*	6,50%	04/11/2021	4.992.220	0,74
10.000.000	Zhejiang Rongsheng Holding Group Co Ltd*	5,60%	13/10/2021	10.060.305	1,49
Total yuan renminbi chino				399.127.905	59,09
Dólar estadounidense					
1.200.000	Champion Sincerity Holdings Ltd*	8,13%	29/12/2049	7.995.302	1,18
2.000.000	CIFI Holdings Group Co Ltd*	5,95%	20/10/2025	13.664.756	2,03
400.000	CIFI Holdings Group Co Ltd*	6,00%	16/07/2025	2.720.183	0,40
500.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	8,50%	30/06/2022	3.223.965	0,48
300.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	10,88%	23/07/2023	1.940.877	0,29
500.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	11,25%	16/04/2025	3.060.947	0,45
700.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	11,95%	22/10/2022	4.652.054	0,69
300.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	11,95%	12/11/2023	1.989.324	0,29
700.000	Logan Group Co Ltd*	4,85%	14/12/2026	4.557.921	0,68
1.800.000	Logan Group Co Ltd*	7,50%	27/08/2021	11.729.709	1,74
200.000	New Metro Global Ltd*	6,80%	05/08/2023	1.345.618	0,20
550.000	Ronshine China Holdings Ltd*	11,25%	22/08/2021	3.573.455	0,53
500.000	Sunac China Holdings Ltd*	6,50%	09/07/2023	3.291.357	0,49
1.000.000	Sunac China Holdings Ltd*	7,00%	09/07/2025	6.356.226	0,94
500.000	Sunac China Holdings Ltd*	7,95%	11/10/2023	3.333.897	0,49
650.000	Sunac China Holdings Ltd*	8,35%	19/04/2023	4.355.050	0,65
2.000.000	Unigroup International Holdings Ltd*	6,00%	10/12/2020	3.811.901	0,57
692.000	West China Cement Ltd*	4,95%	08/07/2026	4.532.383	0,67
1.800.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd*	8,50%	04/02/2023	11.033.703	1,63
Total dólar estadounidense				97.168.628	14,40
Total bonos de empresa				496.296.533	73,49
Bonos del Estado 7,45% (31 de diciembre de 2020: 5,26%)					
Yuan renminbi chino					
20.000.000	China Development Bank	3,18%	17/05/2022	20.129.730	2,98
20.000.000	China Development Bank	3,30%	03/03/2026	20.072.440	2,97
10.000.000	China Government Bond	3,27%	19/11/2030	10.141.665	1,50
Total bonos del Estado **				50.343.835	7,45
Total inversiones				644.037.838	95,37

Neuberger Berman China Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,97% (31 de diciembre de 2020: 2,06%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente CNY	% del Patrimonio neto
56.875.301 CNY	8.393.388 USD	12/11/2021	Citibank NA	1	2.130.697	0,32
18.960.128 CNY	2.900.000 USD	13/07/2021	Citibank NA	1	207.985	0,03
15.627.312 CNY	2.400.000 USD	19/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	66.742	0,01
Clases USD con cobertura						
56.736.073 USD	364.441.100 CNY	15/09/2021	Westpac Banking Corp	1	4.135.312	0,61
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					6.540.736	0,97

Contratos de futuros 0,01% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente CNY	% del Patrimonio neto
(26)	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2021	34.121	0,01
Plusvalía latente total sobre contratos de futuros ±		34.121	0,01

Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	Valor razonable CNY	% del Patrimonio neto
	650.612.695	96,35

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,50%) (31 de diciembre de 2020: (0,64%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente CNY	% del Patrimonio neto
13.842.360 CNY	2.100.000 USD	24/05/2022	JPMorgan Chase Bank	1	(33.314)	(0,01)
16.220.233 CNY	2.500.000 USD	24/09/2021	UBS AG	1	(31.368)	(0,00)
11.322.796 CNY	1.750.000 USD	13/12/2021	UBS AG	1	(115.188)	(0,02)
3.000.000 USD	20.197.917 CNY	12/11/2021	Citibank NA	1	(630.871)	(0,09)
100.000 USD	665.769 CNY	12/11/2021	Goldman Sachs International	2	(13.534)	(0,00)
Clases EUR con cobertura						
4.110.866 €	32.411.706 CNY	19/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(863.192)	(0,13)
4.049.538 €	31.939.451 CNY	19/07/2021	UBS AG	1	(861.594)	(0,13)
3.989.097 €	31.443.539 CNY	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(829.531)	(0,12)
Clases de acumulación con cobertura 12 GBP						
21.992 £	200.058 CNY	15/09/2021	UBS AG	1	(2.665)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					(3.381.257)	(0,50)

Neuberger Berman China Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de futuros (0,01%) (31 de diciembre de 2020: (0,01%))

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente CNY	% del Patrimonio neto
(27)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2021	(66.022)	(0,01)
Minusvalía latente total sobre contratos de futuros *		(66.022)	(0,01)
		Valor razonable CNY	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(3.447.279)	(0,51)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados		647.165.416	95,84
Otro activo neto		28.112.902	4,16
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		675.278.318	100,00
Análisis de la cartera		CNY	% de los Activos totales
*	Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	478.636.339	69,97
**	Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	165.401.499	24,18
±	Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	(31.901)	(0,00)
∞	Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	3.159.479	0,46
Total inversiones		647.165.416	94,61

Neuberger Berman China Bond Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste CNY
36.350.000	Evergrande Real Estate Group, 6.27%, 06/05/2023	34.999.417
30.000.000	China Development Bank, 3.70%, 20/10/2030	30.247.750
30.000.000	Central Huijin Investment Ltd, 2.92%, 19/06/2023	29.678.380
30.000.000	China Merchants Bank Co Ltd, 0.00%, 26/11/2021	29.344.380
30.000.000	Bank of Communications Co Ltd, 3.01%, 10/03/2022	29.200.544
30.000.000	China Construction Bank Corp, 0.00%, 07/04/2022	29.129.473
28.000.000	Sunshine City Group, 5.80%, 12/04/2022	28.017.060
20.000.000	Times China Holding Ltd, 8.10%, 10/12/2023	20.421.000
20.000.000	Central Huijin Investment Ltd, 3.52%, 26/09/2024	20.102.520
20.000.000	China Development Bank, 3.66%, 01/03/2031	20.007.740
20.000.000	China Development Bank, 3.30%, 03/03/2026	19.985.500
18.000.000	Shanghai Yuyuan Tourist Mart Group Co Ltd, 4.97%, 26/11/2023	18.131.550
17.000.000	Yuzhou Group, 6.98%, 03/04/2024	16.978.900
16.000.000	Rongxin Fujian Investment Group Co Ltd, 6.45%, 03/07/2023	16.006.780
15.501.000	Shandong Weiqiao Aluminum & Power Co Ltd, 4.00%, 17/10/2023	15.361.807
13.000.000	Wumei Holdings Inc, 3.30%, 17/04/2021	13.034.320
11.500.000	Shanghai Powerlong Industrial Development Group Co Ltd, 7.20%, 20/11/2024	11.535.200
10.000.000	China Government Bond, 3.27%, 19/11/2030	10.095.040
10.000.000	Everbright Securities Co Ltd, 3.70%, 28/08/2023	10.034.400
10.000.000	Seazen Holdings Co., Ltd, 5.90%, 20/03/2024	10.027.200
10.000.000	Shandong Iron & Steel Group Co Ltd, 4.71%, 15/09/2021	10.000.000
10.000.000	Fusun Hi-Tech Group, 4.98%, 28/01/2022	9.988.340
10.000.000	Giant Leap, 4.27%, 08/01/2025	9.960.000
10.000.000	Sunshine City Group, 7.40%, 24/03/2022	9.864.820
10.000.000	Shenzhen Investment Holdings Co Ltd, 2.29%, 07/05/2023	9.739.500
10.000.000	China Construction Bank Corp, 0.00%, 22/04/2022	9.718.491
9.760.000	Sunac Real Estate Group Co Ltd, 4.00%, 16/08/2023	9.662.400
9.000.000	Seazen Holdings Co Ltd, 5.60%, 20/03/2023	8.995.500
9.000.000	Sunac Real Estate Group Co Ltd, 4.78%, 01/04/2024	8.870.130
8.000.000	Jinke Properties Group Co Ltd, 6.00%, 20/02/2023	7.982.720
7.000.000	Nanshan Group Co Ltd, 4.50%, 29/08/2021	6.951.200
1.000.000	China SCE Group Holdings Ltd, 5.95%, 29/09/2024	6.513.650
1.000.000	Greenland Global Investment Ltd, 6.25%, 16/12/2022	6.204.336

Neuberger Berman China Bond Fund (cont.)

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
30.000.000	China Development Bank, 3.70%, 20/10/2030	30.011.084
30.000.000	Agricultural Bank of China, 3.32%, 18/02/2021	29.768.340
20.000.000	China Development Bank, 3.66%, 01/03/2031	20.108.770
20.000.000	Bank of Communications Co Ltd, 3.00%, 30/04/2021	19.981.075
20.000.000	Bank of China Ltd, 3.00%, 26/05/2021	19.945.908
20.000.000	Bank of China Ltd, 3.23%, 30/07/2021	19.843.562
2.200.000	China Evergrande Group, 6.25%, 28/06/2021	13.925.389
10.000.000	China Government Bond, 3.81%, 14/09/2050	10.160.470
1.500.000	Agile Group Holdings Ltd, 5.75%, 02/01/2025	10.009.339
10.000.000	China Construction Bank, 4.62%, 14/01/2021	9.932.960
1.300.000	Bi Hai Co Ltd, 6.25%, 05/03/2022	8.200.788
8.300.000	Evergrande Real Estate Group, 6.27%, 06/05/2023	7.933.374
1.000.000	China SCE Group Holdings Ltd, 5.95%, 29/09/2024	6.489.069
3.880.000	Chengtun Mining Group Co Ltd, 0.40%, 02/03/2026	6.282.557
1.000.000	Greenland Global Investment Ltd, 6.25%, 16/12/2022	6.174.823
900.000	Sunac China Holdings Ltd, 7.00%, 09/07/2025	5.905.542
750.000	China Hongqiao Group Ltd, 6.25%, 08/06/2024	4.839.070
3.833.000	Huaibei Mining Holdings Co Ltd, 0.50%, 23/12/2025	4.397.562
600.000	CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd, 2.00%, 26/01/2026	3.882.561
600.000	Yuzhou Group, 6.35%, 13/01/2027	3.865.782
12.970.000	Tsinghua Unigroup Co Ltd, 4.94%, 25/03/2022	3.372.200
2.700.000	Guotai Junan Securities Co Ltd, 1.50%, 07/07/2023	3.172.748
480.000	Haidilao International Holding Ltd, 2.15%, 14/01/2026	3.097.123
3.000.000	Hengyi Petrochem Regd, 0.00%, 13/03/2023	2.976.000

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I EUR en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 0,86%. En el mismo periodo, el índice de referencia, el ICE BofA Global Hybrid Non-Financial 5% Constrained Custom (rentabilidad total en EUR con cobertura) (el "Índice"), se anotó una rentabilidad del 1,32%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

El primer trimestre del año estuvo marcado por el aumento de los rendimientos de los bonos y las expectativas de inflación, siendo por tanto un periodo difícil para el crédito, a pesar del buen comportamiento de las bolsas. Este comportamiento vino inducido principalmente por dos factores clave: la victoria de los demócratas en Georgia a comienzos del año y el éxito de la administración de vacunas en el Reino Unido y Estados Unidos. En marzo también asistimos a la confirmación del paquete de estímulos propuesto por el presidente Biden, cuyo valor alcanzó nada menos que un 9% del PIB estadounidense.

Entrando ya en el segundo trimestre, los mercados de activos de riesgo se movieron ligeramente al alza, con modestas ganancias tanto de la renta variable como del crédito, incluidos los híbridos corporativos. Los datos económicos continuaron señalando un crecimiento más sólido en el transcurso de los próximos meses, favorecido por la política monetaria acomodaticia y el gasto presupuestario.

En cuanto a la inflación, que sigue suscitando inquietud entre los inversores, el indicador de inflación subyacente en la zona euro alcanzó el 1% en junio, situándose ligeramente por encima del 0,9% registrado en mayo. El IPC general ascendió al 1,9% en términos interanuales, lo que supone un descenso respecto al 2% registrado en mayo debido a una subida de precios de la energía algo inferior. La inflación subyacente, situada en el 1% interanual en junio, permanece dentro del rango histórico del 0,2% - 1,4% desde principios de 2017.

A pesar de mal comportamiento relativo de los híbridos corporativos respecto a otras clases de activos este año, seguimos creyendo que las valoraciones se encuentran a niveles más ajustados, aunque siguen destacando frente a otras opciones asociadas al crédito líquido. El nuevo tema de conversación ha sido la retirada gradual de estímulos (tapering) aplicada por la Reserva Federal estadounidense (la "Fed"), aunque seguiremos prestando atención a los fundamentales de empresas sometidas a pruebas de estrés bajo distintos escenarios, además de asignar capital a los valores que presenten los mayores márgenes de seguridad.

La selección de valores resultó positiva en lo que va de año, aunque se vio parcialmente contrarrestada por la desacertada selección de sectores en lo siguiente:

- La negativa selección de valores en nuestra exposición a suministros le costó al fondo 8 puntos básicos ("pb") de rentabilidad. En un mercado alcista, algunas de nuestras posiciones defensivas se quedaron rezagadas, aunque vemos pocas razones para cambiar de táctica por ahora. Puede decirse que Electricite de France fue la posición más volátil ante la noticia de que su proyecto Hércules podría abandonarse. Nuestra hipótesis central sigue siendo que Francia y la Comisión Europea llegarán a una solución sobre este asunto.
- La poco acertada selección de valores dentro de nuestra exposición a atención sanitaria le costó al fondo 3 puntos básicos de rentabilidad. Aquí nuestra principal baza es nuestra posición a largo plazo en Bayer. Moody's rebajó un escalón la calificación de la compañía, una decisión que estaba más que descontada. Aprovechamos este factor técnico efímero, aunque negativo, para complementar nuestra posición.

También nos beneficiamos de nuestra participación en el concurrido mercado de nuevas emisiones en 2021, que ha registrado un fuerte incremento de la oferta. Aunque nuestra participación en nuevas operaciones sigue siendo selectiva, nos anima ver que el universo de emisores continúa expandiéndose, una tendencia que previsiblemente se mantendrá a lo largo del año. Mientras los mercados sigan relativamente estables, consideramos probable que se produzcan más emisiones con precios atractivos durante las próximas semanas. Creemos que nuestra continua participación en nuevas emisiones debería ayudarnos a generar más rentabilidad positiva para la Cartera.

Dada la estrecha banda de negociación que presenta el mercado en los últimos meses, el margen diferencial entre los diferenciales de los bonos preferentes interpolados y sus equivalentes corporativos híbridos sigue siendo elevado al situarse en 210 pb de media. Seguimos creyendo que el nivel relativo de los diferenciales de los bonos preferentes de empresas europeas no financieras de alta calidad y con grado de inversión (IG), unido al nivel persistentemente bajo de los rendimientos de la deuda pública —particularmente en euros— deberían continuar favoreciendo a los diferenciales de los bonos corporativos híbridos y dotarlos de atractivo en comparación con otras opciones ofrecidas en los mercados europeos de crédito y de renta fija en general.

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (cont.)

Informe del Gestor de inversiones (cont.)

La Cartera sigue claramente más diversificada que el Índice, sobre todo en lo que a los títulos individuales se refiere. Sin embargo, aplicando un enfoque de valor a largo plazo, seguimos asignando una parte considerable de la cartera al sector de suministros públicos, además de a servicios de comunicaciones y emisores de alta calidad del sector de la energía. Nuestras decisiones respecto a los bonos individuales se basan en valoraciones consideradas en el contexto de un riesgo comercial generalmente bajo, en niveles bajos de EBITDA (Beneficios antes de Intereses, Impuestos, Depreciación y Amortización) máximo-mínimo y, en el caso del sector de suministros públicos, en un entorno normativo favorable.

El posicionamiento conservador significa que la cartera (a 30 de junio de 2021):

1. solo compra emisores con grado de inversión
2. siempre mantiene al menos un 3% de efectivo (en estos momentos mantenemos un nivel bastante superior).
3. mantiene exposición cero a hoteles, empresas de ocio, aerolíneas o compañías de viajes
4. ha sido cauta con las empresas inmobiliarias, que consideramos más cíclicas que la mayoría del sector.

En cuanto a otras posiciones de alta convicción, además de VW y Bayer, también destacaron las posiciones en National Grid, Veolia y EDF, que, a nuestro juicio, seguirán produciendo buenos resultados de cara al futuro.

En lo que a la elaboración de la cartera se refiere, la Cartera ha procurado hacer adquisiciones a una serie de emisores con los que los gestores de la Cartera se encuentran cómodos desde una perspectiva fundamental. No contamos con exposición a las empresas griegas, y la cartera no incluye ningún bono cuyo emisor esté domiciliado en un mercado emergente. La cartera refleja la solidez de los fundamentales en los distintos sectores y emisores. La filosofía de inversión continúa centrándose en el largo plazo y basándose en el valor —se presta especial atención al análisis fundamental ascendente y a una labor de valoración rigurosa—. Seremos pacientes a la espera de que surjan oportunidades, pero actuaremos con decisión cuando las encontremos, en un intento de generar una buena rentabilidad a largo plazo.

Seguimos pensando que el mercado de deuda corporativa híbrida opera muy por encima de su valor razonable. Creemos que existen varias ideas atractivas de selección de valores disponibles desde una perspectiva de valor relativo y el crecimiento del mercado de nuevas emisiones ofrece una mayor diversificación, además de oportunidades de valor relativo. Consideramos que la combinación de una elevada rentabilidad inicial, el estrechamiento de los diferenciales, las oportunidades de selección de valores y las nuevas emisiones a precios atractivos, deberían generar, con el tiempo, un resultado positivo para los inversores.

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 EUR	A 31 de diciembre de 2020 EUR
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		2.081.933.173	1.595.774.849
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	120.175.219	97.054.389
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		5.436.188	–
Cuentas a percibir por acciones emitidas		8.681.579	12.063.670
Ingresos a percibir y otros activos		25.068.965	22.393.539
Activos totales		2.241.295.124	1.727.286.447
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		10.499.068	18.919.228
Descubierto bancario	3	49.463	37.739
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		14.790.186	717.755
Gastos devengados		1.385.821	1.069.549
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		9.390.141	12.308
Otras cuentas por pagar		48.814	46.659
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		36.163.493	20.803.238
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		2.205.131.631	1.706.483.209

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 EUR	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 EUR
Ingresos			
Ingresos por intereses		34.386.535	21.403.706
Ingresos por préstamo de valores	15	40.663	8
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		11.698.087	(47.602.608)
		46.125.285	(26.198.894)
Gastos			
Comisión de gestión	5	6.540.982	3.992.590
Comisión de distribución	5	163.017	123.229
Comisión de administración	5	720.979	574.327
Comisión de compromiso	16	107.943	55.306
Comisión de depósito	5	60.708	42.280
Comisión del Depositario	5	49.732	55.545
Honorarios profesionales	7	101.707	58.903
Honorarios de los Consejeros	6	2.125	2.153
Costes de transacciones	7	50.578	44.070
Honorarios de auditoría	7	9.668	9.491
Reembolso de IVA		(8.633)	(3.925)
Otros gastos	7	8.194	17.077
Gastos totales		7.807.000	4.971.046
Costes financieros			
Gastos por intereses		373	35
Repartos de dividendos abonados	1	5.707.494	2.972.434
		5.707.867	2.972.469
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		32.610.418	(34.142.409)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	EUR	EUR
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	1.706.483.209	1.132.222.992
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	32.610.418	(34.142.409)
Suscripciones	904.098.579	397.867.233
Reembolsos	(438.060.575)	(357.852.390)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	2.205.131.631	1.138.095.426

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Importe principal	Descripción de los valores	Cupón	Fecha de vencimiento	Valor razonable EUR	% del Patrimonio neto
Bonos de empresa 94,07% (31 de diciembre de 2020: 92,57%)					
Euro					
8.500.000	Arkema SA*	2,75%	29/12/2049	8.971.240	0,41
25.778.000	Atrium European Real Estate Ltd*	3,63%	29/12/2049	25.301.751	1,15
19.500.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd*	1,63%	11/03/2081	19.873.366	0,90
35.698.000	Bayer AG*	2,38%	02/04/2075	36.271.560	1,65
124.900.000	Bayer AG*	2,38%	12/11/2079	126.795.566	5,75
32.400.000	Bayer AG*	3,13%	12/11/2079	33.784.744	1,53
10.185.000	Bayer AG*	3,75%	01/07/2074	10.782.096	0,49
74.800.000	Bertelsmann SE & Co KGaA*	3,00%	23/04/2075	77.683.764	3,52
12.805.000	BP Capital Markets Plc*	3,25%	29/12/2049	13.704.551	0,62
67.416.000	BP Capital Markets Plc*	3,63%	29/12/2049	73.477.373	3,33
15.700.000	British Telecommunications Plc*	1,87%	18/08/2080	15.313.152	0,70
6.000.000	Electricite de France SA*	3,38%	29/12/2049	6.278.370	0,29
3.800.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*	1,88%	29/06/2080	3.904.907	0,18
38.184.000	Eni SpA*	2,00%	29/12/2049	38.206.949	1,73
16.600.000	Eni SpA*	3,38%	29/12/2049	17.662.815	0,80
58.000.000	Fastighets AB Balder*	2,87%	02/06/2081	57.601.192	2,61
7.000.000	Iberdrola International BV*	2,25%	29/12/2049	7.249.508	0,33
32.166.000	Koninklijke FrieslandCampina NV*	2,85%	29/12/2049	32.822.669	1,49
3.800.000	Orange SA*	1,38%	29/12/2049	3.750.222	0,17
3.000.000	Orange SA*	5,00%	29/12/2049	3.588.822	0,16
28.503.000	SES SA*	2,88%	29/12/2049	28.762.064	1,30
8.000.000	Solvay Finance SACA*	5,87%	29/12/2049	9.033.776	0,41
29.300.000	SSE Plc*	3,13%	29/12/2049	31.803.040	1,44
9.500.000	Suez SA*	1,63%	29/12/2049	9.567.421	0,43
36.000.000	Suez SA*	2,88%	29/12/2049	37.987.740	1,72
95.587.000	TenneT Holding BV*	2,37%	29/12/2049	99.302.945	4,50
24.200.000	TotalEnergies SE*	1,63%	29/12/2049	24.256.144	1,10
7.565.000	TotalEnergies SE*	1,75%	29/12/2049	7.764.580	0,35
12.045.000	TotalEnergies SE*	2,63%	29/12/2049	12.757.233	0,58
20.146.000	TotalEnergies SE*	2,71%	29/12/2049	20.998.075	0,95
66.300.000	Veolia Environnement SA*	2,25%	29/12/2049	68.109.990	3,09
99.600.000	Veolia Environnement SA*	2,50%	29/12/2049	100.351.482	4,55
4.300.000	Volkswagen International Finance NV*	2,70%	29/12/2049	4.433.175	0,20
38.200.000	Volkswagen International Finance NV*	3,38%	29/12/2049	40.874.000	1,85
18.000.000	Volkswagen International Finance NV*	3,50%	29/12/2049	19.788.750	0,90
17.100.000	Volkswagen International Finance NV S Series*	3,50%	29/12/2049	18.496.813	0,84
25.600.000	Volkswagen International Finance NV*	3,88%	29/12/2049	28.347.162	1,29
20.800.000	Volkswagen International Finance NV S Series*	3,88%	29/12/2049	23.143.141	1,05

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (cont.)

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 EUR	del Patrimonio neto
Bonos de empresa 94,07% (31 de diciembre de 2020: 92,57%) (cont.)					
Euro (cont.)					
27.646.000	Volkswagen International Finance NV*	4,63%	29/12/2049	31.514.781	1,43
21.800.000	Volkswagen International Finance NV REG S*	4,63%	29/12/2049	25.265.960	1,15
3.150.000	Volvo Treasury AB*	4,85%	10/03/2078	3.386.250	0,15
Total euro				1.258.969.139	57,09
Libra esterlina					
3.533.000	BHP Billiton Finance Ltd*	6,50%	22/10/2077	4.405.865	0,20
14.337.000	BP Capital Markets Plc*	4,25%	29/12/2049	17.742.221	0,80
48.343.000	Centrica Plc*	5,25%	10/04/2075	60.797.197	2,76
12.100.000	Electricite de France SA*	5,88%	29/12/2049	16.038.832	0,73
79.700.000	Electricite de France SA*	6,00%	29/12/2049	104.017.053	4,72
120.000.000	NGG Finance Plc*	5,63%	18/06/2073	156.213.925	7,08
217.000	Orange SA*	5,75%	29/12/2049	273.025	0,01
7.978.000	SSE Plc*	3,74%	29/12/2049	9.835.092	0,45
Total libra esterlina				369.323.210	16,75
Dólar estadounidense					
75.000.000	AT Securities BV*	5,25%	29/12/2049	66.288.894	3,01
34.990.000	CK Hutchison Capital Securities 17 Ltd**	4,00%	29/12/2049	30.095.121	1,37
35.245.000	CMS Energy Corp**	3,75%	01/12/2050	30.271.351	1,37
4.635.000	CMS Energy Corp**	4,75%	01/06/2050	4.365.221	0,20
2.000.000	Electricite de France SA*	5,25%	29/12/2049	1.768.699	0,08
58.031.000	Enbridge Inc**	5,50%	15/07/2077	52.119.461	2,36
1.980.000	Enbridge Inc**	6,00%	15/01/2077	1.853.276	0,09
78.630.000	Enel SpA*	8,75%	24/09/2073	77.172.968	3,50
24.713.000	Southern Co**	3,75%	15/09/2051	20.998.444	0,95
12.400.000	Southern Co**	4,00%	15/01/2051	11.083.565	0,50
46.940.000	SSE Plc*	4,75%	16/09/2077	41.074.578	1,86
4.919.000	Transcanada Trust**	5,30%	15/03/2077	4.411.193	0,20
111.925.000	Vodafone Group Plc*	6,25%	03/10/2078	104.509.674	4,74
Total dólar estadounidense				446.012.445	20,23
Total bonos de empresa				2.074.304.794	94,07
Total inversiones				2.074.304.794	94,07

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,34% (31 de diciembre de 2020: 0,94%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto
22.477.139 £	25.872.132 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	303.278	0,01
3.255.037 USD	2.299.559 £	19/07/2021	UBS AG	1	65.878	0,00
Clases AUD con cobertura						
36.011 €	55.851 AUD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	663	0,00
41.761 €	65.841 AUD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	91	0,00
Clases CHF con cobertura						
22.680.991 CHF	20.565.370 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	127.549	0,00
23.024.479 CHF	20.876.534 €	19/07/2021	UBS AG	2	129.765	0,01
25.896.230 CHF	23.497.834 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	26	128.495	0,01
2.389.538 €	2.617.391 CHF	19/07/2021	Westpac Banking Corp	20	1.571	0,00
Clases GBP con cobertura						
719.808 €	618.001 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	9	126	0,00
27.933.742 £	32.071.108 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	458.707	0,02
28.372.238 £	32.611.899 €	19/07/2021	UBS AG	2	428.560	0,02
32.328.911 £	37.183.999 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	63	464.140	0,02
Clases HKD con cobertura						
2.974.802 HKD	319.617 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	3.293	0,00
1.465.201 HKD	157.554 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	1.491	0,00
Clases SGD con cobertura						
2.496.792 SGD	1.557.781 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	7.875	0,00
1.681.250 SGD	1.046.497 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	13	7.757	0,00
Clases USD con cobertura						
111.062 €	131.750 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	6	0,00
194.681.655 USD	162.404.908 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	1.699.639	0,08
191.262.025 USD	159.599.816 €	19/07/2021	UBS AG	1	1.622.196	0,07
231.154.122 USD	192.671.276 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	65	2.177.299	0,10
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ^{oo}					7.628.379	0,34
					Valor razonable	% del Patrimonio
					EUR	neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados					2.081.933.173	94,41

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,48%) (31 de diciembre de 2020: (1,11%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto
6.496.241 €	7.850.871 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	(121.556)	(0,01)
393.304.693 €	341.644.271 £	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(4.551.947)	(0,21)
5.421.721 €	4.683.249 £	19/07/2021	UBS AG	2	(32.085)	(0,00)
489.987.410 €	587.656.600 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(5.370.616)	(0,24)
Clases AUD con cobertura						
3.498.767 AUD	2.243.739 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(29.405)	(0,00)
3.498.767 AUD	2.245.180 €	19/07/2021	UBS AG	1	(30.846)	(0,00)
3.870.191 AUD	2.484.885 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	6	(35.480)	(0,00)
Clases CHF con cobertura						
784.731 CHF	718.307 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	20	(2.363)	(0,00)
1.459.852 €	1.610.032 CHF	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(9.054)	(0,00)
1.459.790 €	1.610.032 CHF	19/07/2021	UBS AG	1	(9.116)	(0,00)
3.977.856 €	4.370.386 CHF	19/07/2021	Westpac Banking Corp	12	(9.450)	(0,00)
Clases GBP con cobertura						
1.476.530 €	1.286.049 £	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(21.118)	(0,00)
1.478.129 €	1.286.049 £	19/07/2021	UBS AG	1	(19.520)	(0,00)
2.104.550 €	1.826.223 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	29	(22.151)	(0,00)
237.753 £	277.312 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	7	(441)	(0,00)
Clases HKD con cobertura						
2.671 €	25.208 HKD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(65)	(0,00)
Clases SGD con cobertura						
11.778 €	18.994 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(133)	(0,00)
Clases USD con cobertura						
4.796.424 €	5.750.341 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(50.757)	(0,01)
4.798.409 €	5.750.341 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(48.772)	(0,00)
14.034.249 €	16.808.405 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	39	(134.193)	(0,01)
1.246 USD	1.050 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(0)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(10.499.068)	(0,48)

	Valor razonable EUR	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(10.499.068)	(0,48)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	2.071.434.105	93,93
Otro activo neto	133.697.526	6,07
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	2.205.131.631	100,00

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

Análisis de la cartera	EUR	% de los Activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	1.919.107.162	85,63
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	155.197.632	6,92
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(2.870.689)	(0,13)
Total inversiones	2.071.434.105	92,42

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste EUR
67.200.000	Bayer AG, 2.38%, 12/11/2079	68.418.505
66.300.000	Veolia Environnement SA, 2.25%, 20/04/2170	67.746.420
74.750.000	AT Securities BV, 5.25%, 29/12/2049	65.597.088
64.221.000	Enel SpA, 8.75%, 24/09/2073	61.886.915
60.000.000	Fastighets AB Balder, 2.87%, 02/06/2081	59.998.800
36.671.000	NGG Finance Plc, 5.63%, 18/06/2073	47.531.854
35.000.000	Centrica Plc, 5.25%, 10/04/2075	43.581.184
43.767.000	Vodafone Group Plc, 6.25%, 03/10/2078	40.010.556
38.184.000	ENI SpA, 2.00%, 29/12/2049	38.184.000
36.000.000	Suez, 2.88%, 19/04/2166	37.884.000
43.114.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 5.13%, 05/04/2077	36.927.166
35.528.000	Atrium European Real Estate Ltd, 3.63%, 29/12/2049	34.887.430
32.400.000	Bayer AG, 3.13%, 12/11/2079	33.606.610
34.990.000	CK Hutchison Capital Securities 17 Ltd, 4.00%, 29/12/2049	30.166.090
27.300.000	SSE Plc, 3.13%, 29/12/2049	29.446.350
28.503.000	SES SA, 2.88%, 29/12/2049	28.623.966
27.900.000	Aroundtown SA, 1.63%, 29/12/2049	27.361.530
23.866.000	TenneT Holding BV, 2.37%, 29/12/2049	24.945.921
24.200.000	TotalEnergies SE, 1.63%, 29/12/2049	24.200.000
21.136.000	Volkswagen International Finance NV, 4.63%, 29/12/2049	23.447.319
24.713.000	Southern Co, 3.75%, 15/09/2051	20.849.659
20.300.000	Iberdrola International BV, 1.83%, 29/12/2049	20.300.000
20.400.000	Orange SA, 1.38%, 11/05/2170	20.285.148
19.400.000	Veolia Environnement SA, 2.50%, 29/12/2049	19.540.225
19.500.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd, 1.63%, 11/03/2081	19.500.000
14.337.000	BP Capital Markets Plc, 4.25%, 22/06/2169	17.617.204
12.500.000	Electricite de France SA, 6.00%, 31/12/2049	16.198.958
11.100.000	Electricite de France SA, 5.88%, 22/07/2049	14.752.992
13.766.000	Koninklijke FrieslandCampina NV, 2.85%, 29/12/2049	14.057.839
10.185.000	Bayer AG, 3.75%, 01/07/2074	10.827.975

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (cont.)

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
93.819.000	SSE Plc, 4.75%, 16/09/2077	80.778.784
75.200.000	Grand City Properties SA, 1.50%, 29/12/2049	74.249.775
56.600.000	Bayer AG, 2.38%, 02/04/2075	57.739.000
40.700.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 2.13%, 29/12/2049	39.246.720
43.114.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 5.13%, 05/04/2077	36.854.551
27.900.000	Aroundtown SA, 1.63%, 29/12/2049	26.956.250
20.300.000	Iberdrola International BV, 1.83%, 29/12/2049	20.452.250
18.400.000	Solvay SA, 4.25%, 29/12/2049	19.800.180
18.045.000	ELM BV for Firmenich International SA, 3.75%, 29/12/2049	19.323.263
18.579.000	Enel SpA, 8.75%, 24/09/2073	18.022.544
16.600.000	Orange SA, 1.38%, 29/12/2049	16.523.371
15.000.000	Electricite de France SA, 3.38%, 29/12/2049	15.918.750
14.800.000	British Telecommunications Plc, 1.87%, 18/08/2080	14.658.500
13.600.000	Heimstaden Bostad AB, 3.38%, 29/12/2049	14.152.300
16.138.000	Enterprise Products Operating LLC, 5.38%, 15/02/2078	13.685.979
14.000.000	CMS Energy Corp, 4.75%, 01/06/2050	12.714.976
11.000.000	Telefonica Europe BV, 2.63%, 29/12/2049	11.224.180
10.900.000	Volkswagen International Finance NV, 2.70%, 29/12/2049	11.213.375
9.750.000	Atrium European Real Estate Ltd, 3.63%, 29/12/2049	9.588.591
9.361.000	Vodafone Group Plc, 6.25%, 03/10/2078	8.666.850
7.200.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 2.88%, 29/12/2049	7.077.600
4.956.000	Orsted A/S, 6.25%, 26/06/3013	5.569.305

Neuberger Berman US Equity Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 12,03%. En el mismo periodo, el índice de referencia, el S&P 500 (Total Return, Net of Tax, USD) (el "Índice"), registró una rentabilidad del 15,00%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso.

Durante el periodo, el S&P 500 alcanzó nuevos máximos históricos. Los datos económicos continuaron siendo sólidos al bajar el desempleo a mínimos de varios años y dispararse los índices de Directores de Compras en el sector manufacturero global ("PMI") a máximos no vistos en 15 años. Por otra parte, la demanda agregada se mantuvo elevada (con aumentos de precios de muchos bienes y servicios) gracias a una combinación de programas de estímulos monetarios y fiscales masivos con el gasto contenido hasta la fecha por diversas medidas de confinamiento y restricciones sobre los viajes aplicadas en todo el mundo. Las noticias de unos datos económicos más sólidos y aumento de la inflación empujaron al Consejo de la Reserva Federal estadounidense a acelerar el calendario de subidas de tipos —de cero subidas previstas para 2023 a dos potenciales—. Sin embargo, continúa el debate acerca de si el aumento de precios será efímero o más sostenible, especialmente cuando se resuelvan los problemas de la cadena de suministro y el elevado gasto de los consumidores regrese a las medias a más largo plazo.

La Cartera se anotó una rentabilidad absoluta positiva, aunque generó rendimientos inferiores al Índice en el periodo analizado. Tanto la selección de valores como la asignación de sectores mermaron los resultados. En concreto, las posiciones en los sectores de servicios de comunicaciones, financiero e inmobiliario fueron las que más contribuyeron a la rentabilidad relativa. Por el contrario, la selección de valores en los sectores de tecnología de la información e industrial fue lo que más lastró las ganancias. En lo que respecta a la asignación de sectores, la infraponderación a energía respecto al Índice y la sobreponderación a efectivo mermaron la rentabilidad relativa, mientras que la infraponderación a consumo básico contribuyó a la misma.

De cara al futuro, creemos que una política monetaria y fiscal sin precedentes y la confianza de los consumidores serán una buena medicina para la economía. Cabe esperar que esto favorezca un repunte duradero y sostenible del crecimiento del PIB y a las expectativas de beneficios, dado que la confianza de los consumidores (con un balance más saneado) es el ingrediente fundamental para una economía impulsada por los consumidores. Si esto se materializa, creemos que podríamos presenciar una tasa de proyección de los beneficios corporativos de 2021 superior a la que se pronostica en estos momentos, a pesar de que se ha registrado un aumento del 14% en lo que va de año. Ahora nos enfrentamos a una dinámica de principio del ciclo que no veíamos desde hace una década: un crecimiento superior al tendencial del PIB y los beneficios de las empresas, caídas del desempleo y tipos de interés ultrabajos. Las start-up están floreciendo y el sector financiero se asienta sobre cimientos sólidos. La economía "online" ha mantenido en funcionamiento a Estados Unidos durante los días más oscuros de la pandemia y sigue creciendo por su relevancia tanto para empresas como para consumidores. No obstante, somos conscientes de que el entorno de inversión no está exento de dificultades. Este entorno está dominado por una confluencia de consideraciones en materia de política fiscal, estímulos de la política monetaria, preocupación por la salud pública, incertidumbre geopolítica, volatilidad de los precios de las materias primas, dinámica de inflación y constantes interrogantes (por ejemplo, la reactivación de la economía). Seguimos centrándonos en reflexionar en profundidad y con creatividad y nos esforzamos por ofrecer siempre rentabilidades atractivas ajustadas por el riesgo. Dadas las vicisitudes de una economía cada vez más globalizada, también procuraremos mantener la flexibilidad en nuestras decisiones y una actitud abierta a nuevas ideas en diversos sectores, clases de activos y zonas geográficas.

Neuberger Berman US Equity Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		7.309.024	6.401.566
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	486.387	9.469
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		–	120.598
Cuentas a percibir por acciones emitidas		25.087	31.000
Ingresos a percibir y otros activos		9.981	31.117
Activos totales		7.830.479	6.593.750
Pasivo circulante			
Descubierto bancario	3	–	5
Gastos devengados		17.433	24.732
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		–	32.900
Otras cuentas por pagar		17.380	5.623
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		34.813	63.260
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		7.795.666	6.530.490

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman US Equity Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		8	495
Ingresos por dividendos		33.073	30.023
Ingresos varios		62	–
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		793.280	115.890
		826.423	146.408
Gastos			
Comisión de gestión	5	27.244	17.954
Comisión de administración	5	14.188	9.050
Comisión de compromiso	16	460	260
Comisión de depósito	5	5.811	5.792
Comisión del Depositario	5	167	234
Honorarios profesionales	7	23.400	23.792
Honorarios de los Consejeros	6	2.413	2.375
Costes de transacciones	7	2.746	3.160
Honorarios de auditoría	7	7.488	6.877
Reembolso de IVA		(29)	(16)
Otros gastos	7	1.208	5.026
Gastos no asumidos	5	(50.125)	(50.698)
Gastos totales		34.971	23.806
Gastos por intereses		–	128
Repartos de dividendos abonados	1	–	5.550
		–	5.678
Impuestos retenidos en origen		8.297	7.596
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		783.155	109.328

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman US Equity Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	6.530.490	5.335.428
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	783.155	109.328
Suscripciones	1.033.527	300.000
Reembolsos	(551.506)	(1.325.129)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	7.795.666	4.419.627

Neuberger Berman US Equity Fund (cont.)

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 91,63% (31 de diciembre de 2020: 98,03%)			
Dólar estadounidense			
1.396	Activision Blizzard Inc	133.234	1,71
327	Adobe Inc	191.504	2,46
252	Air Products & Chemicals Inc	72.495	0,93
160	Alphabet Inc Class A	390.686	5,01
88	Amazon.com Inc	302.734	3,88
1.993	Anaplan Inc	106.227	1,36
1.678	Apollo Global Management Inc Class A	104.372	1,34
2.160	Apple Inc	295.834	3,79
1.766	Ashland Global Holdings Inc	154.525	1,98
388	Atlassian Corp Plc Class A	99.662	1,28
205	Becton Dickinson & Co	49.854	0,64
100	BlackRock Inc Class A	87.497	1,12
711	Blackstone Group Inc	69.067	0,89
2.431	Brookfield Asset Management Inc Class A	123.932	1,59
16	Brookfield Asset Management Reinsurance Partners Ltd Class A	832	0,01
830	CDW Corp	144.960	1,86
1.347	Chewy Inc Class A	107.369	1,38
1.486	Citigroup Inc	105.135	1,35
616	CME Group Inc Class A	131.011	1,68
222	Costco Wholesale Corp	87.839	1,13
650	DoubleVerify Holdings Inc	27.521	0,35
2.789	Duck Creek Technologies Inc	121.349	1,56
4.929	Dun & Bradstreet Holdings Inc	105.333	1,35
1.616	Enterprise Products Partners LP	38.994	0,50
592	Equifax Inc	141.790	1,82
703	Expedia Group Inc	115.088	1,48
525	Facebook Inc Class A	182.548	2,34
82	FedEx Corp	24.463	0,31
381	Fidelity National Information Services Inc	53.976	0,69
471	Home Depot Inc	150.197	1,93
194	Humana Inc	85.888	1,10
1.720	IHS Markit Ltd	193.775	2,49
91	Intuit Inc	44.605	0,57
594	Johnson & Johnson	97.856	1,26
4.571	Keurig Dr Pepper Inc	161.082	2,07
360	L3Harris Technologies Inc	77.814	1,00
869	McDonald's Corp	200.730	2,57
1.199	Medtronic Plc	148.832	1,91

Neuberger Berman US Equity Fund (cont.)

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 91,63% (31 de diciembre de 2020: 98,03%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
1.473	Microsoft Corp	399.036	5,12
601	Mondelez International Inc Class A	37.526	0,48
1.583	NextEra Energy Inc	116.002	1,49
869	NIKE Inc Class B	134.252	1,72
1.660	Repay Holdings Corp Class A	39.906	0,51
804	Salesforce.com Inc	196.393	2,52
281	ServiceNow Inc	154.424	1,98
237	Spotify Technology SA	65.315	0,84
596	TE Connectivity Ltd	80.585	1,03
335	Thermo Fisher Scientific Inc	168.997	2,17
986	Tradeweb Markets Inc Class A	83.376	1,07
473	Uber Technologies Inc	23.707	0,30
482	Union Pacific Corp	106.006	1,36
385	UnitedHealth Group Inc	154.169	1,98
590	Visa Inc Class A	137.954	1,77
700	Walmart Inc	98.714	1,27
823	Waste Management Inc	115.311	1,48
554	WEC Energy Group Inc	49.278	0,63
711	WEX Inc	137.863	1,77
475	Workday Inc Class A	113.402	1,45
Total valores de renta variable *		7.142.826	91,63
Fondos de inversión inmobiliaria 1,34% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)			
Dólar estadounidense			
328	SBA Communications Corp Class A	104.534	1,34
Total fondos de inversión inmobiliaria *		104.534	1,34
Total inversiones		7.247.360	92,97

Inversión privada en renta variable pública – (PIPE) 0,79% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)

Contraparte	Obligación referenciada	Importe nominal	Fecha de cierre	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Churchill Capital Corp IV Clase A	Churchill Capital Corp IV Class A	124.995 USD	23/07/2021	61.664	0,79
Plusvalía latente total sobre inversión privada en renta variable pública – (PIPE) [∞]				61.664	0,79

Neuberger Berman US Equity Fund (cont.)

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	7.309.024	93,76
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	7.309.024	93,76
Otro activo neto	486.642	6,24
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	7.795.666	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	7.247.360	92,55
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	61.664	0,79
Total inversiones	7.309.024	93,34

Neuberger Berman US Equity Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
1.678	Apollo Global Management Inc Class A	95.700
328	SBA Communications Corp Class A	84.286
361	Salesforce.com Inc	78.995
596	TE Connectivity Ltd	78.484
947	Chewy Inc Class A	71.749
439	Medtronic Plc	52.906
381	Fidelity National Information Services Inc	50.255
229	CME Group Inc Class A	48.148
170	Microsoft Corp	43.211
270	Expedia Group Inc	42.349
1.616	Enterprise Products Partners LP	39.134
71	Thermo Fisher Scientific Inc	33.167
137	McDonald's Corp	30.943
255	Waste Management Inc	29.506
8	Amazon.com Inc	26.582
681	Keurig Dr Pepper Inc	23.502
173	Apple Inc	22.946
650	DoubleVerify Holdings Inc	22.552
226	Activision Blizzard Inc	20.968
104	WEX Inc	20.152
147	Walmart Inc	19.803
218	NextEra Energy Inc	16.096
46	Home Depot Inc	14.135
27	ServiceNow Inc	13.970
247	Anaplan Inc	13.784

Neuberger Berman US Equity Fund (cont.)

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
1.003	Baxter International Inc	80.600
867	Blackstone Group Inc	78.307
1.154	Gilead Sciences Inc	73.863
1.060	Citigroup Inc	72.604
77	BlackRock Inc Class A	57.748
200	PayPal Holdings Inc	56.900
255	L3Harris Technologies Inc	48.620
192	Becton Dickinson & Co	48.252
202	Alibaba Group Holding Ltd ADR	48.053
450	Chewy Inc Class A	46.783
490	Pinterest Inc Class A	35.567
100	DexCom Inc	35.550
143	Equifax Inc	30.447
8	Amazon.com Inc	26.535
79	Costco Wholesale Corp	26.292
105	Microsoft Corp	25.199
205	Activision Blizzard Inc	19.027
428	Duck Creek Technologies Inc	16.961
180	IHS Markit Ltd	16.150
111	CDW Corp	16.070
219	Anaplan Inc	15.271
50	Home Depot Inc	14.984
108	Apple Inc	14.654
38	Spotify Technology SA	11.916
164	Tradeweb Markets Inc Class A	11.672
34	UnitedHealth Group Inc	11.261
53	WEX Inc	10.694
86	Medtronic Plc	10.078

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund

Informe del Gestor de inversiones

Durante el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 (el "periodo analizado"), la rentabilidad total de la Clase de Acumulación USD I se situó en el 3,42%. En el mismo período, el índice ICE BofA Global High Yield Constrained (rentabilidad total en USD con cobertura) (el "Índice") registró un 3,17%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

El mercado de alta rentabilidad se anotó excelentes resultados en el primer semestre de 2021 gracias al avance de la campaña de vacunación contra la COVID-19, a la reapertura de las economías, al sólido crecimiento del PIB y a la mejora de los fundamentales del crédito. A pesar de la mejoría del entorno económico, diversos bancos centrales, entre ellos la Reserva Federal estadounidense y el BCE, reiteraron su intención de mantener una política monetaria acomodaticia además de expresar su confianza en el carácter transitorio del aumento de la inflación. Los diferenciales de crédito, que se habían ampliado al comienzo de la pandemia el pasado año, experimentaron una contracción significativa durante el periodo analizado. El mercado de alta rentabilidad también se caracterizó por la divergencia de rentabilidades entre las diferentes calidades crediticias y entre emisores que atravesaron o no dificultades (distressed/non-distressed) durante el periodo, con un avance del índice ICE BofA Distressed High Yield del 29,9%, frente al 3,1% del índice ICE BofA US Non-Distressed High Yield en el año en curso. A pesar de que la parte del mercado que atravesó dificultades experimentó un fuerte repunte partiendo de unos niveles muy bajos, muchos de los emisores perjudicados a más largo plazo y que afrontan desafíos seculares todavía no satisfacen nuestros estrictos estándares de suscripción de crédito. Durante el periodo analizado, el índice de valores acuciados (distressed), medido como porcentaje del Total US High Yield Index, se situó en apenas el 1,7%, descendiendo respecto al 4,1% registrado al final del año pasado, lo que supone el nivel más bajo visto desde octubre de 2006. Por otra parte, desde la perspectiva de la selección de títulos de crédito individuales, encontramos oportunidades de inversión atractivas en el espectro del crédito y en el universo de alta rentabilidad.

La cifra de emisiones nuevas ha sido muy elevada en el primer semestre, dado que los emisores trataron de refinanciar a rentabilidades más bajas. En lo que va de año, la emisión bruta de bonos de alta rentabilidad de EE. UU. alcanzó los 299.100 millones de dólares —100.300 millones de dólares excluyendo refinanciaciones—, superando los 218.400 millones de dólares —94.200 millones de dólares excluyendo refinanciaciones— del mismo periodo del pasado año. En lo que va de año, el volumen de emisiones nuevas de deuda de alta rentabilidad no denominada en USD alcanzó el equivalente a 86.900 millones de dólares estadounidenses, lo que contrasta con los 43.500 millones del mismo periodo de 2020. Para poner esto en contexto, cabe señalar que el volumen de emisiones nuevas no denominadas en USD alcanzó en total el equivalente a 100.500 millones de dólares estadounidenses en el conjunto del ejercicio 2020. Las salidas de capital de fondos de alta rentabilidad del año en curso alcanzan los -13.800 millones de dólares, lo que contrasta con las entradas de capital por valor de 28.600 millones de dólares del primer semestre de 2020.

En junio de 2021, la tasa de morosidad ponderada por el valor nominal de las emisiones del mercado de alta rentabilidad de los últimos 12 meses en Estados Unidos descendió hasta el 1,87%, en 430 puntos básicos, desde el 6,17% registrado en diciembre de 2020. Por ponerlo en contexto, cabe señalar que la tasa de morosidad media a largo plazo se sitúa en el 3,5% (basada en las tasas de morosidad anuales desde 1980, según JP Morgan). Habida cuenta de la creciente proporción de mejora de las calificaciones y del descenso de las rebajas de calificación, prevemos que las tasas de impago de las emisiones del mercado de alta rentabilidad seguirán moderándose respecto de los niveles actuales.

La Cartera batió a su Índice de referencia en el periodo analizado. Durante este periodo, lo que más benefició a la rentabilidad fueron la selección de valores y la infraponderación en los sectores de atención sanitaria, inmobiliario y constructores de viviendas, así como la selección de valores en el sector de servicios financieros diversificados. Por contra, los mayores lastres para la rentabilidad fueron la selección de valores y la infraponderación en los sectores de energía, así como la selección de valores en salas de exhibición y ocio, además de en el sector aeroespacial / defensa. En lo que respecta a nuestro posicionamiento por calificaciones crediticias, lo que más benefició a la rentabilidad fue la sobreponderación a emisores con calificación CCC e inferior, la selección de valores en emisores con calificación B y BB y la infraponderación a emisores con calificación BB, mientras que los principales lastres fueron la selección de valores en el segmento CCC e inferior y la sobreponderación en emisores con calificación B.

Los diferenciales del mercado de alta rentabilidad se han estrechado en el año en curso, pero creemos que las valoraciones compensan a los inversores por unas perspectivas de impago cada vez más benignas. La recuperación económica sigue su curso y creemos que la evolución positiva del crecimiento y de la capacidad de fijación de precios favorecerá a los fundamentales de los emisores. El constante progreso de las campañas de vacunación, unido a la demanda acumulada de los consumidores en los segmentos de los viajes, el ocio y los servicios, la reposición de inventarios y contrataciones por parte de las empresas, así como un FOMC paciente aunque vigilante deberían seguir favoreciendo a la actividad económica de cara al futuro. A pesar de que las nuevas variantes de la COVID y la preocupación por la inflación dan lugar a episodios de volatilidad a corto plazo, creemos que nuestro análisis fundamental del crédito, con un enfoque bottom-up y centrado en la selección de títulos individuales, al tiempo que trata de evitar el deterioro del crédito y de incluir solo nuestras "mejores ideas" en las carteras, nos permite estar bien posicionados para aprovechar cualquier volatilidad.

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		76.298.609	62.922.542
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	2.699.693	1.565.712
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		713.840	30.725
Cuentas a percibir por acciones emitidas		50.028	518.569
Ingresos a percibir y otros activos		1.257.335	1.008.277
Activos totales		81.019.505	66.045.825
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		606.503	2.192.915
Descubierto bancario	3	144	84
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		58.885	—
Gastos devengados		81.282	61.530
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		1.080.028	172.539
Otras cuentas por pagar		43.202	33.499
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		1.870.044	2.460.567
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		79.149.461	63.585.258

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		2.275.328	1.549.049
Ingresos por préstamo de valores	15	1.961	–
Ingresos varios		–	2.237
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(396.359)	(5.381.932)
		1.880.930	(3.830.646)
Gastos			
Comisión de gestión	5	218.867	82.778
Comisión de distribución	5	7.078	2.950
Comisión de administración	5	78.544	79.095
Comisión de compromiso	16	4.509	4.035
Comisión de depósito	5	5.961	6.021
Comisión del Depositario	5	1.975	2.582
Honorarios profesionales	7	37.969	21.182
Honorarios de los Consejeros	6	2.413	2.375
Costes de transacciones	7	16.612	21.757
Honorarios de auditoría	7	8.278	11.554
Reembolso de IVA		(339)	(175)
Otros gastos	7	5.194	3.097
Gastos no asumidos	5	(77.595)	(94.174)
Gastos totales		309.466	143.077
Costes financieros			
Gastos por intereses		5	–
Repartos de dividendos abonados	1	44.754	1.634
		44.759	1.634
Impuestos retenidos en origen		1.552	266
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		1.525.153	(3.975.623)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	63.585.258	74.056.135
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	1.525.153	(3.975.623)
Suscripciones	25.989.938	2.543.933
Reembolsos	(11.950.888)	(20.729.795)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	79.149.461	51.894.650

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund (cont.)

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
Valores respaldados por activos (ABS) 1,90% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)					
Dólar estadounidense					
500.000	Bardot CLO Ltd Series 2019-2X Class E	7,13%	22/10/2032	503.164	0,63
500.000	Dryden 49 Senior Loan Fund Series 2017-49X Class E	6,49%	18/07/2030	501.805	0,63
500.000	Trinitas CLO Xii Ltd Series 2020-12X Class E	7,58%	25/04/2033	504.578	0,64
Total valores respaldados por activos **				1.509.547	1,90
Bonos de empresa 93,64% (31 de diciembre de 2020: 94,67%)					
Euro					
100.000	Accor SA*	2,63%	29/12/2049	115.938	0,15
133.000	Afflelou SAS*	4,25%	19/05/2026	162.333	0,21
151.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl*	3,63%	01/06/2028	177.529	0,22
300.000	Altice Finco SA*	4,75%	15/01/2028	348.411	0,44
210.000	Altice France Holding SA*	4,00%	15/02/2028	239.057	0,30
100.000	Altice France Holding SA*	8,00%	15/05/2027	128.153	0,16
100.000	Avis Budget Finance Plc**	4,75%	30/01/2026	121.119	0,16
283.000	Banijay Group SAS**	6,50%	01/03/2026	346.356	0,44
203.000	BK LC Lux Finco1 Sarl*	5,25%	30/04/2029	246.196	0,31
100.000	Brunello Bidco SpA*	3,50%	15/02/2028	118.530	0,15
200.000	Carnival Corp*	7,63%	01/03/2026	262.493	0,33
100.000	Carnival Corp**	10,13%	01/02/2026	138.222	0,17
100.000	Casino Guichard Perrachon SA*	1,08%	29/12/2049	52.773	0,07
100.000	Casino Guichard Perrachon SA**	3,58%	07/02/2025	115.474	0,15
200.000	Casino Guichard Perrachon SA*	4,50%	07/03/2024	241.044	0,30
100.000	Cedacri Mergesco SpA*	4,63%	15/05/2028	119.479	0,15
200.000	Centurion Bidco SpA*	5,88%	30/09/2026	247.556	0,31
100.000	Chrome Holdco SASU*	5,00%	31/05/2029	121.710	0,15
101.000	Clarios Global LP/Clarios US Finance Co**	4,38%	15/05/2026	124.232	0,16
123.000	CMA CGM SA*	7,50%	15/01/2026	162.130	0,20
100.000	Constellium SE*	3,13%	15/07/2029	117.726	0,15
194.000	Diamond BC BV**	5,63%	15/08/2025	234.470	0,29
215.000	Dufry One BV**	2,00%	15/02/2027	240.295	0,30
350.000	eG Global Finance Plc*	4,38%	07/02/2025	410.450	0,52
100.000	Energizer Gamma Acquisition BV**	3,50%	30/06/2029	118.039	0,15
100.000	Flamingo Lux II SCA*	5,00%	31/03/2029	117.739	0,15
100.000	Foncia Management SASU**	3,38%	31/03/2028	117.842	0,15
100.000	Grupo Antolin-Irausa SA*	3,50%	30/04/2028	118.223	0,15
145.000	House of HR**	7,50%	15/01/2027	183.048	0,23
230.000	Intrum AB*	3,00%	15/09/2027	269.127	0,34
200.000	IPD 3 BV*	5,50%	01/12/2025	241.627	0,31

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund (cont.)

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 93,64% (31 de diciembre de 2020: 94,67%) (cont.)					
Euro (cont.)					
100.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	4,50%	15/01/2026	125.936	0,16
102.000	Kapla Holding SAS*	3,38%	15/12/2026	120.484	0,15
205.000	Kleopatra Holdings 2 SCA*	6,50%	01/09/2026	236.435	0,30
163.000	La Financiere Atalian SASU*	4,00%	15/05/2024	192.628	0,24
149.000	Laboratoire Eimer Selas**	5,00%	01/02/2029	180.475	0,23
200.000	LeasePlan Corp NV*	7,38%	29/12/2049	265.049	0,34
200.000	Loxam SAS*	4,50%	15/04/2027	239.516	0,30
202.000	Maxeda DIY Holding BV**	5,88%	01/10/2026	245.558	0,31
200.000	Modulaire Global Finance Plc**	6,50%	15/02/2023	242.706	0,31
113.000	Motion Bondco DAC*	4,50%	15/11/2027	130.431	0,16
100.000	NH Hotel Group SA*	4,00%	02/07/2026	118.694	0,15
226.000	Nidda BondCo GmbH**	5,00%	30/09/2025	268.899	0,34
206.000	Paprec Holding SA*	4,00%	31/03/2025	249.181	0,31
143.000	Paysafe Finance Plc/Paysafe Holdings US Corp**	3,00%	15/06/2029	167.600	0,21
140.000	PCF GmbH*	4,75%	15/04/2026	169.347	0,22
100.000	Petroleos Mexicanos*	3,75%	16/04/2026	119.470	0,15
309.000	Petroleos Mexicanos*	4,75%	26/02/2029	363.068	0,46
100.000	Picard Bondco SA**	5,38%	01/07/2027	118.590	0,15
100.000	Platin 1426 GmbH**	5,38%	15/06/2023	119.674	0,15
100.000	PLT VII Finance Sarl**	4,63%	05/01/2026	122.389	0,15
100.000	Sappi Papier Holding GmbH*	3,63%	15/03/2028	118.652	0,15
219.000	Sazka Group AS**	3,88%	15/02/2027	261.639	0,33
100.000	Schoeller Packaging BV**	6,38%	01/11/2024	123.103	0,16
233.000	Scientific Games International Inc**	5,50%	15/02/2026	281.153	0,36
100.000	SGL Carbon SE*	4,63%	30/09/2024	121.406	0,15
200.000	Sofima Holding SpA*	3,75%	15/01/2028	238.132	0,30
105.000	Summer BidCo BV**	9,00%	15/11/2025	127.430	0,16
215.000	Tendam Brands SAU*	5,25%	15/09/2024	253.253	0,32
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	1,88%	31/03/2027	108.537	0,14
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	4,50%	01/03/2025	122.437	0,16
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	6,00%	31/01/2025	127.635	0,16
100.000	TI Automotive Finance Plc**	3,75%	15/04/2029	120.844	0,15
112.000	Unilabs Subholding AB**	5,75%	15/05/2025	134.910	0,17
300.000	Verisure Midholding AB*	5,25%	15/02/2029	365.472	0,46
200.000	Vertical Holdco GmbH**	6,63%	15/07/2028	252.575	0,32
113.000	Victoria Plc*	3,63%	24/08/2026	136.084	0,17
100.000	Vivion Investments Sarl*	3,00%	08/08/2024	118.499	0,15
100.000	Wintershall Dea Finance 2 BV*	3,00%	29/12/2049	116.960	0,15

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund (cont.)

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 93,64% (31 de diciembre de 2020: 94,67%) (cont.)					
Euro (cont.)					
200.000	ZF Europe Finance BV*	3,00%	23/10/2029	248.598	0,31
Total euro				12.930.770	16,33
Libra esterlina					
239.000	AA Bond Co Ltd*	6,50%	31/01/2026	342.264	0,43
200.000	Bellis Finco Plc**	4,00%	16/02/2027	276.290	0,35
234.000	CPUK Finance Ltd**	6,50%	28/08/2026	342.249	0,43
100.000	Deuce Finco Plc**	5,50%	15/06/2027	138.121	0,18
100.000	Iceland Bondco Plc**	4,38%	15/05/2028	129.914	0,16
100.000	Iceland Bondco Plc*	4,63%	15/03/2025	135.802	0,17
100.000	Petrobras Global Finance BV*	6,63%	16/01/2034	158.700	0,20
200.000	Pinnacle Bidco Plc*	6,38%	15/02/2025	282.961	0,36
200.000	RAC Bond Co Plc*	5,00%	06/11/2022	276.327	0,35
200.000	Rolls-Royce Plc*	5,75%	15/10/2027	302.119	0,38
182.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC**	4,88%	15/07/2028	255.153	0,32
Total libra esterlina				2.639.900	3,33
Dólar estadounidense					
200.000	Agile Group Holdings Ltd**	5,75%	02/01/2025	201.722	0,25
555.000	Ahead DB Holdings LLC**	6,63%	01/05/2028	575.929	0,73
450.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	6,75%	15/10/2027	473.504	0,60
200.000	Altice Financing SA*	5,00%	15/01/2028	196.597	0,25
670.000	Altice France Holding SA**	6,00%	15/02/2028	668.111	0,85
200.000	Altice France SA*	5,50%	15/01/2028	207.790	0,26
270.000	AMC Networks Inc**	4,25%	15/02/2029	272.700	0,34
325.000	American Airlines Group Inc**	3,75%	01/03/2025	299.866	0,38
160.000	American Airlines Group Inc**	5,00%	01/06/2022	160.202	0,20
145.000	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,50%	20/04/2026	153.700	0,20
185.000	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,75%	20/04/2029	199.955	0,25
30.000	American Axle & Manufacturing Inc*	6,50%	01/04/2027	31.860	0,04
160.000	American Axle & Manufacturing Inc*	6,88%	01/07/2028	174.974	0,22
65.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	5,38%	15/06/2029	67.844	0,09
80.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	5,75%	01/03/2027	83.444	0,11
80.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	5,75%	15/01/2028	84.294	0,11
500.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	7,88%	15/05/2026	560.450	0,71
255.000	Apex Tool Group LLC/BC Mountain Finance Inc**	9,00%	15/02/2023	257.304	0,32
260.000	APX Group Inc**	6,75%	15/02/2027	277.182	0,35
100.000	APX Group Inc**	7,63%	01/09/2023	102.875	0,13

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund (cont.)

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 93,64% (31 de diciembre de 2020: 94,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
200.000	Arabian Centres Sukuk II Ltd*	5,63%	07/10/2026	212.906	0,27
140.000	Aramark Services Inc**	5,00%	01/02/2028	146.475	0,18
85.000	Archrock Partners LP/Archrock Partners Finance Corp**	6,25%	01/04/2028	88.902	0,11
25.000	Archrock Partners LP/Archrock Partners Finance Corp S Series**	6,25%	01/04/2028	26.220	0,03
75.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	5,88%	30/06/2029	75.094	0,09
200.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	7,00%	01/11/2026	209.925	0,27
30.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	8,25%	31/12/2028	33.060	0,04
5.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	9,00%	01/11/2027	6.929	0,01
195.000	AssuredPartners Inc**	5,63%	15/01/2029	195.390	0,24
145.000	AssuredPartners Inc**	7,00%	15/08/2025	148.601	0,19
85.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc**	5,38%	01/03/2029	88.627	0,11
200.000	B2W Digital Lux Sarl**	4,38%	20/12/2030	200.677	0,25
90.000	Bally's Corp*	6,75%	01/06/2027	96.023	0,12
200.000	Banco BTG Pactual SA**	7,75%	15/02/2029	218.468	0,28
200.000	Banco de Bogota SA*	6,25%	12/05/2026	219.257	0,28
200.000	Banco Mercantil del Norte SA*	7,50%	29/12/2049	226.250	0,29
200.000	Bank Muscat SAOG*	4,75%	17/03/2026	208.000	0,26
315.000	Bausch Health Cos Inc**	6,13%	15/04/2025	323.269	0,41
230.000	BCPE Empire Holdings Inc**	7,63%	01/05/2027	235.843	0,30
200.000	Braskem Idesa SAPI*	7,45%	15/11/2029	212.664	0,27
200.000	Braskem Netherlands Finance BV**	8,50%	23/01/2081	233.270	0,29
215.000	BroadStreet Partners Inc**	5,88%	15/04/2029	219.990	0,28
65.000	Buckeye Partners LP**	4,13%	01/12/2027	66.178	0,08
120.000	Buckeye Partners LP**	4,50%	01/03/2028	123.277	0,16
120.000	Buckeye Partners LP**	5,85%	15/11/2043	119.612	0,15
214.000	C&W Senior Financing DAC**	6,88%	15/09/2027	229.098	0,29
485.000	Caesars Entertainment Inc**	8,13%	01/07/2027	540.023	0,68
240.000	Caesars Resort Collection LLC/CRC Finco Inc**	5,25%	15/10/2025	243.707	0,31
85.000	Callon Petroleum Co**	8,00%	01/08/2028	86.063	0,11
337.000	Calpine Corp**	4,63%	01/02/2029	332.263	0,42
285.000	Calpine Corp**	5,00%	01/02/2031	284.145	0,36
75.000	Calpine Corp**	5,13%	15/03/2028	76.419	0,10
200.000	Carnival Corp**	5,75%	01/03/2027	209.750	0,27
20.000	Carnival Corp**	7,63%	01/03/2026	21.750	0,03
290.000	Carnival Corp**	9,88%	01/08/2027	338.942	0,43
205.000	Carnival Corp**	10,50%	01/02/2026	238.936	0,30
520.000	Cars.com Inc**	6,38%	01/11/2028	555.313	0,70
405.000	Carvana Co**	5,50%	15/04/2027	419.357	0,53

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund (cont.)

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 93,64% (31 de diciembre de 2020: 94,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
195.000	Carvana Co**	5,63%	01/10/2025	203.240	0,26
200.000	CAS Capital No 1 Ltd*	4,00%	29/12/2049	200.800	0,25
61.000	Cedar Fair LP**	5,25%	15/07/2029	62.964	0,08
95.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op*	5,38%	15/04/2027	97.991	0,12
420.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op**	6,50%	01/10/2028	453.115	0,57
200.000	Cemex SAB de CV**	7,38%	05/06/2027	225.500	0,28
200.000	Champion Sincerity Holdings Ltd*	8,13%	29/12/2049	205.750	0,26
735.000	Cheniere Energy Inc**	4,25%	15/03/2045	626.373	0,79
200.000	China Evergrande Group*	8,25%	23/03/2022	170.595	0,22
200.000	China Evergrande Group*	8,75%	28/06/2025	132.382	0,17
85.000	CHS/Community Health Systems Inc**	4,75%	15/02/2031	85.212	0,11
40.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,00%	15/01/2029	42.853	0,05
295.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,13%	01/04/2030	299.794	0,38
125.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,88%	15/04/2029	131.173	0,17
320.000	Cinemark USA Inc**	5,88%	15/03/2026	337.334	0,43
130.000	Clarivate Science Holdings Corp**	4,88%	30/06/2029	133.575	0,17
75.000	Colgate Energy Partners III LLC**	5,88%	01/07/2029	77.813	0,10
55.000	CommScope Inc**	7,13%	01/07/2028	59.681	0,07
155.000	CommScope Inc**	8,25%	01/03/2027	165.858	0,21
310.000	CommScope Technologies LLC**	5,00%	15/03/2027	317.750	0,40
235.000	CommScope Technologies LLC**	6,00%	15/06/2025	240.288	0,30
80.000	Comstock Resources Inc**	5,88%	15/01/2030	81.700	0,10
120.000	Comstock Resources Inc**	6,75%	01/03/2029	127.978	0,16
145.000	Cornerstone Building Brands Inc**	6,13%	15/01/2029	155.808	0,20
730.000	CSC Holdings LLC**	5,75%	15/01/2030	759.200	0,96
232.000	CSN Resources SA**	4,63%	10/06/2031	237.303	0,30
272.000	CSN Resources SA**	7,63%	17/04/2026	293.676	0,37
165.000	DaVita Inc**	4,63%	01/06/2030	169.572	0,21
265.000	DCP Midstream Operating LP**	5,85%	21/05/2043	246.390	0,31
50.000	DCP Midstream Operating LP 144A**	5,85%	21/05/2043	46.489	0,06
300.000	Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC**	8,00%	01/02/2028	324.410	0,41
20.000	Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC S Series**	8,00%	01/02/2028	21.627	0,03
115.000	DISH DBS Corp**	5,13%	01/06/2029	113.698	0,14
105.000	DISH DBS Corp**	7,38%	01/07/2028	113.125	0,14
130.000	DISH DBS Corp**	7,75%	01/07/2026	147.388	0,19
200.000	Embraer Netherlands Finance BV*	6,95%	17/01/2028	229.250	0,29
227.000	Emirates NBD Bank PJSC*	6,13%	29/12/2049	244.593	0,31
385.000	Endure Digital Inc**	6,00%	15/02/2029	381.691	0,48

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund (cont.)

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 93,64% (31 de diciembre de 2020: 94,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
75.949	Energiean Israel Finance Ltd*	4,88%	30/03/2026	77.746	0,10
200.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd*	3,38%	12/05/2026	204.110	0,26
185.000	Envision Healthcare Corp**	8,75%	15/10/2026	129.985	0,16
35.000	EPR Properties*	3,75%	15/08/2029	35.092	0,05
121.000	EPR Properties*	4,50%	01/06/2027	129.170	0,16
25.000	EPR Properties**	4,95%	15/04/2028	27.026	0,03
85.000	EQM Midstream Partners LP*	4,13%	01/12/2026	87.235	0,11
40.000	EQM Midstream Partners LP**	4,50%	15/01/2029	40.747	0,05
40.000	EQM Midstream Partners LP**	4,75%	15/01/2031	41.268	0,05
295.000	EQM Midstream Partners LP*	5,50%	15/07/2028	319.361	0,40
115.000	EQM Midstream Partners LP**	6,00%	01/07/2025	125.330	0,16
25.000	EQM Midstream Partners LP**	6,50%	01/07/2027	27.948	0,04
20.000	Everi Holdings Inc*	5,00%	15/07/2029	20.000	0,03
200.000	First Quantum Minerals Ltd**	6,88%	15/10/2027	218.190	0,27
210.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,88%	15/10/2027	225.225	0,28
225.000	Frontier Communications Holdings LLC**	6,75%	01/05/2029	239.686	0,30
200.000	FS Luxembourg Sarl**	10,00%	15/12/2025	224.009	0,28
140.000	Garda World Security Corp**	6,00%	01/06/2029	139.133	0,17
277.000	Garda World Security Corp**	9,50%	01/11/2027	307.342	0,39
80.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	6,25%	15/05/2026	80.360	0,10
65.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	6,50%	01/10/2025	65.781	0,08
50.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	8,00%	15/01/2027	52.594	0,07
200.000	Geopark Ltd**	5,50%	17/01/2027	202.252	0,26
643.304	Global Aircraft Leasing Co Ltd**	6,50%	15/09/2024	647.588	0,82
75.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	5,00%	15/07/2029	78.619	0,10
295.000	Graham Packaging Co Inc**	7,13%	15/08/2028	318.691	0,40
260.000	Granite Merger Sub 2 Inc**	11,00%	15/07/2027	295.863	0,37
160.000	Granite US Holdings Corp**	11,00%	01/10/2027	179.019	0,23
200.000	Greenland Global Investment Ltd*	6,75%	25/06/2022	185.092	0,23
390.000	GTCR AP Finance Inc**	8,00%	15/05/2027	416.713	0,53
196.458	Guara Norte Sarl**	5,20%	15/06/2034	205.063	0,26
245.000	Harsco Corp**	5,75%	31/07/2027	258.362	0,33
245.000	Harvest Midstream I LP**	7,50%	01/09/2028	266.560	0,34
45.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	5,75%	01/02/2029	46.962	0,06
50.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	6,00%	01/02/2031	53.017	0,07
150.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	6,25%	01/11/2028	159.788	0,20
200.000	Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru**	6,38%	01/06/2028	211.250	0,27
200.000	IHS Netherlands Holdco BV**	7,13%	18/03/2025	209.000	0,26

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund (cont.)

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 93,64% (31 de diciembre de 2020: 94,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
200.000	IHS Netherlands Holdco BV**	8,00%	18/09/2027	216.504	0,27
115.000	Illuminate Buyer LLC/Illuminate Holdings IV Inc**	9,00%	01/07/2028	128.457	0,16
90.000	Imola Merger Corp**	4,75%	15/05/2029	92.700	0,12
200.000	Inkia Energy Ltd*	5,88%	09/11/2027	208.276	0,26
220.000	Intelligent Packaging Ltd Finco Inc/Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC**	6,00%	15/09/2028	229.384	0,29
90.000	Iron Mountain Inc**	4,88%	15/09/2029	93.024	0,12
210.000	Iron Mountain Inc**	5,25%	15/03/2028	220.196	0,28
60.000	Iron Mountain Inc**	5,25%	15/07/2030	63.595	0,08
210.000	Iron Mountain Inc**	5,63%	15/07/2032	225.555	0,28
115.000	ITT Holdings LLC**	6,50%	01/08/2029	117.629	0,15
200.000	JBS Finance Luxembourg Sarl**	3,63%	15/01/2032	200.138	0,25
211.000	Joseph T Ryerson & Son Inc**	8,50%	01/08/2028	234.962	0,30
200.000	JSW Hydro Energy Ltd*	4,13%	18/05/2031	203.188	0,26
200.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	10,88%	23/07/2023	199.724	0,25
200.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	11,70%	11/11/2025	188.843	0,24
335.000	KAR Auction Services Inc**	5,13%	01/06/2025	344.196	0,44
270.000	Ken Garff Automotive LLC**	4,88%	15/09/2028	276.414	0,35
200.000	Kenbourne Invest SA**	6,88%	26/11/2024	212.574	0,27
200.000	Krung Thai Bank PCL*	4,40%	29/12/2049	202.494	0,26
75.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC**	4,25%	01/07/2029	76.125	0,10
120.000	Legends Hospitality Holding Co LLC/Legends Hospitality Co-Issuer Inc**	5,00%	01/02/2026	125.250	0,16
220.000	Level 3 Financing Inc**	4,63%	15/09/2027	229.012	0,29
191.906	Leviathan Bond Ltd*	6,50%	30/06/2027	212.891	0,27
215.000	Life Time Inc**	5,75%	15/01/2026	223.081	0,28
185.000	Life Time Inc**	8,00%	15/04/2026	197.787	0,25
400.000	Lions Gate Capital Holdings LLC**	5,50%	15/04/2029	421.018	0,53
460.000	Lumen Technologies Inc**	4,50%	15/01/2029	449.512	0,57
120.000	Lumen Technologies Inc**	5,38%	15/06/2029	122.186	0,15
175.000	Matador Resources Co**	5,88%	15/09/2026	180.486	0,23
200.000	Medco Oak Tree Pte Ltd*	7,38%	14/05/2026	219.191	0,28
200.000	Melco Resorts Finance Ltd*	5,75%	21/07/2028	211.500	0,27
220.000	Mercer International Inc**	5,13%	01/02/2029	226.655	0,29
200.000	Metinvest BV*	8,50%	23/04/2026	228.372	0,29
200.000	MHP SE*	7,75%	10/05/2024	217.711	0,28
290.000	Midwest Gaming Borrower LLC/Midwest Gaming Finance Corp**	4,88%	01/05/2029	290.725	0,37
180.000	Millicom International Cellular SA*	6,63%	15/10/2026	190.972	0,24
200.000	Motion Bondco DAC**	6,63%	15/11/2027	203.292	0,26
555.000	MPH Acquisition Holdings LLC**	5,75%	01/11/2028	558.460	0,71

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund (cont.)

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 93,64% (31 de diciembre de 2020: 94,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
200.000	MTN Mauritius Investments Ltd [*]	6,50%	13/10/2026	231.887	0,29
194.224	MV24 Capital BV [*]	6,75%	01/06/2034	215.468	0,27
200.000	Natura Cosmetics SA ^{**}	4,13%	03/05/2028	205.250	0,26
360.000	NCL Corp Ltd ^{**}	3,63%	15/12/2024	348.167	0,44
155.000	NCL Corp Ltd ^{**}	5,88%	15/03/2026	162.706	0,21
75.000	NCL Finance Ltd ^{**}	6,13%	15/03/2028	78.818	0,10
200.000	Network i2i Ltd [*]	5,65%	29/12/2049	214.625	0,27
435.000	New Fortress Energy Inc ^{**}	6,50%	30/09/2026	445.027	0,56
130.000	New Fortress Energy Inc ^{**}	6,75%	15/09/2025	133.575	0,17
375.000	Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co ^{**}	5,63%	01/10/2028	396.527	0,50
355.000	Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co ^{**}	5,88%	01/10/2030	387.296	0,49
20.000	Occidental Petroleum Corp [*]	7,50%	01/05/2031	25.226	0,03
125.000	Occidental Petroleum Corp ^{**}	7,88%	15/09/2031	160.999	0,20
200.000	Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV ^{**}	5,13%	30/04/2031	206.290	0,26
152.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc/Ortho-Clinical Diagnostics SA ^{**}	7,25%	01/02/2028	166.326	0,21
21.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc/Ortho-Clinical Diagnostics SA ^{**}	7,38%	01/06/2025	22.634	0,03
63.000	Pampa Energia SA [*]	7,38%	21/07/2023	61.381	0,08
540.000	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer ^{**}	5,88%	01/10/2028	576.706	0,73
45.000	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer ^{**}	7,50%	01/06/2025	48.921	0,06
125.000	PDC Energy Inc ^{**}	5,75%	15/05/2026	130.741	0,17
127.000	Petrobras Global Finance BV [*]	5,50%	10/06/2051	127.203	0,16
200.000	Petrobras Global Finance BV [*]	5,60%	03/01/2031	224.250	0,28
200.000	Petroleos Mexicanos [*]	5,95%	28/01/2031	194.550	0,25
250.000	Petroleos Mexicanos [*]	6,50%	23/01/2029	257.625	0,32
200.000	Petroleos Mexicanos ^{**}	6,84%	23/01/2030	206.350	0,26
121.000	Petroleos Mexicanos [*]	6,88%	16/10/2025	134.098	0,17
200.000	Petropavlovsk 2016 Ltd [*]	8,13%	14/11/2022	207.741	0,26
200.000	Petrorio Luxembourg Sarl ^{**}	6,13%	09/06/2026	204.850	0,26
65.000	PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp ^{**}	4,75%	15/02/2028	67.600	0,08
505.000	Presidio Holdings Inc ^{**}	8,25%	01/02/2028	551.041	0,70
250.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc ^{**}	5,75%	15/04/2026	276.825	0,35
90.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc REG S ^{**}	5,75%	15/04/2026	99.657	0,13
115.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc ^{**}	6,25%	15/01/2028	122.477	0,15
445.000	Rackspace Technology Global Inc ^{**}	5,38%	01/12/2028	457.238	0,58
235.000	Radiate Holdco LLC/Radiate Finance Inc ^{**}	6,50%	15/09/2028	247.221	0,31
215.000	Range Resources Corp ^{**}	8,25%	15/01/2029	242.684	0,31
80.000	Range Resources Corp ^{**}	9,25%	01/02/2026	88.340	0,11
40.000	Raptor Acquisition Corp/Raptor Co-Issuer LLC ^{**}	4,88%	01/11/2026	40.609	0,05

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund (cont.)

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 93,64% (31 de diciembre de 2020: 94,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
659.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	5,75%	15/01/2029	689.835	0,87
60.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp S Series**	5,75%	15/01/2029	63.023	0,08
250.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	9,38%	01/04/2027	278.106	0,35
126.000	Resideo Funding Inc**	6,13%	01/11/2026	132.715	0,17
245.000	RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**	4,75%	15/10/2027	252.041	0,32
200.000	RKPF Overseas 2020 A Ltd*	5,20%	12/01/2026	201.351	0,26
475.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	5,50%	01/04/2028	498.061	0,63
200.000	Saka Energi Indonesia PT*	4,45%	05/05/2024	190.148	0,24
200.000	Sasol Financing USA LLC*	5,88%	27/03/2024	214.103	0,27
325.000	Scientific Games International Inc**	7,00%	15/05/2028	355.615	0,45
200.000	SEPLAT Energy Plc*	7,75%	01/04/2026	209.101	0,26
20.000	Service Properties Trust**	3,95%	15/01/2028	18.910	0,02
52.000	Service Properties Trust**	4,35%	01/10/2024	52.432	0,07
50.000	Service Properties Trust**	4,38%	15/02/2030	47.697	0,06
23.000	Service Properties Trust**	4,65%	15/03/2024	23.447	0,03
5.000	Service Properties Trust**	4,95%	15/02/2027	4.991	0,01
260.000	Shriram Transport Finance Co Ltd*	5,10%	16/07/2023	264.680	0,33
280.000	SierraCol Energy Andina LLC**	6,00%	15/06/2028	283.766	0,36
200.000	Simpar Europe SA**	5,20%	26/01/2031	205.576	0,26
190.000	Six Flags Entertainment Corp**	5,50%	15/04/2027	196.515	0,25
135.000	Six Flags Theme Parks Inc**	7,00%	01/07/2025	145.668	0,18
175.000	Solaris Midstream Holdings LLC**	7,63%	01/04/2026	185.719	0,23
335.000	Spirit AeroSystems Inc**	4,60%	15/06/2028	329.146	0,42
75.000	SRS Distribution Inc**	4,63%	01/07/2028	76.781	0,10
175.000	SRS Distribution Inc**	6,13%	01/07/2029	180.500	0,23
200.000	StoneCo Ltd**	3,95%	16/06/2028	199.804	0,25
200.000	Studio City Finance Ltd*	6,50%	15/01/2028	214.741	0,27
60.000	Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp*	5,75%	15/04/2025	55.283	0,07
200.000	Sunac China Holdings Ltd*	6,50%	26/01/2026	192.795	0,25
200.000	Sunac China Holdings Ltd*	8,35%	19/04/2023	207.070	0,26
50.000	Talen Energy Supply LLC**	6,63%	15/01/2028	45.865	0,06
115.000	Talen Energy Supply LLC**	7,25%	15/05/2027	107.453	0,14
20.000	Talen Energy Supply LLC**	7,63%	01/06/2028	18.743	0,02
145.000	Talen Energy Supply LLC**	10,50%	15/01/2026	105.034	0,13
385.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	5,50%	15/01/2028	392.261	0,50
60.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00%	01/03/2027	61.920	0,08
520.000	Team Health Holdings Inc**	6,38%	01/02/2025	495.628	0,63
85.000	TechnipFMC Plc**	6,50%	01/02/2026	91.802	0,12

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund (cont.)

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 93,64% (31 de diciembre de 2020: 94,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
150.000	Telecom Argentina SA**	8,00%	18/07/2026	141.750	0,18
765.000	Tenet Healthcare Corp**	6,13%	01/10/2028	818.282	1,03
200.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV**	7,13%	31/01/2025	220.765	0,28
110.000	TMS International Corp**	6,25%	15/04/2029	115.638	0,15
200.000	Total Play Telecomunicaciones SA de CV**	7,50%	12/11/2025	212.281	0,27
180.000	TransDigm Inc**	4,88%	01/05/2029	181.935	0,23
555.000	TransDigm Inc*	5,50%	15/11/2027	579.281	0,73
220.000	Trident TPI Holdings Inc**	9,25%	01/08/2024	230.850	0,29
210.000	Trivium Packaging Finance BV*	8,50%	15/08/2027	228.850	0,29
200.000	Tullow Oil Plc**	7,00%	01/03/2025	178.300	0,22
200.000	Tullow Oil Plc*	10,25%	15/05/2026	210.399	0,27
200.000	Turk Telekomunikasyon AS*	6,88%	28/02/2025	220.488	0,28
200.000	Turkiye Petrol Rafinerileri AS*	4,50%	18/10/2024	200.360	0,25
200.000	Ulker Biskuvi Sanayi AS*	6,95%	30/10/2025	217.254	0,28
200.000	Unigel Luxembourg SA*	8,75%	01/10/2026	217.112	0,28
105.000	United Airlines Holdings Inc**	4,88%	15/01/2025	109.083	0,14
60.000	United Airlines Holdings Inc**	5,00%	01/02/2024	62.479	0,08
110.000	United Airlines Inc**	4,38%	15/04/2026	113.988	0,14
65.000	United Airlines Inc**	4,63%	15/04/2029	67.356	0,09
120.000	Uniti Group LP/Uniti Fiber Holdings Inc/CSL Capital LLC**	7,13%	15/12/2024	124.200	0,16
485.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC**	6,50%	15/02/2029	486.889	0,61
55.000	US Acute Care Solutions LLC**	6,38%	01/03/2026	57.023	0,07
225.000	USA Compression Partners LP/USA Compression Finance Corp**	6,88%	01/04/2026	236.234	0,30
155.000	USA Compression Partners LP/USA Compression Finance Corp**	6,88%	01/09/2027	165.894	0,21
251.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	8,95%	11/03/2025	246.907	0,31
200.000	Vedanta Resources Ltd*	7,13%	31/05/2023	185.602	0,23
110.000	VICI Properties LP/VICI Note Co Inc**	4,25%	01/12/2026	114.562	0,14
90.000	Vistra Operations Co LLC**	4,38%	01/05/2029	90.563	0,11
155.000	VM Consolidated Inc**	5,50%	15/04/2029	158.264	0,20
100.000	Volcan Compania Minera SAA*	4,38%	11/02/2026	99.327	0,12
200.000	VTR Finance NV**	6,38%	15/07/2028	212.717	0,27
210.000	Watco Cos LLC/Watco Finance Corp**	6,50%	15/06/2027	225.313	0,28
305.000	White Capital Buyer LLC**	6,88%	15/10/2028	326.849	0,41
120.000	White Capital Parent LLC**	8,25%	15/03/2026	124.585	0,16
135.000	Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp**	5,50%	01/03/2025	145.704	0,18
295.000	XP Inc**	3,25%	01/07/2026	292.050	0,37
92.000	YPF SA*	8,50%	28/07/2025	72.933	0,09

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund (cont.)

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 93,64% (31 de diciembre de 2020: 94,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
265.000	Zayo Group Holdings Inc**	6,13%	01/03/2028	271.000	0,34
Total dólar estadounidense				58.538.493	73,98
Total bonos de empresa				74.109.163	93,64
Bonos del Estado 0,31% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)					
Dólar estadounidense					
245.000	Turk Ihracat Kredi Bankasi AS	5,75%	06/07/2026	243.493	0,31
Total bonos del Estado *				243.493	0,31
Total inversiones				75.862.203	95,85

Contratos de divisas a plazo 0,55% (31 de diciembre de 2020: 4,29%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
155.844 €	180.974 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	606	0,00
267.965 €	369.497 USD	19/07/2021	UBS AG	1	702	0,00
15.393.305 USD	12.847.368 €	19/07/2021	UBS AG	1	152.127	0,19
Clases EUR con cobertura						
37.208 €	44.139 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	2	0,00
8.999.338 USD	7.506.448 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	94.237	0,12
8.995.614 USD	7.506.448 €	19/07/2021	UBS AG	1	90.514	0,12
9.522.032 USD	7.943.692 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	15	98.218	0,12
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					436.406	0,55
					Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados					76.298.609	96,40

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,76%) (31 de diciembre de 2020: (3,45%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
34.260 €	41.460 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(817)	(0,00)
240.455 €	207.350 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(1.200)	(0,00)
1.587.755 €	1.903.102 USD	19/07/2021	UBS AG	4	(19.506)	(0,02)
73.591 €	103.481 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(1.814)	(0,00)
3.052.803 USD	2.213.941 €	19/07/2021	UBS AG	1	(5.798)	(0,01)

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (0,76%) (31 de diciembre de 2020: (3,45%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases EUR con cobertura						
15.930.549 €	19.103.530 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	4	(204.691)	(0,27)
15.653.076 €	18.758.831 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(189.166)	(0,24)
15.785.904 €	18.910.755 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	29	(183.511)	(0,22)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(606.503)	(0,76)

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(606.503)	(0,76)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	75.692.106	95,64
Otro activo neto	3.457.355	4,36
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	79.149.461	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	22.895.018	28,26
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	52.967.185	65,38
[∞] Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(170.097)	(0,21)
Total inversiones	75.692.106	93,43

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
869.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp, 5.75%, 15/01/2029	882.025
730.000	CSC Holdings LLC, 5.75%, 15/01/2030	772.581
680.000	Rackspace Technology Global Inc, 5.38%, 01/12/2028	697.939
670.000	Altice France Holding SA, 6.00%, 15/02/2028	671.925
555.000	Ahead DB Holdings LLC, 6.63%, 01/05/2028	566.200
480.000	Tenet Healthcare Corp, 6.13%, 01/10/2028	507.950
455.000	Caesars Entertainment Inc, 8.13%, 01/07/2027	504.865
500.000	Bardot CLO Ltd Series 2019-2X Class E, 7.13%, 22/10/2032	504.505
500.000	Trinitas CLO XII Ltd Series 2020-12X Class E, 7.58%, 25/04/2033	502.910
500.000	Trestles CLO 2017-1 Ltd Series 2017-1X Class D, 8.01%, 25/07/2029	500.005
500.000	Endure Digital Inc, 6.00%, 15/02/2029	499.338
465.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op, 6.50%, 01/10/2028	498.944
500.000	Dryden 49 Senior Loan Fund Series 2017-49X Class E, 6.49%, 18/07/2030	497.060
475.000	Royal Caribbean Cruises Ltd, 5.50%, 01/04/2028	494.525
480.000	Lions Gate Capital, 6.38%, 01/02/2024	493.800
485.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC, 6.50%, 15/02/2029	486.875
430.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp, 7.88%, 15/05/2026	454.800
477.504	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 6.50%, 15/09/2024	445.504
435.000	New Fortress Energy Inc, 6.50%, 30/09/2026	437.025
405.000	Carvana Co, 5.50%, 15/04/2027	412.550

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas (cont.)

20 ventas de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
640.000	Beacon Roofing Supply Inc, 4.88%, 01/11/2025	647.658
535.000	First Quantum Minerals Ltd, 6.88%, 01/03/2026	562.285
470.000	Altice France Holding SA, 10.50%, 15/05/2027	528.750
450.000	Taylor Morrison Communities Inc, 5.88%, 15/06/2027	500.805
445.000	Mileage Plus Holdings LLC/Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 6.50%, 20/06/2027	484.338
415.000	Hub International Ltd, 7.00%, 01/05/2026	431.438
350.000	Petrobras Global Finance BV, 5.60%, 03/01/2031	392.765
275.000	Miller Homes Group Holdings Plc, 5.50%, 15/10/2024	388.740
310.000	Loxam SAS, 6.00%, 15/04/2025	388.211
300.000	Encore Capital Group Inc, 4.88%, 15/10/2025	379.925
400.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 8.30%, 27/05/2025	368.000
330.000	Ford Motor Credit Co LLC, 4.39%, 08/01/2026	356.407
330.000	Uniti Group LP/Uniti Fiber Holdings Inc/CSL Capital LLC, 7.88%, 15/02/2025	355.163
340.000	Performance Food Group Inc, 5.50%, 15/10/2027	354.090
315.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp, 7.63%, 15/06/2025	343.744
340.000	Sirius XM Radio Inc, 4.13%, 01/07/2030	342.182
320.000	Rackspace Technology Global Inc, 5.38%, 01/12/2028	326.816
300.000	TransDigm Inc, 7.50%, 15/03/2027	322.489
305.000	Intelsat Jackson Holdings SA, 8.00%, 15/02/2024	314.913
255.000	Royal Caribbean Cruises Ltd, 11.50%, 01/06/2025	297.713

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 1,80%. En el mismo periodo, el índice de referencia, el Bloomberg Barclays Global Aggregate Index (Total Return, USD Hedged) (el "Índice"), rindió un -1,52%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso.

Los mercados de renta fija sufrieron altibajos en el primer semestre del año. Los mercados se pusieron a prueba en el primer trimestre, con una pronunciada caída de las rentabilidades de los bonos de deuda pública provocada por el creciente optimismo con respecto al ritmo de la recuperación económica, el aumento de la inflación (tanto materializada como esperada) y la magnitud de los futuros estímulos fiscales. En el segundo trimestre asistimos a un cambio de tendencia en la deuda pública, donde los rendimientos en las economías del G4 (Brasil, Alemania, India y Japón) oscilaron entre estables y más bajos, unido al continuo estrechamiento de los diferenciales de crédito. Dicho esto, las rentabilidades de los bonos de deuda pública a plazo intermedio avanzaron durante el periodo analizado —lo que supuso un viento de cara para los títulos más sensibles a los tipos—, mientras que los diferenciales de crédito se contrajeron.

El posicionamiento en tipos de interés contribuyó a la rentabilidad relativa durante el periodo analizado, siendo los principales impulsores de las ganancias las posiciones infraponderadas respecto al Índice en tipos de EE. UU, Europa Central y Reino Unido, mientras que las posiciones sobreponderadas en tipos de Australia y Nueva Zelanda resultaron perjudiciales. La sobreponderación en deuda pública de países europeos periféricos y la asignación a bonos vinculados a la inflación, concretamente los títulos del Tesoro estadounidense protegidos frente a la inflación, aportaron valor. La sobreponderación diversificada de la Cartera en crédito fue un importante motor de la rentabilidad superior, aunque también aportaron rendimientos la deuda de alta rentabilidad europea, la deuda de mercados emergentes ("EMD") denominada en divisas fuertes, las transferencias del riesgo crediticio y las obligaciones de préstamos garantizados ("CLO"). La selección de valores en crédito con grado de inversión ("IG") y valores con garantía hipotecaria de agencias estadounidenses también aportó valor. La asignación a EMD en divisas locales y la exposición infraponderada en crédito IG global restaron valor durante el periodo. Nuestra estrategia activa en divisas contribuyó a los resultados durante el periodo. Las posiciones más rentables fueron nuestra sobreponderación al franco suizo y la infraponderación al dólar canadiense, mientras que la sobreponderación al yen japonés y la infraponderación al dólar australiano fueron las menos rentables.

Creemos probable que la volatilidad del mercado aumente en el segundo semestre del año. Prevemos una retirada gradual de estímulos y un giro de política tanto de la Reserva Federal estadounidense ("Fed") como del Banco Central Europeo ("BCE") en el segundo semestre de 2021, lo cual obligará a los mercados a adaptarse a una política monetaria menos acomodaticia incluso con una comunicación y previsión perfectas de los bancos centrales. En segundo lugar, es probable que los mercados se muestren más reactivos a los datos económicos reales. Un avance significativo, tanto al alza como a la baja, del crecimiento y la inflación probablemente afectaría a la trayectoria de la política de los bancos centrales.

Por otra parte, se ha reducido la probabilidad de unos resultados económicos de "cola derecha". Tras la reunión de la Fed celebrada en junio se desprende que no es deseable permanecer mucho tiempo con tasas de inflación superiores al 3,5%. Por consiguiente, invertir durante periodos prolongados de inflación notablemente superior al 2% probablemente no tenga sentido, dado que la Fed ha definido su umbral de tolerancia de aumento de la inflación, incluso en el contexto de su nuevo marco del objetivo de inflación media. Cuando la Fed comience finalmente a subir los tipos, puede que el ritmo sea más fuerte de lo que se espera actualmente, dependiendo del nivel y de la evolución de la inflación.

Aunque el cambio de tono de la Fed fue el principal acontecimiento en los mercados de renta fija en el primer semestre del año, creemos que el segundo semestre debería representar una especie de punto de inflexión para la zona euro a medida que se normaliza la actividad. Los sectores de servicios europeos han reabierto gradualmente a medida que se ha ido controlando la pandemia. A principios de julio, el Euro Recovery Fund comenzará a repartir "becas" a países específicos para financiar el gasto en activos fijos durante los próximos trimestres. Además, el BCE ha introducido un nuevo mecanismo de flexibilidad en su programa de compras de bonos, que debería permitirle iniciar sin contratiempos la retirada gradual del Programa de Compras de Emergencia frente a la Pandemia ("PEPP").

Prevemos un entorno constante en el que los tipos de interés se moverán de manera dentro de una banda, con un sesgo alcista en respuesta a una recuperación económica mundial duradera. Prevemos que las tasas de equilibrio de la inflación estadounidense se negociarán en un rango más estrecho; una conclusión probable que cabría extraer de la reunión de la Fed en junio es que la probabilidad de que la Fed tolere un movimiento alcista más estructural de las tasas de inflación es bastante baja. También es importante destacar que, en nuestra opinión, los detonantes subyacentes de los estrechos diferenciales de crédito, el fuerte crecimiento económico y las bajas tasas de impago probablemente no se vean demasiado afectados por la evolución del panorama de los bancos centrales.

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		93.623.003	105.831.485
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	2.092.650	5.263.344
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		1.203.356	504.845
Cuentas a percibir por acciones emitidas		5.035.847	—
Cuentas por cobrar de intermediarios		2.882.610	1.156.235
Ingresos a percibir y otros activos		1.003.687	965.029
Activos totales		105.841.153	113.720.938
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		3.026.796	5.098.928
Descubierto bancario	3	486	1.078
Gastos devengados		55.734	57.481
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		6.542.295	10.753.576
Otras cuentas por pagar		36.893	12.420
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		9.662.204	15.923.483
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		96.178.949	97.797.455

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		1.569.196	1.972.915
Ingresos por dividendos		110.421	121.032
Ingresos por préstamo de valores	15	1.481	76
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		114.298	(11.537.408)
		1.795.396	(9.443.385)
Gastos			
Comisión de gestión	5	115.589	188.443
Comisión de distribución	5	4.314	3.354
Comisión de administración	5	80.143	97.958
Comisión de compromiso	16	8.636	8.054
Comisión de depósito	5	6.025	6.199
Comisión del Depositario	5	2.394	6.435
Honorarios profesionales	7	39.864	22.033
Honorarios de los Consejeros	6	2.413	2.375
Costes de transacciones	7	43.009	50.969
Honorarios de auditoría	7	9.252	8.275
Reembolso de IVA		(455)	(425)
Otros gastos	7	4.379	10.735
Gastos no asumidos	5	(82.261)	(58.480)
Renuncia a la comisión de asesoría	5	(596)	(521)
Gastos totales		232.706	345.404
Costes financieros			
Gastos por intereses		–	2.903
Repartos de dividendos abonados	1	74.819	158.650
		74.819	161.553
Impuestos retenidos en origen		2.159	–
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		1.485.712	(9.950.342)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	97.797.455	173.694.752
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	1.485.712	(9.950.342)
Suscripciones	5.395.781	29.301.406
Reembolsos	(8.499.999)	(113.314.369)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	96.178.949	79.731.447

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

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 Tesoro 3,45% (31 de diciembre de 2020: 3,40%)					
Dólar estadounidense					
3.325.000	United States Treasury Bill	0,00%	02/12/2021	3.324.336	3,45
Total bonos del Tesoro **				3.324.336	3,45
Bonos de agencia 0,43% (31 de diciembre de 2020: 0,44%)					
Dólar estadounidense					
280.000	Federal Home Loan Banks	5,50%	15/07/2036	412.322	0,43
Total bonos de agencia *				412.322	0,43
Valores respaldados por activos 10,06% (31 de diciembre de 2020: 9,69%)					
Euro					
570.946	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC Class A	0,93%	24/02/2058	678.185	0,70
264.091	Futura S.r.l. 2019-1 Class A	2,61%	31/07/2044	314.472	0,33
400.000	Santander Consumer Finance SA 4 Series 4 Class C	2,20%	18/09/2032	476.504	0,50
Total euro				1.469.161	1,53
Libra esterlina					
295.000	Ripon Mortgages Plc Class D2	1,88%	20/08/2056	410.711	0,42
Total libra esterlina				410.711	0,42
Dólar estadounidense					
250.000	CIFC Funding 2018-II Ltd Class C	3,04%	20/04/2031	249.305	0,26
787.994	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2	2,34%	25/07/2030	799.738	0,83
288.551	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2	2,74%	25/02/2030	293.458	0,30
508.074	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2	3,09%	25/10/2029	524.396	0,55
221.767	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2	2,29%	25/08/2030	224.413	0,23
250.000	Flatiron CLO 17 Ltd Series 2017-1X Class E	6,06%	15/05/2030	249.985	0,26
850.960	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2	1,89%	25/07/2030	856.974	0,89
970.578	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2	2,39%	25/09/2030	985.645	1,02
1.173.000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2	2,59%	25/03/2030	1.200.444	1,25
1.138.807	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2	2,74%	25/12/2029	1.160.078	1,21
250.000	Milos CLO Ltd 2017-1X Class E	6,37%	20/10/2030	247.851	0,26
250.000	Octagon Investment Partners 35 Ltd Series 2018-1X Class C	0,00%	20/01/2031	246.990	0,26
750.000	Trinitas CLO XII, Ltd Series 2020-12X Class D	0,00%	25/04/2033	758.531	0,79
Total dólar estadounidense				7.797.808	8,11
Total valores respaldados por activos **				9.677.680	10,06

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

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 44,75% (31 de diciembre de 2020: 49,30%)					
Euro					
300.000	Accor SA*	2,63%	29/12/2049	347.815	0,36
300.000	Altice Finco SA*	4,75%	15/01/2028	348.411	0,36
247.000	Altice France Holding SA*	4,00%	15/02/2028	281.176	0,29
158.000	Altice France Holding SA*	8,00%	15/05/2027	202.482	0,21
139.000	Ashland Services BV**	2,00%	30/01/2028	166.971	0,17
200.000	AT&T Inc*	2,05%	19/05/2032	262.255	0,27
199.000	Autostrade per l'Italia SpA*	1,88%	26/09/2029	243.154	0,25
200.000	Avis Budget Finance Plc**	4,75%	30/01/2026	242.237	0,25
407.000	Banijay Group SAS**	6,50%	01/03/2026	498.116	0,52
130.000	Brunello Bidco SpA*	3,50%	15/02/2028	154.089	0,16
200.000	Carnival Corp*	7,63%	01/03/2026	262.493	0,27
300.000	Casino Guichard Perrachon SA*	4,05%	05/08/2026	346.845	0,36
100.000	Casino Guichard Perrachon SA*	4,50%	07/03/2024	120.522	0,13
200.000	Centurion Bidco SpA*	5,88%	30/09/2026	247.556	0,26
307.000	Clarios Global LP/Clarios US Finance Co**	4,38%	15/05/2026	377.616	0,39
278.000	CMA CGM SA*	5,25%	15/01/2025	336.843	0,35
200.000	Constellium SE*	4,25%	15/02/2026	241.374	0,25
100.000	Credit Suisse Group AG*	0,65%	10/09/2029	116.857	0,12
315.000	doValue SpA**	5,00%	04/08/2025	391.081	0,41
200.000	Dufry One BV**	2,00%	15/02/2027	223.530	0,23
381.000	eG Global Finance Plc*	4,38%	07/02/2025	446.804	0,46
400.000	Encore Capital Group Inc*	4,88%	15/10/2025	501.329	0,52
39.000	European Union*	0,00%	04/07/2031	46.125	0,05
7.000	European Union*	0,30%	04/11/2050	7.524	0,01
13.000	European Union*	0,70%	06/07/2051	15.615	0,02
100.000	Fidelity National Information Services Inc*	2,00%	21/05/2030	131.062	0,14
100.000	Fiserv Inc*	1,63%	01/07/2030	127.218	0,13
185.000	General Motors Financial Co Inc*	0,96%	07/09/2023	223.563	0,23
205.000	Gestamp Automocion SA*	3,25%	30/04/2026	246.926	0,26
200.000	Grupo Antolin-Irausa SA*	3,50%	30/04/2028	236.445	0,25
139.000	House of Finance NV**	4,38%	15/07/2026	167.381	0,17
136.000	House of HR**	7,50%	15/01/2027	171.687	0,18
100.000	Infineon Technologies AG*	1,63%	24/06/2029	127.639	0,13
200.000	Infineon Technologies AG*	3,63%	29/12/2049	260.405	0,27
450.000	Intrum AB*	3,00%	15/09/2027	526.552	0,55
200.000	IPD 3 BV*	5,50%	01/12/2025	246.596	0,26
272.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	4,50%	15/01/2026	342.546	0,36
100.000	JPMorgan Chase & Co*	1,81%	12/06/2029	129.892	0,13

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

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 44,75% (31 de diciembre de 2020: 49,30%) (cont.)					
Euro (cont.)					
300.000	Kapla Holding SAS*	3,38%	15/12/2026	354.366	0,37
300.000	Kleopatra Holdings 2 SCA*	6,50%	01/09/2026	346.003	0,36
165.000	Kronos International Inc**	3,75%	15/09/2025	200.061	0,21
474.000	La Financiere Atalian SASU*	4,00%	15/05/2024	560.157	0,58
250.000	Laboratoire Eimer Selas**	5,00%	01/02/2029	302.811	0,31
200.000	LeasePlan Corp NV*	7,38%	29/12/2049	265.049	0,28
100.000	Lloyds Banking Group Plc*	1,50%	12/09/2027	127.448	0,13
291.000	Loxam SAS*	5,75%	15/07/2027	360.281	0,37
309.000	Loxam SAS*	6,00%	15/04/2025	374.028	0,39
300.000	Maxeda DIY Holding BV**	5,88%	01/10/2026	364.691	0,38
220.000	Modulaire Global Finance Plc**	6,50%	15/02/2023	266.977	0,28
189.000	Mooney Group SpA**	3,88%	17/12/2026	224.920	0,23
100.000	Morgan Stanley*	0,50%	26/10/2029	118.092	0,12
409.000	Motion Bondco DAC*	4,50%	15/11/2027	472.091	0,49
100.000	NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance Plc*	7,13%	19/07/2024	123.640	0,13
278.000	NH Hotel Group SA*	4,00%	02/07/2026	329.968	0,34
340.000	Nidda BondCo GmbH**	5,00%	30/09/2025	404.538	0,42
371.000	Nouryon Holding BV*	6,50%	01/10/2026	459.765	0,48
453.000	Paprec Holding SA*	4,00%	31/03/2025	547.957	0,57
677.000	Petroleos Mexicanos*	4,75%	26/02/2029	795.459	0,83
300.000	Petroleos Mexicanos*	4,88%	21/02/2028	360.692	0,37
385.000	Platin 1426 GmbH**	5,38%	15/06/2023	460.745	0,48
304.000	Playtech Plc*	4,25%	07/03/2026	371.441	0,39
308.000	PLT VII Finance Sarl**	4,63%	05/01/2026	376.958	0,39
200.000	Renault SA*	2,00%	28/09/2026	235.899	0,25
310.000	Repsol International Finance BV*	4,25%	29/12/2049	404.340	0,42
450.000	Sazka Group AS**	3,88%	15/02/2027	537.615	0,56
200.000	Schaeffler AG*	3,38%	12/10/2028	261.239	0,27
134.000	Schoeller Packaging BV**	6,38%	01/11/2024	164.957	0,17
204.000	Scientific Games International Inc**	5,50%	15/02/2026	246.159	0,26
430.000	SGL Carbon SE*	4,63%	30/09/2024	522.048	0,54
275.000	Sofima Holding SpA*	3,75%	15/01/2028	327.431	0,34
200.000	SoftBank Group Corp*	5,00%	15/04/2028	265.120	0,28
155.000	SpA Holdings 3 Oy*	3,63%	04/02/2028	185.190	0,19
180.000	Summer BC Holdco B Sarl**	5,75%	31/10/2026	223.308	0,23
429.360	Summer BidCo BV**	9,00%	15/11/2025	521.080	0,54
202.000	Summit Properties Ltd*	2,00%	31/01/2025	237.763	0,25
210.000	Sunshine Mid BV*	6,50%	15/05/2026	258.126	0,27

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

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 44,75% (31 de diciembre de 2020: 49,30%) (cont.)					
Euro (cont.)					
216.000	Telecom Italia SpA**	3,00%	30/09/2025	273.982	0,28
100.000	Tendam Brands SAU*	5,25%	15/09/2024	117.792	0,12
250.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	1,63%	15/10/2028	261.056	0,27
524.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	6,00%	31/01/2025	668.808	0,70
134.000	Unilabs Subholding AB**	5,75%	15/05/2025	161.410	0,17
100.000	United Group BV**	3,63%	15/02/2028	115.121	0,12
200.000	UPC Holding BV*	3,88%	15/06/2029	240.928	0,25
200.000	Veolia Environnement SA*	2,50%	29/12/2049	238.328	0,25
300.000	Verisure Midholding AB*	5,25%	15/02/2029	365.472	0,38
100.000	Verizon Communications Inc*	1,88%	26/10/2029	131.253	0,14
408.000	Vertical Holdco GmbH**	6,63%	15/07/2028	515.252	0,54
180.000	Victoria Plc**	3,75%	15/03/2028	216.657	0,23
100.000	Virgin Money UK Plc*	2,88%	24/06/2025	127.447	0,13
200.000	Vivion Investments Sarl*	3,50%	01/11/2025	240.073	0,25
100.000	Wintershall Dea Finance 2 BV*	3,00%	29/12/2049	116.959	0,12
500.000	ZF Europe Finance BV*	3,00%	23/10/2029	621.494	0,65
Total euro				26.737.177	27,80
Libra esterlina					
235.000	AA Bond Co Ltd*	6,50%	31/01/2026	336.535	0,35
131.000	Anglian Water Osprey Financing Plc*	5,00%	30/04/2023	192.317	0,20
195.000	Bellis Finco Plc*	4,00%	16/02/2027	269.383	0,28
212.000	CPUK Finance Ltd**	6,50%	28/08/2026	310.072	0,32
300.000	Danske Bank AS*	2,25%	14/01/2028	425.970	0,44
265.000	Iceland Bondco Plc*	4,63%	15/03/2025	359.875	0,37
120.000	National Express Group Plc*	4,25%	29/12/2049	172.233	0,18
500.000	NGG Finance Plc*	5,63%	18/06/2073	770.098	0,80
120.000	Petrobras Global Finance BV*	6,63%	16/01/2034	190.440	0,20
200.000	Phoenix Group Holdings*	5,75%	07/07/2021	276.470	0,29
244.000	Pinnacle Bidco Plc*	6,38%	15/02/2025	345.213	0,36
200.000	RAC Bond Co Plc*	5,00%	06/11/2022	276.327	0,29
341.000	Rolls-Royce Plc*	5,75%	15/10/2027	515.112	0,53
250.000	Virgin Media Secured Finance Plc*	4,25%	15/01/2030	343.759	0,36
200.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC**	4,88%	15/07/2028	280.388	0,29
300.000	Volkswagen Financial Services NV*	4,25%	09/10/2025	468.440	0,49
172.000	Westfield America Management Ltd*	2,63%	30/03/2029	242.143	0,25
Total libra esterlina				5.774.775	6,00

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

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 44,75% (31 de diciembre de 2020: 49,30%) (cont.)					
Dólar estadounidense					
115.000	AbbVie Inc*	4,88%	14/11/2048	148.402	0,15
200.000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*	4,60%	02/11/2047	236.402	0,25
85.000	Air Lease Corp*	2,30%	01/02/2025	87.947	0,09
270.000	Anheuser-Busch Cos LLC/Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc*	4,90%	01/02/2046	342.351	0,36
75.000	Apple Inc**	4,65%	23/02/2046	99.708	0,10
340.000	AT&T Inc*	3,65%	01/06/2051	353.875	0,37
85.000	Bank of America Corp**	2,50%	13/02/2031	86.877	0,09
100.000	Bank of America Corp**	3,71%	24/04/2028	110.640	0,12
145.000	Barclays Plc*	2,85%	07/05/2026	153.270	0,16
190.000	Boeing Co*	5,81%	01/05/2050	256.280	0,27
115.000	BP Capital Markets America Inc*	3,63%	06/04/2030	129.033	0,13
140.000	Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais†	5,33%	15/02/2028	152.005	0,16
130.000	British Telecommunications Plc*	3,25%	08/11/2029	138.242	0,14
120.000	Broadcom Inc**	4,15%	15/11/2030	134.703	0,14
45.000	Canadian Natural Resources Ltd*	4,95%	01/06/2047	56.059	0,06
80.000	Capital One Financial Corp*	3,20%	30/01/2023	83.316	0,09
185.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	4,80%	01/03/2050	212.878	0,22
55.000	Cigna Corp*	3,20%	15/03/2040	57.177	0,06
95.000	Citigroup Inc**	2,98%	05/11/2030	100.760	0,10
65.000	Citigroup Inc**	3,35%	24/04/2025	69.296	0,07
25.000	Citigroup Inc**	3,52%	27/10/2028	27.393	0,03
60.000	CVS Health Corp*	4,13%	01/04/2040	69.772	0,07
150.000	CVS Health Corp*	5,05%	25/03/2048	195.193	0,20
50.000	Discovery Communications LLC**	3,63%	15/05/2030	54.600	0,06
100.000	DTE Energy Co*	3,40%	15/06/2029	109.517	0,11
60.000	Energy Transfer LP**	4,95%	15/06/2028	69.458	0,07
50.000	Energy Transfer LP*	6,25%	15/04/2049	65.723	0,07
95.000	EPR Properties*	3,75%	15/08/2029	95.251	0,10
100.000	Exxon Mobil Corp*	3,45%	15/04/2051	109.064	0,11
195.000	Fox Corp**	5,58%	25/01/2049	263.923	0,27
280.000	Gazprom PJSC via Gaz Finance Plc*	3,25%	25/02/2030	278.320	0,29
145.000	General Motors Co*	6,13%	01/10/2025	171.752	0,18
195.000	Goldman Sachs Group Inc**	2,62%	22/04/2032	199.344	0,21
105.000	Goldman Sachs Group Inc**	3,27%	29/09/2025	112.364	0,12
110.000	Goldman Sachs Group Inc**	3,69%	05/06/2028	121.532	0,13
70.000	Goldman Sachs Group Inc**	3,81%	23/04/2029	78.371	0,08
80.000	Goldman Sachs Group Inc**	4,02%	31/10/2038	93.998	0,10
40.000	HCA Inc*	5,25%	15/06/2049	51.085	0,05

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

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 44,75% (31 de diciembre de 2020: 49,30%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
90.000	Healthcare Trust of America Holdings LP*	3,10%	15/02/2030	95.708	0,10
95.000	JPMorgan Chase & Co**	2,96%	13/05/2031	99.901	0,10
70.000	JPMorgan Chase & Co**	3,11%	22/04/2041	72.754	0,08
200.000	KazMunayGas National Co JSC*	5,38%	24/04/2030	238.771	0,25
60.000	Kinder Morgan Inc*	4,30%	01/03/2028	68.529	0,07
170.000	Kinder Morgan Inc*	5,55%	01/06/2045	220.442	0,23
115.000	Marathon Petroleum Corp*	4,70%	01/05/2025	129.789	0,13
165.000	Morgan Stanley**	2,70%	22/01/2031	172.855	0,18
65.000	Morgan Stanley*	3,63%	20/01/2027	72.133	0,08
145.000	MPLX LP*	4,70%	15/04/2048	168.893	0,18
65.000	Mylan Inc**	4,55%	15/04/2028	74.791	0,08
210.000	Natwest Group Plc*	3,07%	22/05/2028	221.755	0,23
110.000	Occidental Petroleum Corp*	3,20%	15/08/2026	111.141	0,12
50.000	Oracle Corp*	4,00%	15/07/2046	54.312	0,06
60.000	Pacific Gas & Electric Co*	3,30%	01/08/2040	54.313	0,06
95.000	Pacific Gas & Electric Co*	4,30%	15/03/2045	91.544	0,10
1.360.000	Petroleos de Venezuela SA*	5,38%	12/04/2027	61.200	0,06
200.000	Petroleos del Peru SA*	5,63%	19/06/2047	213.450	0,22
133.000	Petroleos Mexicanos*	5,95%	28/01/2031	129.376	0,13
115.000	Petroleos Mexicanos*	6,75%	21/09/2047	101.920	0,11
21.000	Petroleos Mexicanos**	6,84%	23/01/2030	21.667	0,02
79.000	Petroleos Mexicanos*	7,69%	23/01/2050	76.136	0,08
310.000	Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp**	3,55%	15/12/2029	326.757	0,34
90.000	Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp**	4,65%	15/10/2025	100.757	0,10
380.000	Southern Gas Corridor CJSC*	6,88%	24/03/2026	455.244	0,47
800.000	SSE Plc*	4,75%	16/09/2077	827.120	0,86
155.000	Synchrony Financial*	2,85%	25/07/2022	158.691	0,17
118.000	Sysco Corp*	6,60%	01/04/2050	183.623	0,19
90.407	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust**	5,88%	15/10/2027	100.503	0,10
235.000	Verizon Communications Inc*	3,55%	22/03/2051	251.415	0,26
115.000	ViacomCBS Inc**	4,95%	15/01/2031	138.752	0,14
75.000	Vodafone Group Plc**	5,25%	30/05/2048	99.005	0,10
120.000	Wells Fargo & Co**	2,57%	11/02/2031	124.284	0,13
25.000	Wells Fargo & Co**	5,01%	04/04/2051	34.316	0,04
Total dólar estadounidense				10.527.728	10,95
Total bonos de empresa				43.039.680	44,75

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

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 del Estado 24,30% (31 de diciembre de 2020: 25,55%)					
Dólar canadiense					
1.610.000	Canada Housing Trust No 1*	2,90%	15/06/2024	1.381.127	1,43
Total dólar canadiense				1.381.127	1,43
Corona checa					
11.060.000	Czech Republic Government Bond*	0,95%	15/05/2030	477.904	0,50
Total corona checa				477.904	0,50
Euro					
33.823	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	0,00%	15/02/2031	41.065	0,04
106.500	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	0,50%	15/02/2026	132.905	0,14
150.000	Croatia Government International Bond*	1,50%	17/06/2031	185.137	0,19
34.000	Cyprus Government International Bond*	0,00%	09/02/2026	40.518	0,04
11.026	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond*	0,10%	15/04/2023	13.439	0,01
15.318	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond*	0,10%	15/04/2033	21.987	0,02
4.000	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond**	0,10%	15/04/2046	6.771	0,01
20.904	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond*	0,50%	15/04/2030	29.927	0,03
100.000	Egypt Government International Bond*	6,38%	11/04/2031	123.339	0,13
137.490	French Republic Government Bond OAT*	0,10%	01/03/2025	173.499	0,18
80.797	French Republic Government Bond OAT*	0,10%	01/03/2028	106.414	0,11
101.069	French Republic Government Bond OAT*	0,10%	25/07/2031	138.357	0,14
97.354	French Republic Government Bond OAT**	0,25%	25/07/2024	123.392	0,13
17.000	French Republic Government Bond OAT*	0,50%	25/05/2029	21.147	0,02
87.081	French Republic Government Bond OAT**	1,85%	25/07/2027	126.702	0,13
328.973	French Republic Government Bond OAT**	2,10%	25/07/2023	421.565	0,44
4.000	Hungary Government International Bond*	1,75%	05/06/2035	5.020	0,01
200.000	Indonesia Government International Bond*	1,40%	30/10/2031	241.149	0,25
200.000	Indonesia Government International Bond*	3,75%	14/06/2028	281.325	0,29
21.000	Ireland Government Bond*	0,20%	18/10/2030	25.193	0,03
35.000	Ireland Government Bond*	0,55%	22/04/2041	40.681	0,04
23.000	Ireland Government Bond*	2,40%	15/05/2030	33.077	0,03
34.347	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,40%	11/04/2024	42.046	0,04
7.214	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	0,40%	15/05/2030	9.244	0,01
18.098	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,65%	28/10/2027	22.769	0,02
24.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,85%	15/01/2027	29.449	0,03
58.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	0,90%	01/04/2031	69.568	0,07
64.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	0,95%	15/09/2027	78.806	0,08
20.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	0,95%	01/12/2031	23.913	0,03
102.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	1,35%	01/04/2030	128.126	0,13

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

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 del Estado 24,30% (31 de diciembre de 2020: 25,55%) (cont.)					
Euro (cont.)					
33.360	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,40%	26/05/2025	42.750	0,04
33.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,45%	15/05/2025	41.426	0,04
7.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	1,50%	30/04/2045	8.058	0,01
23.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,60%	01/06/2026	29.263	0,03
8.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,70%	01/09/2051	9.180	0,01
11.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	1,85%	01/07/2025	14.022	0,02
14.681	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	3,10%	15/09/2026	21.301	0,02
1.988.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	3,45%	01/03/2048	3.210.252	3,34
310.000	Ivory Coast Government International Bond*	5,88%	17/10/2031	394.946	0,41
100.000	Kazakhstan Government International Bond*	2,38%	09/11/2028	132.454	0,14
25.400	Kingdom of Belgium Government Bond*	1,60%	22/06/2047	35.516	0,04
18.000	Kingdom of Belgium Government Bond*	3,75%	22/06/2045	35.438	0,04
100.000	Philippine Government International Bond*	1,75%	28/04/2041	117.199	0,12
25.925	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT**	0,30%	17/10/2031	30.430	0,03
5.300	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*	0,48%	18/10/2030	6.402	0,01
160.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT**	2,20%	17/10/2022	196.736	0,21
217.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*	2,88%	15/10/2025	293.802	0,31
35.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT**	2,88%	21/07/2026	48.240	0,05
7.416	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*	4,10%	15/02/2045	14.217	0,02
23.000	Romanian Government International Bond*	2,00%	28/01/2032	27.538	0,03
15.000	Romanian Government International Bond**	2,88%	26/05/2028	19.840	0,02
69.000	Romanian Government International Bond*	3,38%	28/01/2050	87.069	0,09
23.000	Romanian Government International Bond*	3,62%	26/05/2030	31.508	0,03
202.000	Romanian Government International Bond*	3,88%	29/10/2035	281.022	0,29
23.000	Romanian Government International Bond*	4,13%	11/03/2039	32.245	0,03
18.300	Slovakia Government Bond*	0,38%	21/04/2036	21.463	0,02
21.000	Slovenia Government Bond*	0,13%	01/07/2031	24.871	0,03
44.000	Spain Government Bond*	0,50%	31/10/2031	52.222	0,05
43.000	Spain Government Bond*	0,80%	30/07/2027	53.627	0,06
32.000	Spain Government Bond*	0,85%	30/07/2037	37.326	0,04
37.000	Spain Government Bond*	1,30%	31/10/2026	47.370	0,05
14.000	Spain Government Bond*	1,40%	30/04/2028	18.137	0,02
1.462.000	Spain Government Bond*	1,95%	30/07/2030	1.987.956	2,07
376.765	Spain Government Inflation Linked Bond*	0,65%	30/11/2027	506.493	0,53
11.503	Spain Government Inflation Linked Bond*	0,70%	30/11/2033	16.221	0,02
70.000	State of North Rhine-Westphalia Germany*	1,45%	16/02/2043	97.964	0,10
Total euro				10.761.034	11,19

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

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 del Estado 24,30% (31 de diciembre de 2020: 25,55%) (cont.)					
Yen japonés					
17.000.000	Japan Government Thirty Year Bond*	0,70%	20/12/2048	155.474	0,16
Total yen japonés				155.474	0,16
Dólar de Nueva Zelanda					
140.000	International Bank for Reconstruction & Development*	3,38%	25/01/2022	99.452	0,10
665.000	New Zealand Government Bond*	3,50%	14/04/2033	540.072	0,56
Total dólar de Nueva Zelanda				639.524	0,66
Zloty polaco					
1.843.000	Republic of Poland Government Bond**	1,25%	25/10/2030	468.617	0,49
Total zloty polaco				468.617	0,49
Dólar estadounidense					
200.000	Angolan Government International Bond*	9,50%	12/11/2025	218.549	0,23
261.019	Argentine Republic Government International Bond*	0,13%	09/01/2038	99.012	0,10
200.000	Argentine Republic Government International Bond*	0,13%	09/07/2041	71.700	0,08
182.337	Argentine Republic Government International Bond*	1,00%	09/07/2029	69.503	0,07
90.000	Brazilian Government International Bond*	8,25%	20/01/2034	124.459	0,13
200.000	Colombia Government International Bond*	3,00%	30/01/2030	196.303	0,20
100.000	Colombia Government International Bond*	6,13%	18/01/2041	118.731	0,12
200.000	Costa Rica Government International Bond*	7,16%	12/03/2045	209.502	0,22
200.000	Development Bank of Mongolia LLC*	7,25%	23/10/2023	215.453	0,22
150.000	Dominican Republic International Bond*	6,00%	19/07/2028	170.850	0,18
100.000	Dominican Republic International Bond*	6,85%	27/01/2045	113.535	0,12
12.974	Ecuador Government International Bond*	0,00%	31/07/2030	7.217	0,01
117.800	Ecuador Government International Bond*	0,50%	31/07/2030	101.015	0,11
99.060	Ecuador Government International Bond*	0,50%	31/07/2035	68.351	0,07
45.400	Ecuador Government International Bond*	0,50%	31/07/2040	28.318	0,03
229.000	Egypt Government International Bond*	8,50%	31/01/2047	239.276	0,25
200.000	El Salvador Government International Bond*	8,63%	28/02/2029	196.000	0,20
200.000	Ghana Government International Bond*	7,63%	16/05/2029	201.988	0,21
200.000	Ghana Government International Bond*	10,75%	14/10/2030	252.433	0,26
220.000	Lebanon Government International Bond*	6,60%	27/11/2026	27.362	0,03
12.000	Lebanon Government International Bond*	8,25%	17/05/2034	1.501	0,00
120.000	Mexico Government International Bond*	5,75%	12/10/2110	143.940	0,15
200.000	Oman Government International Bond*	6,00%	01/08/2029	212.338	0,22
200.000	Paraguay Government International Bond*	4,95%	28/04/2031	230.750	0,24
250.000	Qatar Government International Bond*	3,75%	16/04/2030	282.474	0,29

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

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 del Estado 24,30% (31 de diciembre de 2020: 25,55%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
264.000	Republic of South Africa Government International Bond*	4,85%	30/09/2029	280.718	0,29
200.000	Republic of Uzbekistan Bond*	4,75%	20/02/2024	212.891	0,22
200.000	Senegal Government International Bond*	6,75%	13/03/2048	202.530	0,21
200.000	Serbia International Bond*	2,13%	01/12/2030	189.197	0,20
200.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,75%	18/04/2028	126.000	0,13
200.000	Sri Lanka Government International Bond*	7,85%	14/03/2029	128.000	0,13
200.000	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*	6,13%	03/05/2024	206.543	0,22
220.000	Ukraine Government International Bond*	1,26%	31/05/2040	260.700	0,27
350.000	Ukraine Government International Bond*	7,75%	01/09/2027	386.096	0,40
358.365	United States Treasury Inflation Indexed Bonds*	0,25%	15/02/2050	406.468	0,42
1.000.336	United States Treasury Inflation Indexed Bonds**	1,38%	15/02/2044	1.382.475	1,44
795.701	United States Treasury Inflation Indexed Bonds*	2,13%	15/02/2040	1.187.579	1,24
90.000	United States Treasury Note/Bond*	3,00%	15/05/2045	106.165	0,11
615.000	United States Treasury Note/Bond*	3,63%	15/02/2044	795.104	0,83
17.000	Uruguay Government International Bond*	4,38%	23/01/2031	19.822	0,02
Total dólar estadounidense				9.490.848	9,87
Total bonos del Estado				23.374.528	24,30
Valores respaldados por hipotecas 7,40% (31 de diciembre de 2020: 12,98%)					
Dólar estadounidense					
840.000	Fannie Mae Pool	2,00%	01/07/2036	866.463	0,90
445.000	Fannie Mae Pool	2,00%	01/07/2050	449.346	0,47
3.180.000	Fannie Mae Pool	2,50%	01/07/2051	3.289.313	3,42
88.225	Fannie Mae Pool	3,00%	01/11/2045	93.040	0,10
74.512	Fannie Mae Pool	3,00%	01/08/2046	78.201	0,08
132.945	Fannie Mae Pool	3,00%	01/01/2050	138.680	0,14
173.230	Fannie Mae Pool	3,00%	01/03/2050	180.923	0,19
147.364	Fannie Mae Pool	3,00%	01/04/2050	153.912	0,16
260.000	Fannie Mae Pool	3,00%	01/07/2051	271.035	0,28
71.960	Fannie Mae Pool	3,50%	01/03/2047	76.259	0,08
106.679	Fannie Mae Pool	3,50%	01/09/2047	112.876	0,12
118.808	Fannie Mae Pool	3,50%	01/02/2048	125.536	0,13
128.849	Fannie Mae Pool (BH9277)	3,50%	01/02/2048	136.202	0,14
151.025	Fannie Mae Pool	4,00%	01/07/2048	161.058	0,17
51.734	Fannie Mae Pool	4,00%	01/10/2048	55.182	0,06
128.573	Fannie Mae Pool	4,00%	01/07/2049	137.059	0,14
31.754	Freddie Mac Pool	3,00%	01/03/2050	33.336	0,03
183.820	Freddie Mac Pool	3,00%	01/07/2050	191.671	0,20

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

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
Valores respaldados por hipotecas 7,40% (31 de diciembre de 2020: 12,98%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
545.000	Ginnie Mae	2,50%	01/07/2051	564.032	0,59
Total valores respaldados por hipotecas **				7.114.124	7,40
Número de Acciones	Descripción de los valores			Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Fondos de inversión 5.11% (31 de diciembre de 2020: 3,47%)					
Libra esterlina					
125.000	NB Global Monthly Income Fund Ltd			151.960	0,16
Total libra esterlina				151.960	0,16
Dólar estadounidense					
84.000	iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF			4.760.280	4,95
Total dólar estadounidense				4.760.280	4,95
Total fondos de inversión #				4.912.240	5,11
Total inversiones				91.854.910	95,50

Contratos de divisas a plazo 1,71% (31 de diciembre de 2020: 3,10%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
112.177 AUD	84.165 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	59	0,00
2.716.947 BRL	473.616 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	66.877	0,07
2.214.244 BRL	386.302 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	54.187	0,06
2.540.343 CAD	2.022.706 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	28.751	0,03
912.150 CAD	727.872 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	8.735	0,01
137.421 CAD	109.991 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	983	0,00
3.454.517 CNY	523.999 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	10.297	0,01
21.229.086 CZK	979.419 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	7.503	0,01
97.034 €	115.071 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	43	0,00
4.502 £	6.188 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	31	0,00
258.054 £	300.000 €	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	608	0,00
270.077 £	372.342 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	775	0,00
95.140 £	131.359 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	79	0,00
119.481.363 HUF	397.694 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	5.903	0,01
29.415.852 HUF	98.841 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	523	0,00
43.701.984 ¥	393.666 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	136	0,00
11.038.313 MXN	542.639 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	10.579	0,01
7.199.277 MXN	356.142 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	4	4.672	0,01

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 1,71% (31 de diciembre de 2020: 3,10%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
2.660.290 NOK	307.935 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	1.242	0,00
1.231.198 NOK	143.023 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	66	0,00
1.824.256 PLN	477.291 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	1.938	0,00
39.834.254 RUB	515.968 USD	19/07/2021	Citibank NA	2	28.041	0,03
99.935.774 RUB	1.305.408 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	59.394	0,06
9.383.530 RUB	124.789 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	3.360	0,00
479.656 USD	593.740 CAD	19/07/2021	BNP Paribas	1	181	0,00
571.919 USD	61.784.435 ¥	19/07/2021	BNP Paribas	2	15.174	0,02
853.494 USD	1.198.741 NZD	19/07/2021	BNP Paribas	2	15.889	0,02
974.965 USD	20.787.124 CZK	19/07/2021	BNP Paribas	3	8.589	0,01
161.640 USD	132.657 €	19/07/2021	BNP Paribas	1	4.266	0,00
865.292 USD	7.304.097 SEK	19/07/2021	BNP Paribas	2	11.085	0,01
649.106 USD	461.780 £	19/07/2021	BNP Paribas	3	11.149	0,01
137.848 USD	127.072 CHF	19/07/2021	BNP Paribas	1	312	0,00
460.323 USD	3.802.941 NOK	19/07/2021	BNP Paribas	1	18.349	0,02
2.201.279 USD	240.004.517 ¥	19/07/2021	Citibank NA	3	38.579	0,04
380.333 USD	493.664 AUD	19/07/2021	Citibank NA	2	9.684	0,01
2.615.809 USD	3.168.149 CAD	19/07/2021	Citibank NA	6	57.367	0,06
681.060 USD	5.690.487 SEK	19/07/2021	Citibank NA	2	15.563	0,02
1.084.398 USD	766.038 £	19/07/2021	Citibank NA	3	26.101	0,03
292.081 USD	324.977.420 KRW	19/07/2021	Citibank NA	2	4.499	0,00
3.824.568 USD	3.156.633 €	19/07/2021	Citibank NA	12	79.770	0,08
55.969 USD	72.214 AUD	19/07/2021	Deutsche Bank AG	1	1.750	0,00
261.110 USD	986.872 PLN	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	1.860	0,00
481.986 USD	660.272 NZD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	20.629	0,02
488.388 USD	4.109.189 SEK	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	7.822	0,01
1.491.295 USD	1.359.931 CHF	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	19.385	0,02
2.105.193 USD	2.735.351 AUD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	51.453	0,05
45.774.665 USD	38.248.104 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	10	399.912	0,42
1.971.322 USD	2.427.602 CAD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	10.909	0,01
1.038.005 USD	111.793.085 ¥	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	30.629	0,03
1.263.589 USD	10.548.442 NOK	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	37.659	0,04
366.840 USD	262.380 £	19/07/2021	Royal Bank of Canada	1	4.357	0,00
1.553.409 USD	2.185.858 NZD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	3	26.068	0,03
1.406.991 USD	11.729.412 SEK	19/07/2021	Standard Chartered Bank	3	35.248	0,04
1.148.302 USD	948.139 €	19/07/2021	Standard Chartered Bank	3	23.500	0,02
937.763 USD	850.905 CHF	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	16.794	0,02
63.422 USD	45.595 £	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	432	0,00

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 1,71% (31 de diciembre de 2020: 3,10%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
1.632.610 USD	179.429.936 ¥	19/07/2021	Standard Chartered Bank	2	15.753	0,02
330.760 USD	427.034 AUD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	10.137	0,01
412.383 USD	294.988 £	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	4	4.851	0,01
249.566 USD	2.071.845 NOK	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	8.778	0,01
277.576 USD	2.346.621 SEK	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	3.141	0,00
486.953 USD	597.897 CAD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	4.120	0,00
3.963 USD	33.551 TRY	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	136	0,00
1.930.342 USD	1.604.522 €	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	8	26.854	0,03
574.753 USD	62.865.586 ¥	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	8.266	0,01
8.527.319 USD	7.835.540 CHF	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	46.590	0,05
495.042 USD	688.413 NZD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	14.023	0,01
604 USD	5.143 SEK	19/07/2021	UBS AG	1	3	0,00
709.935 USD	1.008.591 NZD	19/07/2021	UBS AG	2	5.195	0,01
67.892 USD	47.892 £	19/07/2021	UBS AG	1	1.728	0,00
403.923 USD	528.940 AUD	19/07/2021	UBS AG	1	6.787	0,01
70.871 USD	262.196 PLN	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	1.993	0,00
65.767 USD	1.371.751 CZK	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	1.995	0,00
353.485 USD	289.362 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	10.207	0,01
576.672 ZAR	39.256 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	1.043	0,00
569.437 ZAR	38.699 USD	19/07/2021	UBS AG	1	1.095	0,00
Clases EUR con cobertura						
35.728 USD	29.265 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	1.010	0,00
5.649.904 USD	4.618.584 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	170.754	0,18
Clases GBP con cobertura						
8.091 £	11.137 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	40	0,00
8.235 £	11.336 USD	19/07/2021	UBS AG	2	41	0,00
7.970 £	10.967 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	44	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ^{oo}					1.644.330	1,71

Contratos de futuros 0,12% (31 de diciembre de 2020: 0,27%)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
117	10-Year Mini Japanese Government Bond Future September 2021	36.643	0,04
(96)	Australian Government Bond 3-Year Future September 2021	27.809	0,03
13	Canadian 10-Year Bond Future September 2021	17.847	0,02
(3)	Canadian 5-Year Bond Future September 2021	460	0,00
2	Euro-OAT Future September 2021	1.423	0,00

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de futuros 0,12% (31 de diciembre de 2020: 0,27%) (cont.)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
13	United Kingdom Long Gilt Future September 2021	14.726	0,02
33	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2021	14.199	0,01
(8)	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2021	3.001	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de futuros *		116.108	0,12

Contratos de swap de rentabilidad total 0,02% (31 de diciembre de 2020: 0,02%)

Importe nominal	Fecha de extinción	Tipo variable	Entidad de referencia	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto	
CNY	26.985.000	24/12/2021	0,73 ¹	China Development Bank ²	7.655	0,01
Plusvalía latente total sobre contratos de swap de rentabilidad total ∞				7.655	0,01	

¹ El LIBOR a 3 meses es la referencia para este contrato de swap de rentabilidad total.

² La contraparte en este contrato de swap de rentabilidad total es Citibank NA.

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	93.623.003	97,34

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (1,22%) (31 de diciembre de 2020: (5,03%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
1.102.385 AUD	853.761 USD	19/07/2021	BNP Paribas	2	(26.075)	(0,03)
667.261 AUD	516.856 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(15.868)	(0,02)
2.972.081 AUD	2.292.434 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	4	(60.955)	(0,06)
1.207.058 AUD	934.253 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(27.976)	(0,03)
113.307 AUD	86.526 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(1.454)	(0,00)
200.000 CAD	164.487 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(2.977)	(0,00)
410.308 CHF	448.708 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(4.615)	(0,01)
632.451 CHF	706.220 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(21.693)	(0,02)
84.308 CHF	93.957 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(2.707)	(0,00)
1.103.037 CHF	1.198.537 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	2	(4.675)	(0,01)
538.084 CHF	591.146 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(8.755)	(0,01)
1.600.344 CZK	74.692 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(293)	(0,00)
1.331.044 €	1.601.577 USD	19/07/2021	BNP Paribas	4	(22.525)	(0,02)
3.077.999 €	3.724.374 USD	19/07/2021	Citibank NA	11	(72.861)	(0,08)
253.797 €	309.742 USD	19/07/2021	Deutsche Bank AG	2	(8.655)	(0,01)

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (1,22%) (31 de diciembre de 2020: (5,03%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
1.119.173 €	1.356.894 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	6	(29.189)	(0,03)
88.120 €	108.030 USD	19/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(3.491)	(0,00)
2.280.946 €	2.768.541 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	6	(62.593)	(0,07)
2.208.191 €	2.657.131 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	10	(37.495)	(0,04)
573.595 €	700.422 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	(19.951)	(0,02)
471.153 £	657.621 USD	19/07/2021	BNP Paribas	3	(6.714)	(0,01)
690.933 £	967.364 USD	19/07/2021	Citibank NA	3	(12.827)	(0,01)
342.124 £	474.908 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(2.257)	(0,00)
42.654 £	58.965 USD	19/07/2021	Royal Bank of Canada	1	(38)	(0,00)
1.467.165 £	2.039.759 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	4	(12.843)	(0,01)
214.943 £	300.480 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	3	(3.533)	(0,00)
350.000 £	495.595 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(12.063)	(0,01)
264.842.273 ¥	2.428.263 USD	19/07/2021	Citibank NA	3	(41.749)	(0,04)
143.329.157 ¥	1.324.058 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(32.508)	(0,04)
1.016.019.833 ¥	9.324.902 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	4	(169.469)	(0,18)
11.251.200 ¥	102.400 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(1.014)	(0,00)
324.791.356 KRW	289.682 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(2.264)	(0,00)
3.580.595 NOK	420.551 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(4.418)	(0,01)
9.819.130 NOK	1.185.347 USD	19/07/2021	Citibank NA	3	(44.176)	(0,05)
1.462.057 NOK	175.239 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(5.320)	(0,01)
25.862.561 NOK	3.066.145 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(60.421)	(0,06)
1.837.792 NZD	1.321.856 USD	19/07/2021	Citibank NA	2	(37.722)	(0,04)
655.234 NZD	467.665 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(9.829)	(0,01)
326.464 NZD	234.478 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(6.365)	(0,01)
853.758 PLN	228.404 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(4.123)	(0,01)
4.142.378 SEK	495.879 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(11.432)	(0,01)
3.920.449 SEK	471.374 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(12.881)	(0,01)
12.377.018 SEK	1.464.214 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	(16.733)	(0,02)
569.544 SEK	66.887 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(280)	(0,00)
484.612 USD	6.940.442 ZAR	19/07/2021	BNP Paribas	1	(403)	(0,00)
242.685 USD	1.318.340 BRL	19/07/2021	BNP Paribas	1	(19.577)	(0,02)
1.505.656 USD	1.887.942 CAD	19/07/2021	Citibank NA	2	(18.954)	(0,02)
452.081 USD	9.031.441 MXN	19/07/2021	Citibank NA	1	(558)	(0,00)
215.906 USD	4.645.200 CZK	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(46)	(0,00)
7.870.664 USD	5.725.985 £	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(39.892)	(0,04)
165.805 USD	205.727 CAD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(330)	(0,00)
599.410 USD	44.682.439 RUB	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(10.809)	(0,01)
476.438 USD	4.081.524 SEK	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(893)	(0,00)

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (1,22%) (31 de diciembre de 2020: (5,03%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
65.810 USD	348.530 BRL	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(3.524)	(0,00)
845.348 USD	613.617 £	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(2.376)	(0,00)
92.059 USD	598.660 CNY	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(533)	(0,00)
76.401 USD	5.680.378 RUB	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(1.175)	(0,00)
48.140 USD	708.353 ZAR	19/07/2021	UBS AG	1	(1.362)	(0,00)
163.619 USD	202.944 CAD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(268)	(0,00)
455.502 USD	421.390 CHF	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(586)	(0,00)
84.089 USD	120.418 NZD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(52)	(0,00)
3.841.320 ZAR	278.111 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(9.670)	(0,01)
Clases EUR con cobertura						
3.110.360 €	3.729.707 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(39.804)	(0,04)
3.077.891 €	3.688.499 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(37.114)	(0,04)
3.101.063 €	3.715.694 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	(36.820)	(0,04)
Clases GBP con cobertura						
128 £	181 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(4)	(0,00)
152 £	215 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(5)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(1.170.537)	(1,22)

Contratos de futuros (0,53%) (31 de diciembre de 2020: (0,15%))

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
41	Australian Government Bond 10-Year Future September 2021	(724)	(0,00)
(7)	Euro-BOBL Future September 2021	(747)	(0,00)
(35)	Euro-Bund Future September 2021	(38.601)	(0,04)
3	Euro-Bund Put Option on Future July 2021, Strike Price EUR 169	(185)	(0,00)
4	Euro-Bund Put Option on Future July 2021, Strike Price EUR 171	(634)	(0,00)
(2)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2021	(7.685)	(0,01)
67	Euro-Schatz Future September 2021	(1.589)	(0,00)
(39)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2021	(19.204)	(0,02)
(63)	US Treasury 10-Year Ultra Future September 2021	(150.609)	(0,16)
220	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future September 2021	(79.830)	(0,09)
(30)	US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2021	(108.946)	(0,11)
(12)	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2021	(99.824)	(0,10)
Minusvalía latente total sobre contratos de futuros [±]		(508.578)	(0,53)

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de credit default swap (1,38%) (31 de diciembre de 2020: (0,00%))

Importe nocional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Obligación referenciada	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto	
EUR	8.777.431	20/12/2025	ICE Clear U.S. ¹	Buying default protection on iTraxx Europe Crossover	(1.327.532)	(1,38)
Total valor razonable en contratos de credit default swap [∞]				(1.327.532)	(1,38)	

¹Swap liquidada centralmente.

Contratos de swaps de tipos de interés (0,02%) (31 de diciembre de 2020: (0,03%))

Importe nocional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar) [#]	Tipo fijo	Tipo variable	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto	
USD	250.000	07/12/2027	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	2,43%	3M LIBOR	(20.149)	(0,02)
Minusvalía latente total sobre contratos de swap de tipos de interés [∞]						(20.149)	(0,02)	

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

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

¹Swap liquidada centralmente.

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(3.026.796)	(3,15)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	90.596.207	94,20
Otro activo neto	5.582.742	5,80
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	96.178.949	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	48.523.430	45,85
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	37.997.852	35,90
† Otros valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario	421.388	0,40
μ Fondos de inversión	4.912.240	4,64
± Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	(392.470)	(0,37)
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(866.233)	(0,82)
Total inversiones	90.596.207	85,60

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
16.040.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/02/2051	16.880.303
16.040.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/03/2050	16.878.042
16.040.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/04/2050	16.620.816
15.620.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/06/2050	16.201.522
15.620.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/05/2050	16.041.486
13.840.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/07/2051	14.289.552
13.300.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 02/12/2021	13.299.309
8.240.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/02/2051	8.525.793
140.000	iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	8.315.118
7.380.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/03/2051	7.609.172
7.120.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/03/2051	7.471.773
7.380.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/04/2051	7.449.956
7.020.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/02/2051	7.408.891
7.120.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/04/2051	7.352.910
6.920.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/05/2051	6.930.425
6.360.000	Ginnie Mae II Pool, 2.50%, 01/06/2051	6.601.090
6.360.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/05/2051	6.573.933
6.280.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/04/2036	6.469.399
5.480.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/03/2036	5.718.533
5.480.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/02/2036	5.707.753
4.660.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/06/2051	4.699.416
4.300.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/05/2051	4.419.852
3.660.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/06/2036	3.768.863
3.360.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/07/2036	3.468.349
3.320.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/07/2050	3.345.681
3.160.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/07/2051	3.267.137

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

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
16.040.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/01/2051	16.909.603
16.040.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/02/2051	16.905.998
16.040.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/03/2050	16.654.650
16.040.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/04/2050	16.505.783
15.620.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/05/2050	16.240.359
15.620.000	Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/06/2050	16.164.167
13.300.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 20/05/2021	13.300.001
8.240.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/01/2051	8.537.427
8.240.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/02/2051	8.506.868
7.380.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/03/2051	7.465.523
7.020.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/01/2052	7.423.024
7.380.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/04/2051	7.401.863
7.020.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/02/2051	7.380.884
7.120.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/04/2051	7.370.083
7.120.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/03/2051	7.368.763
6.920.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/05/2051	6.977.252
6.360.000	Ginnie Mae, 2.50%, 01/05/2051	6.613.760
6.360.000	Ginnie Mae II Pool, 2.50%, 01/06/2051	6.588.807
6.280.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/04/2036	6.462.947
5.480.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/02/2036	5.724.955
5.480.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/01/2036	5.712.891
5.480.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/03/2036	5.655.380
4.660.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/06/2051	4.707.720
4.300.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/05/2051	4.432.823
2.926.056	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 2.13%, 15/02/2040	4.222.301
3.660.000	Fannie Mae Pool, 2.00%, 01/06/2036	3.783.949

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 4,82%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

A pesar de los brotes de volatilidad ocasionales, los activos de riesgo han generado una sólida rentabilidad en los últimos 6 meses, impulsada por el fuerte descenso de los casos de COVID-19 en todo el mundo, la aceleración de las vacunaciones y el ingente respaldo de la política monetaria y fiscal. Los datos económicos se han recuperado ante la fuerte mejoría de la confianza de los consumidores y la actividad, en un contexto en que las economías se dirigen lentamente hacia la reapertura total. Tanto la inflación como las expectativas de inflación han cobrado impulso en todo el mundo, lo cual ha obligado a los bancos centrales a adoptar una postura ligeramente más restrictiva (hawkish), además de empezar a negociar el calendario de la retirada gradual de estímulos (tapering). En el primer trimestre de 2021 asistimos a un repunte significativo de los tipos de interés al decantarse los inversores por activos de mayor riesgo en vista de las mejores perspectivas de crecimiento mundial, mientras que en el segundo trimestre vimos cómo se consolidaba esta tendencia después de que el posicionamiento se volviera desigual. En el terreno fiscal, asistimos a la aprobación del Plan de Rescate Americano en Estados Unidos y al acuerdo sobre una nueva ley de infraestructuras tras la clara victoria de los demócratas a comienzos del año, donde Joe Biden se proclamó presidente y el Senado pasó a tener una mayoría demócrata.

Las asignaciones de la Cartera a renta variable impulsaron las ganancias, aunque las estrategias de renta fija y no correlacionadas también contribuyeron a la rentabilidad. En el ámbito de renta variable, todas las estrategias contribuyeron a los resultados, siendo los valores de infraestructuras de energía y las acciones estadounidenses con altos dividendos los que más influyeron en el rendimiento ante el buen comportamiento de las acciones cíclicas de valor. En el ámbito de renta fija, el crédito de alta rentabilidad europeo y los valores preferentes fueron los que más contribuyeron a la rentabilidad, aminorando las pérdidas procedentes de segmentos más sensibles a los tipos, como el crédito con grado de inversión y los valores del Tesoro a largo plazo. Por otro lado, la decisión de acortar la duración de la Cartera adoptada a principios del año benefició a la rentabilidad en el primer trimestre. El comportamiento de las estrategias no correlacionadas vino inducido por las aportaciones derivadas de la suscripción de opciones al reducirse la volatilidad durante el periodo.

En un horizonte a 12 meses, seguimos creyendo que persistirán los factores favorables a la reapertura económica, lo cual creemos que favorecerá al crecimiento. Sin embargo, prevemos que la volatilidad se mantendrá alta a medida que la Reserva Federal se acerque a las fechas de la retirada gradual de estímulos más avanzado el año y el mercado se enfrente a nuevas tensiones derivadas de los mensajes que emita el banco central, así como de la variante Delta de la COVID-19. Aunque sigue habiendo mucha incertidumbre, parece que se están desvaneciendo muchas de las fuerzas al inicio del ciclo que indujeron fluctuaciones de precios a principios de este año, dando paso a una reactivación de la negociación bilateral. Creemos que esta volatilidad brindará oportunidades más atractivas que facilitarán nuestras preferencias por las exposiciones al valor, cíclicas y otras relacionadas con la recuperación. Seguimos siendo constructivos sobre la renta variable, especialmente en mercados desarrollados (excepto EE. UU) y mercados emergentes, al darnos cierta tranquilidad el reciente repliegue de las valoraciones. En el ámbito de renta fija, nos decantamos por el crédito de alta rentabilidad y la deuda de mercados emergentes frente a los bonos con grado de inversión, ante la tendencia bajista de los rendimientos tras la reunión del Comité del Mercado Abierto de la Reserva Federal estadounidense (FOMC) y el estrechamiento de los diferenciales, que hacen menos convincentes los bonos de alta calidad.

Por último, seguimos pensando que resulta prudente aplicar un enfoque multidimensional por lo que respecta al rendimiento. Durante el primer semestre de 2021, ampliamos nuestras fuentes de ingresos al incorporar a la cartera renta variable de mercados emergentes con altos dividendos, lo que contribuyó a la rentabilidad. Seguimos buscando fuentes de ingresos específicas que ofrezcan una recompensa atractiva en términos de riesgo/rentabilidad. Nuestro enfoque multiactivo evita la concentración del riesgo de la cartera en el riesgo de renta variable, de duración o del diferencial, y trata de diversificar entre clases de activos para conseguir un elevado nivel de rentas sostenible en un marco de gestión del riesgo.

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		17.348.090	17.489.291
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	1.517.919	729.565
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		215.383	2.149
Cuentas a percibir por acciones emitidas		16.500	2.435
Cuentas por cobrar de intermediarios		547.214	556.261
Ingresos a percibir y otros activos		178.776	201.874
Activos totales		19.823.882	18.981.575
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		150.133	635.100
Descubierto bancario	3	71	61
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		45.666	53.650
Gastos devengados		52.322	51.939
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		191.159	13.116
Otras cuentas por pagar		43.082	22.652
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		482.433	776.518
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		19.341.449	18.205.057

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		185.529	1.044.999
Ingresos por dividendos		137.980	651.962
Ingresos varios		51.253	–
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		547.622	(7.454.721)
		922.384	(5.757.760)
Gastos			
Comisión de gestión	5	95.590	544.878
Comisión de distribución	5	28.813	278.330
Comisión de administración	5	66.702	98.001
Comisión de compromiso	16	1.473	5.396
Comisión de depósito	5	5.974	6.987
Comisión del Depositario	5	445	4.447
Honorarios profesionales	7	26.576	19.561
Honorarios de los Consejeros	6	2.413	2.375
Costes de transacciones	7	71.610	90.551
Honorarios de auditoría	7	9.317	8.264
Reembolso de IVA		(84)	(375)
Otros gastos	7	4.126	6.367
Gastos no asumidos	5	(164.022)	(107.968)
Gastos totales		148.933	956.814
Costes financieros			
Gastos por intereses		93	813
Repartos de dividendos abonados	1	8.642	55.720
		8.735	56.533
Impuestos retenidos en origen		39.618	119.153
Impuesto sobre las plusvalías		47	–
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		725.051	(6.890.260)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	18.205.057	99.120.825
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	725.051	(6.890.260)
Suscripciones	2.733.605	23.832.272
Reembolsos	(2.322.264)	(92.314.981)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	19.341.449	23.747.856

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

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 30,89% (31 de diciembre de 2020: 19,29%)			
Dólar australiano			
313	AGL Energy Ltd*	1.927	0,01
412	APA Group*	2.753	0,02
946	Aurizon Holdings Ltd*	2.642	0,01
539	BHP Group Ltd*	19.654	0,10
1.143	Brambles Ltd*	9.817	0,05
484	Coles Group Ltd*	6.210	0,03
215	Commonwealth Bank of Australia*	16.120	0,08
319	Computershare Ltd*	4.047	0,02
613	Fortescue Metals Group Ltd*	10.741	0,06
1.652	Medibank Pvt Ltd*	3.919	0,02
548	National Australia Bank Ltd*	10.787	0,06
889	Origin Energy Ltd*	3.010	0,02
199	Sonic Healthcare Ltd*	5.737	0,03
275	Wesfarmers Ltd*	12.202	0,06
189	Westpac Banking Corp*	3.662	0,02
	Total dólar australiano	113.228	0,59
Real brasileño			
2.006	CPFL Energia SA*	10.758	0,06
3.373	JBS SA*	19.561	0,10
6.350	TIM SA*	14.591	0,07
	Total real brasileño	44.910	0,23
Dólar canadiense			
155	Enbridge Inc*	6.212	0,03
	Total dólar canadiense	6.212	0,03
Corona danesa			
5	AP Moller - Maersk A/S Class B*	14.373	0,08
285	Novo Nordisk A/S Class B*	23.879	0,12
	Total corona danesa	38.252	0,20
Euro			
70	Akzo Nobel NV*	8.650	0,05
88	Allianz SE*	21.947	0,11
30	Arkema SA*	3.764	0,02
452	Aroundtown SA*	3.527	0,02
794	Assicurazioni Generali SpA*	15.918	0,08

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

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 30,89% (31 de diciembre de 2020: 19,29%) (cont.)			
Euro (cont.)			
597	AXA SA*	15.140	0,08
182	Bayerische Motoren Werke AG*	19.276	0,10
43	Brenntag SE*	3.999	0,02
277	Cie de Saint-Gobain*	18.245	0,09
52	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA*	8.294	0,04
133	Covestro AG*	8.590	0,05
92	Danone SA*	6.477	0,03
397	Deutsche Post AG*	27.005	0,14
563	Deutsche Telekom AG*	11.892	0,06
198	Enagas SA*	4.575	0,02
244	Endesa SA*	5.920	0,03
1.331	Enel SpA*	12.362	0,06
860	Iberdrola SA*	10.484	0,05
675	Koninklijke Ahold Delhaize NV*	20.068	0,10
1.842	Koninklijke KPN NV*	5.754	0,03
19	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen*	5.204	0,03
266	Naturgy Energy Group SA*	6.839	0,04
228	NN Group NV*	10.756	0,06
75	OMV AG*	4.267	0,02
1.018	Orange SA*	11.608	0,06
72	Orion OYJ Class B*	3.095	0,02
116	Proximus SADP*	2.241	0,01
59	Publicis Groupe SA*	3.774	0,02
91	Randstad NV*	6.961	0,04
291	Red Electrica Corp SA*	5.403	0,03
844	Repsol SA*	10.563	0,06
163	Sanofi*	17.080	0,09
126	Siemens AG*	19.966	0,10
1.093	Snam SpA*	6.319	0,03
118	Societe Generale SA*	3.479	0,02
56	Solvay SA*	7.119	0,04
1.374	Telefonica SA*	6.422	0,03
742	TotalEnergies SE*	33.574	0,17
121	Wolters Kluwer NV*	12.157	0,06
	Total euro	408.714	2,11

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

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 30,89% (31 de diciembre de 2020: 19,29%) (cont.)			
Dólar de Hong Kong			
12.000	Agile Group Holdings Ltd*	15.545	0,08
54.000	Agricultural Bank of China Ltd - H Shares*	18.775	0,10
1.500	Anhui Conch Cement Co Ltd - H Shares*	7.958	0,04
61.000	Bank of China Ltd - H Shares*	21.915	0,11
40.000	Bank of Communications Co Ltd - H Shares*	26.887	0,14
3.397	BOC Hong Kong Holdings Ltd*	11.526	0,06
71.000	China CITIC Bank Corp Ltd - H Shares*	33.645	0,17
40.000	China Construction Bank Corp - H Shares*	31.471	0,16
26.000	China Everbright Bank Co Ltd - H Shares*	10.613	0,05
14.500	China Hongqiao Group Ltd*	19.642	0,10
12.000	China Merchants Port Holdings Co Ltd*	17.523	0,09
22.000	China National Building Material Co Ltd - H Shares*	25.836	0,13
4.000	China Overseas Land & Investment Ltd*	9.086	0,05
28.000	China Petroleum & Chemical Corp - H Shares*	14.170	0,07
4.100	China Vanke Co Ltd - H Shares*	12.829	0,07
15.000	CITIC Ltd*	16.167	0,08
971	CK Asset Holdings Ltd*	6.702	0,03
683	CK Hutchison Holdings Ltd*	5.321	0,03
684	CLP Holdings Ltd*	6.764	0,04
12.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd*	17.368	0,09
2.000	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd - H Shares*	14.087	0,07
4.000	Geely Automobile Holdings Ltd*	12.594	0,07
4.400	Haier Smart Home Co Ltd - H Shares*	15.354	0,08
1.500	Hengan International Group Co Ltd*	10.044	0,05
52.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd - H Shares*	30.534	0,16
2.500	Kingboard Holdings Ltd*	13.875	0,07
600	Meituan Class B*	24.755	0,13
500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H Shares*	4.896	0,03
24.000	Seazen Group Ltd*	22.746	0,12
12.000	Sino Biopharmaceutical Ltd*	11.775	0,06
1.000	Sun Hung Kai Properties Ltd*	14.899	0,08
1.100	Tencent Holdings Ltd*	82.721	0,43
8.000	Uni-President China Holdings Ltd*	8.828	0,05
1.500	Zhongsheng Group Holdings Ltd*	12.478	0,06
Total dólar de Hong Kong		609.329	3,15

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

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 30,89% (31 de diciembre de 2020: 19,29%) (cont.)			
Yen japonés			
756	Astellas Pharma Inc*	13.177	0,07
273	Canon Inc*	6.181	0,03
33	Daito Trust Construction Co Ltd*	3.612	0,02
1.000	Daiwa Securities Group Inc*	5.497	0,03
2.350	ENEOS Holdings Inc*	9.843	0,05
200	Honda Motor Co Ltd*	6.397	0,03
821	Japan Tobacco Inc*	15.523	0,08
246	Kajima Corp*	3.119	0,02
274	KDDI Corp*	8.554	0,04
137	Kirin Holdings Co Ltd*	2.674	0,01
100	MEIJI Holdings Co Ltd*	5.992	0,03
1.764	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc*	9.538	0,05
600	Mitsui & Co Ltd*	13.517	0,07
137	Mitsui Chemicals Inc*	4.734	0,02
1.341	Mizuho Financial Group Inc*	19.180	0,10
154	MS&AD Insurance Group Holdings Inc*	4.451	0,02
275	Nippon Telegraph & Telephone Corp*	7.172	0,04
137	Nitto Denko Corp*	10.233	0,05
2.459	Nomura Holdings Inc*	12.580	0,07
885	ORIX Corp*	14.947	0,08
1.779	Resona Holdings Inc*	6.847	0,04
445	Sekisui House Ltd*	9.135	0,05
138	Shionogi & Co Ltd*	7.200	0,04
413	SoftBank Corp*	5.409	0,03
275	Sompo Holdings Inc*	10.173	0,05
573	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc*	19.773	0,10
65	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc*	2.066	0,01
274	T&D Holdings Inc*	3.545	0,02
137	Taisei Corp*	4.493	0,02
574	Takeda Pharmaceutical Co Ltd*	19.233	0,10
274	Tosoh Corp*	4.730	0,02
175	Toyota Motor Corp*	15.310	0,08
138	Trend Micro Inc*	7.236	0,04
	Total yen japonés	292.071	1,51
Nuevo dólar taiwanés			
4.034	Asia Cement Corp*	7.340	0,04
723	Asustek Computer Inc*	9.640	0,05

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

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 30,89% (31 de diciembre de 2020: 19,29%) (cont.)			
Nuevo dólar taiwanés (cont.)			
9.532	Cathay Financial Holding Co Ltd*	18.440	0,10
22.729	China Development Financial Holding Corp*	10.727	0,06
15.062	CTBC Financial Holding Co Ltd*	12.271	0,06
5.613	Far Eastern New Century Corp*	6.447	0,03
5.346	Fubon Financial Holding Co Ltd*	14.179	0,07
12.038	Lite-On Technology Corp*	24.886	0,13
795	MediaTek Inc*	27.449	0,14
18.486	Mega Financial Holding Co Ltd*	21.795	0,11
3.008	Micro-Star International Co Ltd*	17.003	0,09
711	Novatek Microelectronics Corp*	12.734	0,07
3.250	Quanta Computer Inc*	10.206	0,05
7.939	Taiwan Cement Corp*	14.532	0,08
8.625	United Microelectronics Corp*	16.437	0,08
11.454	Yuanta Financial Holding Co Ltd*	11.038	0,06
	Total nuevo dólar taiwanés	235.124	1,22
Corona noruega			
171	DNB ASA*	3.728	0,02
361	Telenor ASA*	6.087	0,03
90	Yara International ASA*	4.740	0,02
	Total corona noruega	14.555	0,07
Libra esterlina			
90	Admiral Group Plc*	3.909	0,02
248	Anglo American Plc*	9.841	0,05
154	AstraZeneca Plc*	18.473	0,09
653	British American Tobacco Plc*	25.258	0,13
172	Bunzl Plc*	5.676	0,03
45	DCC Plc*	3.679	0,02
82	Diageo Plc*	3.921	0,02
774	Direct Line Insurance Group Plc*	3.047	0,02
1.436	GlaxoSmithKline Plc*	28.158	0,15
571	HSBC Holdings Plc*	3.292	0,02
782	Imperial Brands Plc*	16.820	0,09
1.006	J Sainsbury Plc*	3.777	0,02
719	Kingfisher Plc*	3.620	0,02
2.172	Legal & General Group Plc*	7.729	0,04
1.358	M&G Plc*	4.294	0,02

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

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 30,89% (31 de diciembre de 2020: 19,29%) (cont.)			
Libra esterlina (cont.)			
282	Mondi Plc*	7.406	0,04
809	National Grid Plc*	10.291	0,05
263	Persimmon Plc*	10.747	0,06
365	Phoenix Group Holdings Plc*	3.411	0,02
75	Reckitt Benckiser Group Plc*	6.628	0,03
429	Rio Tinto Plc*	35.256	0,18
622	Royal Dutch Shell Plc Class A*	12.432	0,06
766	Sage Group Plc*	7.240	0,04
586	SSE Plc*	12.147	0,06
1.778	Standard Life Aberdeen Plc*	6.656	0,03
463	Unilever Plc*	27.059	0,14
1.805	Vodafone Group Plc*	3.026	0,02
Total libra esterlina		283.793	1,47
Dólar de Singapur			
416	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd*	3.698	0,02
1.200	Singapore Technologies Engineering Ltd*	3.455	0,02
137	Venture Corp Ltd*	1.958	0,01
1.000	Wilmar International Ltd*	3.348	0,01
Total dólar de Singapur		12.459	0,06
Won de Corea del Sur			
45	LG Chem Ltd*	33.965	0,18
951	LG Uplus Corp*	12.963	0,07
1.464	Samsung Electronics Co Ltd*	104.910	0,54
184	Samsung Electronics Co Ltd - Preferred Shares*	12.042	0,06
48	Samsung SDI Co Ltd*	29.751	0,15
365	Shinhan Financial Group Co Ltd*	13.159	0,07
50	SK Telecom Co Ltd*	14.208	0,07
Total won de Corea del Sur		220.998	1,14
Corona sueca			
136	Lundin Energy AB*	4.815	0,03
237	Securitas AB Class B*	3.744	0,02
1.118	Skandinaviska Enskilda Banken AB Class A*	14.452	0,07
264	Skanska AB Class B*	7.007	0,04
441	Telia Co AB*	1.959	0,01
Total corona sueca		31.977	0,17

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

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 30,89% (31 de diciembre de 2020: 19,29%) (cont.)			
Franco suizo			
381	ABB Ltd*	12.938	0,07
105	Adecco Group AG*	7.141	0,04
1	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG*	9.958	0,05
12	Geberit AG*	9.010	0,05
237	Holcim Ltd*	14.230	0,07
359	Nestle SA*	44.749	0,23
373	Novartis AG*	34.025	0,17
123	Roche Holding AG*	46.380	0,24
15	Swiss Life Holding AG*	7.296	0,04
20	Swisscom AG*	11.429	0,06
16	Zurich Insurance Group AG*	6.425	0,03
Total franco suizo		203.581	1,05
Dólar estadounidense			
92	3M Co*	18.274	0,09
42	Abbott Laboratories*	4.869	0,03
259	AbbVie Inc*	29.174	0,15
38	Accenture Plc Class A*	11.202	0,06
240	Aflac Inc*	12.878	0,07
452	Alibaba Group Holding Ltd ADR*	102.505	0,53
125	Allstate Corp*	16.305	0,08
399	Altria Group Inc*	19.024	0,10
658	Amcort Plc*	7.541	0,04
673	American Electric Power Co Inc*	56.929	0,29
51	Amgen Inc*	12.431	0,06
150	Antero Midstream Corp*	1.558	0,01
17	Anthem Inc*	6.491	0,03
582	AT&T Inc*	16.750	0,09
2.200	Atlantica Sustainable Infrastructure Plc*	81.884	0,42
429	Bank of America Corp*	17.688	0,09
8	BlackRock Inc Class A*	7.000	0,04
37	Booz Allen Hamilton Holding Corp Class A*	3.152	0,02
310	Bristol-Myers Squibb Co*	20.714	0,11
29	Broadcom Inc*	13.828	0,07
1.294	Brookfield Property Partners LP*	24.521	0,13
926	Brookfield Property REIT Inc*	23.363	0,12
272	Cedar Realty Trust Inc PRB*	6.865	0,04
361	Cedar Realty Trust Inc PRC*	9.083	0,05

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

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 30,89% (31 de diciembre de 2020: 19,29%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
42	Celanese Corp Class A*	6.367	0,03
2.200	CenterPoint Energy Inc*	53.944	0,28
2.200	Chatham Lodging Trust**	57.200	0,30
1.300	Cheniere Energy Inc*	112.762	0,58
46	Chevron Corp*	4.818	0,03
38	Cigna Corp*	9.009	0,05
447	Cisco Systems Inc*	23.691	0,12
336	Citigroup Inc*	23.772	0,12
144	Citizens Financial Group Inc*	6.605	0,03
2.800	Clearway Energy Inc Class C*	74.144	0,38
900	CMS Energy Corp*	53.172	0,28
139	Coca-Cola Co*	7.521	0,04
200	Coca-Cola Femsa SAB de CV ADR*	10.586	0,05
40	Cognizant Technology Solutions Corp Class A*	2.770	0,01
143	Colgate-Palmolive Co*	11.633	0,06
338	Comcast Corp Class A*	19.273	0,10
170	Conagra Brands Inc*	6.185	0,03
350	CTO Realty Growth Inc**	8.897	0,05
52	Cummins Inc*	12.678	0,07
144	CVS Health Corp*	12.015	0,06
45	Darden Restaurants Inc*	6.570	0,03
9	Deere & Co*	3.174	0,02
1.600	DigitalBridge Group Inc PRI*	41.040	0,21
1.730	DigitalBridge Group Inc PRJ*	45.343	0,23
1.291	Dominion Energy Inc*	94.979	0,49
3	Dover Corp*	452	0,00
34	Dow Inc*	2.152	0,01
100	Dr Reddy's Laboratories Ltd ADR*	7.351	0,04
44	DTE Energy Co*	5.702	0,03
50	Duke Energy Corp*	4.936	0,03
66	Eastman Chemical Co*	7.706	0,04
103	eBay Inc*	7.232	0,04
76	Edison International*	4.394	0,02
21	Eli Lilly & Co*	4.820	0,03
122	Emerson Electric Co*	11.741	0,06
27	Entergy Corp*	2.692	0,01
50	EOG Resources Inc*	4.172	0,02
15	Everest Re Group Ltd*	3.780	0,02

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

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 30,89% (31 de diciembre de 2020: 19,29%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
521	Exxon Mobil Corp*	32.865	0,17
500	Federal Realty Investment Trust*	13.210	0,07
55	Fidelity National Financial Inc*	2.390	0,01
187	First Horizon Corp*	3.231	0,02
200	Fomento Economico Mexicano SAB de CV ADR*	16.902	0,09
107	Franklin Resources Inc*	3.423	0,02
47	Garmin Ltd*	6.798	0,04
110	General Mills Inc*	6.702	0,03
25	Genuine Parts Co*	3.162	0,02
500	Global Net Lease Inc*	13.395	0,07
48	Goldman Sachs Group Inc*	18.217	0,09
18	Hanover Insurance Group Inc*	2.442	0,01
453	Hersha Hospitality Trust*	10.668	0,06
779	Hersha Hospitality Trust Series C*	19.366	0,10
51	Home Depot Inc*	16.263	0,08
54	Honeywell International Inc*	11.845	0,06
247	HP Inc*	7.457	0,04
224	Huntington Bancshares Inc*	3.196	0,02
400	Infosys Ltd ADR*	8.476	0,04
346	Intel Corp*	19.424	0,10
82	International Business Machines Corp*	12.020	0,06
138	International Paper Co*	8.461	0,04
126	Interpublic Group of Cos Inc*	4.094	0,02
100	Jardine Matheson Holdings Ltd*	6.392	0,03
28	JM Smucker Co*	3.628	0,02
265	Johnson & Johnson*	43.656	0,23
153	Johnson Controls International PLC*	10.500	0,05
272	JPMorgan Chase & Co*	42.307	0,22
174	KeyCorp*	3.593	0,02
93	Kimberly-Clark Corp*	12.442	0,06
1.437	Kimco Realty Corp*	37.261	0,19
753	Kinder Morgan Inc*	13.727	0,07
156	Kroger Co*	5.976	0,03
31	L3Harris Technologies Inc*	6.701	0,03
50	Lazard Ltd Class A*	2.263	0,01
52	Lockheed Martin Corp*	19.674	0,10
11	McDonald's Corp*	2.541	0,01
92	Medtronic PLC*	11.420	0,06

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

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 30,89% (31 de diciembre de 2020: 19,29%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
63	Merck & Co Inc*	4.900	0,03
213	MetLife Inc*	12.748	0,07
1.100	Monmouth Real Estate Investment Corp*	27.797	0,14
94	Morgan Stanley*	8.619	0,04
19	Motorola Solutions Inc*	4.120	0,02
46	NetApp Inc*	3.764	0,02
216	New York Community Bancorp Inc*	2.380	0,01
120	Newell Brands Inc*	3.296	0,02
225	Newmont Corp*	14.261	0,07
725	NextEra Energy Inc*	53.128	0,27
1.100	NextEra Energy Partners LP*	83.996	0,43
48	Norfolk Southern Corp*	12.740	0,07
74	Nucor Corp*	7.099	0,04
41	Omnicom Group Inc*	3.280	0,02
1.859	ONEOK Inc*	103.435	0,54
230	Oracle Corp*	17.903	0,09
24	Packaging Corp of America*	3.250	0,02
972	Pebblebrook Hotel Trust*	24.368	0,13
2.900	Pembina Pipeline Corp*	92.133	0,48
33	PepsiCo Inc*	4.890	0,03
1.038	Petroleo Brasileiro SA ADR*	12.695	0,07
496	Pfizer Inc*	19.423	0,10
233	Philip Morris International Inc*	23.093	0,12
42	Pinnacle West Capital Corp*	3.443	0,02
42	Popular Inc*	3.152	0,02
285	PPL Corp*	7.971	0,04
75	Principal Financial Group Inc*	4.739	0,02
297	Procter & Gamble Co*	40.074	0,21
162	Progressive Corp*	15.910	0,08
119	Public Service Enterprise Group Inc*	7.109	0,04
1.825	Public Storage PRE*	46.556	0,24
2.100	Public Storage PRH*	60.060	0,31
500	Public Storage PRN*	12.715	0,07
650	QTS Realty Trust Inc*	16.764	0,09
128	QUALCOMM Inc*	18.295	0,09
45	Quest Diagnostics Inc*	5.939	0,03
32	Reliance Steel & Aluminum Co*	4.829	0,03
151	Rexford Industrial Realty Inc*	3.802	0,02

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

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 30,89% (31 de diciembre de 2020: 19,29%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
699	Rexford Industrial Realty Inc Series B*	18.747	0,10
45	Robert Half International Inc*	4.004	0,02
763	Sempra Energy*	101.082	0,52
27	Snap-on Inc*	6.033	0,03
165	Southern Co*	9.984	0,05
174	Starbucks Corp*	19.455	0,10
300	Sunstone Hotel Investors Inc*	8.517	0,04
52	T Rowe Price Group Inc*	10.294	0,05
1.182	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR*	142.029	0,73
2.900	Targa Resources Corp*	128.905	0,67
27	Target Corp*	6.527	0,03
1.200	TC Energy Corp*	59.424	0,31
94	Texas Instruments Inc*	18.076	0,09
24	TFS Financial Corp*	487	0,00
275	TJX Cos Inc*	18.541	0,10
65	Travelers Cos Inc*	9.731	0,05
71	UGI Corp*	3.288	0,02
1.501	UMH Properties Inc*	39.536	0,20
108	Union Pacific Corp*	23.752	0,12
32	United Parcel Service Inc Class B*	6.655	0,03
70	UnitedHealth Group Inc*	28.031	0,15
39	US Bancorp*	2.222	0,01
832	Vale SA ADR*	18.978	0,10
434	Verizon Communications Inc*	24.317	0,13
78	VF Corp*	6.399	0,03
203	Vistra Corp*	3.766	0,02
1.100	Vornado Realty Trust*	28.622	0,15
82	Walmart Inc*	11.564	0,06
13	Watsco Inc*	3.726	0,02
14	Whirlpool Corp*	3.052	0,02
4.790	Williams Cos Inc*	127.175	0,66
15	WW Grainger Inc*	6.570	0,03
Total dólar estadounidense		3.459.560	17,89
Total valores de renta variable		5.974.763	30,89

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

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
Fondos de inversión inmobiliaria 6,06% (31 de diciembre de 2020: 3,10%)			
Dólar australiano			
520	Dexus	4.165	0,02
Total dólar australiano		4.165	0,02
Dólar de Singapur			
964	Ascendas Real Estate Investment Trust	2.116	0,01
1.924	Mapletree Logistics Trust	2.934	0,02
Total dólar de Singapur		5.050	0,03
Dólar estadounidense			
331	AGNC Investment Corp	5.591	0,03
660	American Campus Communities Inc	30.835	0,16
234	American Tower Corp	63.213	0,33
6.625	Annaly Capital Management Inc	58.830	0,30
2.336	Blackstone Mortgage Trust Inc Class A	74.495	0,38
185	CoreSite Realty Corp	24.901	0,13
387	Crown Castle International Corp	75.504	0,39
143	Digital Realty Trust Inc	21.516	0,11
593	Equity Residential	45.661	0,24
260	Four Corners Property Trust Inc	7.179	0,04
848	Healthpeak Properties Inc	28.230	0,15
1.009	Highwoods Properties Inc	45.576	0,23
122	Iron Mountain Inc	5.163	0,03
3.492	Medical Properties Trust Inc	70.189	0,36
113	Mid-America Apartment Communities Inc	19.031	0,10
1.136	Omega Healthcare Investors Inc	41.225	0,21
313	Prologis Inc	37.413	0,19
257	Public Storage	77.277	0,40
848	Regency Centers Corp	54.331	0,28
1.245	Simon Property Group Inc	162.448	0,84
677	Spirit Realty Capital Inc	32.388	0,17
1.404	STAG Industrial Inc	52.552	0,27
872	Starwood Property Trust Inc	22.820	0,12
78	Sun Communities Inc	13.369	0,07
1.493	VICI Properties Inc	46.313	0,24
556	Welltower Inc	46.204	0,24
Total dólar estadounidense		1.162.254	6,01
Total fondos de inversión inmobiliaria *		1.171.469	6,06

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

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 37,61% (31 de diciembre de 2020: 53,67%)					
Euro					
150.000	Altice Finco SA [*]	4,75%	15/01/2028	174.205	0,90
116.000	Atrium European Real Estate Ltd [*]	3,63%	29/12/2049	134.641	0,70
100.000	Bertelsmann SE & Co KGaA [*]	3,00%	23/04/2075	122.883	0,63
100.000	BP Capital Markets Plc [*]	3,63%	29/12/2049	128.943	0,67
100.000	Casino Guichard Perrachon SA [*]	4,50%	07/03/2024	120.522	0,62
150.000	CeramTec BondCo GmbH ^{**}	5,25%	15/12/2025	180.837	0,93
100.000	CMA CGM SA [*]	7,50%	15/01/2026	131.813	0,68
150.000	DKT Finance ApS ^{**}	7,00%	17/06/2023	180.907	0,93
100.000	eG Global Finance Plc [*]	4,38%	07/02/2025	117.271	0,61
125.000	House of Finance NV ^{**}	4,38%	15/07/2026	150.523	0,78
100.000	IPD 3 BV [*]	5,50%	01/12/2025	123.298	0,64
115.000	Motion Bondco DAC [*]	4,50%	15/11/2027	132.740	0,69
120.000	Paprec Holding SA [*]	4,00%	31/03/2025	145.154	0,75
120.000	Petroleos Mexicanos [*]	4,75%	26/02/2029	140.997	0,73
150.000	Platin 1426 GmbH ^{**}	5,38%	15/06/2023	179.511	0,93
100.000	Rolls-Royce Plc [*]	4,63%	16/02/2026	129.254	0,67
100.000	Sazka Group AS ^{**}	3,88%	15/02/2027	119.470	0,62
175.000	SGL Carbon SE [*]	4,63%	30/09/2024	212.461	1,10
145.125	Summer BidCo BV ^{**}	9,00%	15/11/2025	176.127	0,91
100.000	Summit Properties Ltd [*]	2,00%	31/01/2025	117.705	0,61
150.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV [*]	4,50%	01/03/2025	183.656	0,95
100.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE [*]	2,13%	29/12/2049	117.404	0,61
100.000	Veolia Environnement SA [*]	2,50%	29/12/2049	119.164	0,61
100.000	Verisure Midholding AB [*]	5,25%	15/02/2029	121.824	0,63
100.000	Virgin Media Finance Plc ^{**}	3,75%	15/07/2030	118.346	0,61
100.000	Vivion Investments Sarl [*]	3,50%	01/11/2025	120.036	0,62
100.000	Volkswagen International Finance NV [*]	3,88%	29/12/2049	131.606	0,68
100.000	Volkswagen International Finance NV [*]	4,63%	29/12/2049	137.106	0,71
100.000	ZF Europe Finance BV [*]	3,00%	23/10/2029	124.299	0,64
Total euro				4.092.703	21,16
Libra esterlina					
100.000	Electricite de France SA [*]	6,00%	29/12/2049	154.308	0,80
200.000	NGG Finance Plc [*]	5,63%	18/06/2073	308.039	1,59
Total libra esterlina				462.347	2,39

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

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 37,61% (31 de diciembre de 2020: 53,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense					
5.000	Abbott Laboratories*	4,75%	15/04/2043	6.648	0,03
10.000	AbbVie Inc*	4,30%	14/05/2036	11.895	0,06
5.000	AbbVie Inc*	4,70%	14/05/2045	6.236	0,03
5.000	Activision Blizzard Inc**	2,50%	15/09/2050	4.500	0,02
5.000	Air Lease Corp*	3,25%	01/10/2029	5.229	0,03
35.000	Ally Financial Inc**	4,70%	29/12/2049	36.337	0,19
5.000	Altria Group Inc*	3,40%	04/02/2041	4.777	0,02
5.000	Altria Group Inc*	4,25%	09/08/2042	5.242	0,03
5.000	Amazon.com Inc**	3,88%	22/08/2037	5.972	0,03
5.000	Ameren Illinois Co*	2,90%	15/06/2051	5.066	0,03
5.000	American International Group Inc*	4,50%	16/07/2044	6.078	0,03
5.000	American Water Capital Corp*	3,45%	01/05/2050	5.414	0,03
10.000	Amgen Inc**	3,15%	21/02/2040	10.438	0,05
5.000	Amgen Inc**	4,40%	01/05/2045	6.082	0,03
10.000	Anheuser-Busch Cos LLC/Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc*	4,90%	01/02/2046	12.680	0,07
5.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc*	4,44%	06/10/2048	6.002	0,03
10.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc*	4,95%	15/01/2042	12.689	0,07
5.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc*	5,80%	23/01/2059	7.234	0,04
10.000	Apple Inc**	2,65%	08/02/2051	9.797	0,05
5.000	Apple Inc**	4,50%	23/02/2036	6.319	0,03
5.000	ArcelorMittal SA*	7,00%	01/03/2041	6.953	0,04
5.000	AstraZeneca Plc**	2,13%	06/08/2050	4.383	0,02
3.000	AT&T Inc*	4,50%	09/03/2048	3.545	0,02
5.000	Athene Holding Ltd*	3,95%	25/05/2051	5.373	0,03
5.000	Atmos Energy Corp*	4,13%	15/03/2049	6.065	0,03
10.000	Baltimore Gas & Electric Co**	2,90%	15/06/2050	9.985	0,05
10.000	Bank of America Corp**	2,68%	19/06/2041	9.720	0,05
5.000	Bank of America Corp**	4,08%	20/03/2051	5.987	0,03
10.000	Bank of America Corp**	4,24%	24/04/2038	11.909	0,06
70.000	Bank of America Corp**	4,30%	29/12/2049	72.467	0,37
5.000	Barclays Plc*	3,56%	23/09/2035	5.215	0,03
5.000	BAT Capital Corp*	2,73%	25/03/2031	4.941	0,03
5.000	BAT Capital Corp*	4,54%	15/08/2047	5.327	0,03
5.000	BAT Capital Corp*	5,28%	02/04/2050	5.817	0,03
10.000	Becton Dickinson & Co*	1,96%	11/02/2031	9.765	0,05
5.000	Berkshire Hathaway Energy Co*	6,13%	01/04/2036	7.048	0,04
200.000	BNP Paribas SA*	4,50%	29/12/2049	203.375	1,05
5.000	Boeing Co*	3,75%	01/02/2050	5.167	0,03

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

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 37,61% (31 de diciembre de 2020: 53,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
10.000	Boeing Co*	5,81%	01/05/2050	13.488	0,07
10.000	BP Capital Markets Plc*	4,88%	29/12/2049	11.005	0,06
10.000	Bristol-Myers Squibb Co*	2,55%	13/11/2050	9.586	0,05
10.000	Broadcom Inc**	4,30%	15/11/2032	11.400	0,06
5.000	Broadcom Inc**	5,00%	15/04/2030	5.905	0,03
35.000	Capital One Financial Corp**	3,93%	29/12/2049	35.147	0,18
70.000	Capital One Financial Corp**	3,95%	29/12/2049	71.662	0,37
10.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	4,80%	01/03/2050	11.507	0,06
10.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	5,38%	01/04/2038	12.306	0,06
5.000	Chevron Corp*	2,98%	11/05/2040	5.252	0,03
10.000	Cigna Corp*	4,80%	15/08/2038	12.469	0,06
5.000	Citigroup Inc*	4,65%	30/07/2045	6.448	0,03
45.000	Citigroup Inc**	4,70%	29/12/2049	46.518	0,24
40.000	Citizens Financial Group Inc**	6,00%	29/12/2049	41.775	0,22
100.000	CMS Energy Corp**	3,75%	01/12/2050	101.855	0,53
5.000	Coca-Cola Co*	2,50%	15/03/2051	4.721	0,02
5.000	Comcast Corp**	2,65%	15/08/2062	4.579	0,02
5.000	Consolidated Edison Co of New York, Inc.*	3,00%	01/12/2060	4.634	0,02
5.000	Constellation Brands Inc*	4,50%	09/05/2047	6.045	0,03
200.000	Credit Suisse Group AG*	5,10%	29/12/2049	206.750	1,07
5.000	Crown Castle International Corp*	4,15%	01/07/2050	5.729	0,03
5.000	CVS Health Corp*	4,88%	20/07/2035	6.099	0,03
5.000	CVS Health Corp*	5,05%	25/03/2048	6.506	0,03
10.000	DH Europe Finance II Sarl*	3,25%	15/11/2039	10.730	0,06
5.000	Diamondback Energy Inc**	4,40%	24/03/2051	5.645	0,03
35.000	Discover Financial Services**	5,50%	29/12/2049	37.624	0,19
5.000	Discovery Communications LLC**	4,65%	15/05/2050	5.860	0,03
5.000	Dow Chemical Co*	4,38%	15/11/2042	5.975	0,03
5.000	Duke Energy Corp*	3,50%	15/06/2051	5.195	0,03
5.000	Duke Energy Corp*	4,80%	15/12/2045	6.130	0,03
10.000	Duke Energy Progress LLC*	2,50%	15/08/2050	9.260	0,05
5.000	Energy Transfer LP*	5,00%	15/05/2050	5.790	0,03
5.000	Energy Transfer LP*	5,25%	15/04/2029	5.911	0,03
5.000	Energy Transfer LP*	6,00%	15/06/2048	6.331	0,03
5.000	Enterprise Products Operating LLC*	3,70%	31/01/2051	5.374	0,03
10.000	Enterprise Products Operating LLC*	4,85%	15/03/2044	12.247	0,06
5.000	EQT Corp*	3,90%	01/10/2027	5.363	0,03
5.000	Equinix Inc**	3,40%	15/02/2052	5.153	0,03

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

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 37,61% (31 de diciembre de 2020: 53,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
5.000	Essential Utilities Inc*	4,28%	01/05/2049	6.015	0,03
5.000	Evergy Kansas Central Inc*	3,45%	15/04/2050	5.502	0,03
10.000	Exelon Corp**	4,45%	15/04/2046	12.161	0,06
10.000	Exxon Mobil Corp*	4,23%	19/03/2040	11.953	0,06
5.000	FedEx Corp*	4,95%	17/10/2048	6.465	0,03
30.000	Fifth Third Bancorp**	5,10%	29/12/2049	31.200	0,16
5.000	FirstEnergy Corp*	5,35%	15/07/2047	6.009	0,03
5.000	Fox Corp**	5,48%	25/01/2039	6.477	0,03
5.000	Fox Corp**	5,58%	25/01/2049	6.767	0,03
5.000	Freeport-McMoRan Inc*	5,40%	14/11/2034	6.046	0,03
5.000	Freeport-McMoRan Inc*	5,45%	15/03/2043	6.118	0,03
10.000	General Motors Co*	5,00%	01/04/2035	12.109	0,06
5.000	Gilead Sciences Inc**	4,50%	01/02/2045	6.128	0,03
5.000	Gilead Sciences Inc**	4,75%	01/03/2046	6.352	0,03
30.000	Goldman Sachs Group Inc**	3,80%	29/12/2049	30.609	0,16
15.000	Goldman Sachs Group Inc**	4,02%	31/10/2038	17.625	0,09
26.000	Goldman Sachs Group Inc**	4,95%	29/12/2049	27.855	0,14
5.000	Home Depot Inc*	3,30%	15/04/2040	5.488	0,03
5.000	Home Depot Inc*	4,40%	15/03/2045	6.365	0,03
200.000	HSBC Holdings Plc*	4,70%	29/12/2049	208.000	1,08
35.000	Huntington Bancshares Inc**	5,70%	29/12/2049	36.400	0,19
10.000	Intel Corp**	3,25%	15/11/2049	10.666	0,06
5.000	Intercontinental Exchange Inc*	3,00%	15/09/2060	4.834	0,02
5.000	JPMorgan Chase & Co**	2,53%	19/11/2041	4.776	0,02
5.000	JPMorgan Chase & Co**	3,33%	22/04/2052	5.347	0,03
30.000	JPMorgan Chase & Co**	3,65%	29/12/2049	30.080	0,16
52.000	JPMorgan Chase & Co**	4,60%	29/12/2049	53.953	0,28
10.000	JPMorgan Chase & Co*	5,40%	06/01/2042	13.730	0,07
5.000	Kentucky Utilities Co*	3,30%	01/06/2050	5.298	0,03
10.000	Kinder Morgan Inc*	5,55%	01/06/2045	12.967	0,07
5.000	Lockheed Martin Corp*	4,07%	15/12/2042	6.089	0,03
10.000	Lowe's Cos Inc*	3,00%	15/10/2050	9.877	0,05
5.000	LYB International Finance BV*	4,88%	15/03/2044	6.246	0,03
5.000	LYB International Finance III LLC*	4,20%	01/05/2050	5.770	0,03
5.000	Magellan Midstream Partners LP*	3,95%	01/03/2050	5.439	0,03
5.000	Marathon Oil Corp*	5,20%	01/06/2045	6.017	0,03
5.000	Marathon Petroleum Corp*	4,75%	15/09/2044	5.935	0,03
5.000	Martin Marietta Materials Inc**	3,20%	15/07/2051	5.013	0,03

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

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 37,61% (31 de diciembre de 2020: 53,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
5.000	Masco Corp*	4,50%	15/05/2047	6.099	0,03
5.000	McDonald's Corp*	4,45%	01/03/2047	6.151	0,03
5.000	MetLife Inc*	4,88%	13/11/2043	6.612	0,03
15.000	Microsoft Corp**	2,53%	01/06/2050	14.771	0,08
5.000	Microsoft Corp**	2,68%	01/06/2060	4.966	0,03
15.000	Morgan Stanley**	3,97%	22/07/2038	17.654	0,09
5.000	MPLX LP*	2,65%	15/08/2030	5.051	0,03
5.000	MPLX LP*	5,50%	15/02/2049	6.486	0,03
5.000	Norfolk Southern Corp**	3,94%	01/11/2047	5.778	0,03
5.000	Oracle Corp*	3,60%	01/04/2050	5.143	0,03
5.000	Oracle Corp*	3,95%	25/03/2051	5.464	0,03
10.000	Oracle Corp*	4,00%	15/07/2046	10.862	0,06
10.000	Pacific Gas & Electric Co*	3,50%	01/08/2050	8.926	0,05
5.000	Pacific Gas & Electric Co*	4,30%	15/03/2045	4.818	0,02
5.000	Pacific Gas & Electric Co**	4,95%	01/07/2050	5.151	0,03
10.000	PacifiCorp*	3,30%	15/03/2051	10.633	0,05
5.000	PepsiCo Inc**	3,45%	06/10/2046	5.643	0,03
5.000	Philip Morris International Inc*	3,88%	21/08/2042	5.543	0,03
5.000	Public Service Electric & Gas Co*	3,85%	01/05/2049	5.974	0,03
5.000	Rogers Communications Inc*	4,35%	01/05/2049	5.900	0,03
10.000	Shell International Finance BV*	4,38%	11/05/2045	12.282	0,06
5.000	Simon Property Group LP*	3,25%	13/09/2049	5.058	0,03
5.000	Southern California Edison Co*	4,88%	01/03/2049	5.935	0,03
5.000	Southern Co*	4,40%	01/07/2046	5.882	0,03
10.000	Southwestern Public Service Co**	3,15%	01/05/2050	10.478	0,05
5.000	Starbucks Corp**	4,45%	15/08/2049	6.214	0,03
10.000	Steel Dynamics Inc**	3,25%	15/10/2050	10.002	0,05
5.000	Suncor Energy Inc*	3,75%	04/03/2051	5.419	0,03
5.000	Sysco Corp*	3,30%	15/02/2050	5.036	0,03
5.000	Sysco Corp*	6,60%	01/04/2050	7.781	0,04
10.000	T-Mobile USA Inc*	4,38%	15/04/2040	11.754	0,06
10.000	TotalEnergies Capital International SA*	3,13%	29/05/2050	10.159	0,05
5.000	TotalEnergies Capital International SA**	3,39%	29/06/2060	5.287	0,03
5.000	Travelers Cos Inc*	2,55%	27/04/2050	4.840	0,03
20.000	Truist Financial Corp**	5,10%	29/12/2049	22.525	0,12
5.000	Union Pacific Corp**	3,84%	20/03/2060	5.708	0,03
4.758	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust**	5,88%	15/10/2027	5.290	0,03
5.000	United Parcel Service Inc*	3,75%	15/11/2047	5.903	0,03

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

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 37,61% (31 de diciembre de 2020: 53,67%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
5.000	UnitedHealth Group Inc*	2,75%	15/05/2040	5.072	0,03
5.000	UnitedHealth Group Inc*	4,20%	15/01/2047	6.136	0,03
5.000	Utah Acquisition Sub Inc**	5,25%	15/06/2046	6.109	0,03
10.000	Verizon Communications Inc*	2,88%	20/11/2050	9.523	0,05
5.000	Verizon Communications Inc*	4,13%	15/08/2046	5.915	0,03
10.000	Verizon Communications Inc*	4,86%	21/08/2046	12.960	0,07
5.000	ViacomCBS Inc**	4,60%	15/01/2045	5.955	0,03
10.000	Viatis Inc**	3,85%	22/06/2040	10.659	0,06
5.000	Visa Inc*	4,30%	14/12/2045	6.428	0,03
10.000	Vodafone Group Plc**	4,38%	19/02/2043	11.698	0,06
5.000	Vodafone Group Plc**	5,00%	30/05/2038	6.311	0,03
200.000	Vodafone Group Plc*	6,25%	03/10/2078	220.820	1,14
10.000	Walmart Inc*	2,95%	24/09/2049	10.619	0,05
5.000	Walt Disney Co*	3,60%	13/01/2051	5.682	0,03
10.000	Waste Management Inc*	2,50%	15/11/2050	9.394	0,05
5.000	Wells Fargo & Co**	3,07%	30/04/2041	5.138	0,03
80.000	Wells Fargo & Co**	3,90%	29/12/2049	82.874	0,43
10.000	Wells Fargo & Co*	4,90%	17/11/2045	12.866	0,07
5.000	Wells Fargo & Co**	5,01%	04/04/2051	6.863	0,04
Total dólar estadounidense				2.719.532	14,06
Total bonos de empresa				7.274.582	37,61
Bonos del Estado 5,25% (31 de diciembre de 2020: 8,19%)					
Dólar estadounidense					
25.969	United States Treasury Inflation Indexed Bonds*	0,25%	15/02/2050	29.454	0,15
48.720	United States Treasury Inflation Indexed Bonds*	0,50%	15/01/2028	54.653	0,28
10.000	United States Treasury Note/Bond*	0,13%	15/05/2023	9.983	0,05
15.000	United States Treasury Note/Bond*	1,13%	15/05/2040	12.954	0,07
10.000	United States Treasury Note/Bond*	1,38%	15/11/2040	8.987	0,05
95.000	United States Treasury Note/Bond*	1,38%	15/08/2050	80.115	0,41
30.000	United States Treasury Note/Bond*	1,63%	15/05/2031	30.464	0,16
41.600	United States Treasury Note/Bond*	1,63%	15/11/2050	37.375	0,19
40.000	United States Treasury Note/Bond*	1,88%	15/02/2041	39.169	0,20
60.000	United States Treasury Note/Bond*	2,00%	15/02/2050	58.964	0,31
50.000	United States Treasury Note/Bond*	2,25%	15/08/2049	51.812	0,27
15.000	United States Treasury Note/Bond*	2,38%	15/11/2049	15.977	0,08
55.000	United States Treasury Note/Bond**	2,50%	15/02/2045	59.525	0,31
55.000	United States Treasury Note/Bond*	2,50%	15/02/2046	59.598	0,31

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

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 del Estado 5,25% (31 de diciembre de 2020: 8,19%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
40.000	United States Treasury Note/Bond*	3,00%	15/05/2042	46.837	0,24
20.000	United States Treasury Note/Bond*	3,00%	15/11/2044	23.552	0,12
40.000	United States Treasury Note/Bond*	3,00%	15/02/2047	47.531	0,25
20.000	United States Treasury Note/Bond*	3,13%	15/02/2042	23.865	0,12
55.000	United States Treasury Note/Bond**	3,63%	15/08/2043	70.855	0,37
135.300	United States Treasury Note/Bond*	3,88%	15/08/2040	177.941	0,92
55.000	United States Treasury Note/Bond*	4,50%	15/02/2036	75.522	0,39
Total bonos del Estado				1.015.133	5,25

Número de acciones	Descripción de los valores	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Fondos de inversión 9,00% (31 de diciembre de 2020: 9,00%)			
Dólar estadounidense			
7.020	iShares JP Morgan USD EM Bond UCITS ETF	784.204	4,05
17.358	iShares MSCI India UCITS ETF	121.680	0,63
79.779	Neuberger Berman China Bond Fund	835.286	4,32
Total fondos de inversión µ		1.741.170	9,00
Total inversiones		17.177.117	88,81

Contratos de divisas a plazo 0,82% (31 de diciembre de 2020: 2,10%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
169.000 AUD	126.812 USD	22/09/2021	Goldman Sachs International	1	110	0,00
218.916 BRL	38.193 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	5.357	0,03
751.030 BRL	140.000 USD	26/08/2021	Goldman Sachs International	1	8.690	0,05
239.788 CAD	190.927 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	2.714	0,01
89.179 CAD	71.163 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	854	0,00
18.141 CAD	14.520 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	130	0,00
2.079.244 CZK	95.927 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	735	0,00
24.777 £	34.159 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	71	0,00
12.304.605 HUF	40.956 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	608	0,00
1.068.009 MXN	52.503 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	1.024	0,01
768.821 MXN	38.034 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	497	0,00
337.059 NOK	39.015 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	157	0,00
9.895.917 RUB	129.265 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	5.881	0,03
1.040.091 RUB	13.832 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	372	0,00
47.408 USD	5.113.478 ¥	19/07/2021	BNP Paribas	1	1.330	0,01
51.994 USD	64.361 CAD	19/07/2021	BNP Paribas	1	20	0,00

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,82% (31 de diciembre de 2020: 2,10%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
76.332 USD	107.377 NZD	19/07/2021	BNP Paribas	1	1.303	0,01
51.626 USD	36.667 £	19/07/2021	BNP Paribas	1	970	0,01
95.372 USD	805.470 SEK	19/07/2021	BNP Paribas	2	1.173	0,01
86.579 USD	1.848.370 CZK	19/07/2021	BNP Paribas	3	649	0,00
47.571 USD	393.003 NOK	19/07/2021	BNP Paribas	1	1.896	0,01
88.479 USD	63.000 £	22/07/2021	Citibank NA	2	1.442	0,01
92.933 USD	65.534 £	19/07/2021	Citibank NA	2	2.397	0,01
28.207 USD	31.383.196 KRW	19/07/2021	Citibank NA	1	435	0,00
283.261 USD	343.277 CAD	19/07/2021	Citibank NA	7	6.047	0,03
67.888 USD	567.209 SEK	19/07/2021	Citibank NA	2	1.554	0,01
10.244 USD	14.532 NZD	19/07/2021	Citibank NA	1	90	0,00
46.716 USD	5.092.150 ¥	19/07/2021	Citibank NA	1	831	0,00
39.613 USD	36.356 CHF	19/07/2021	Citibank NA	1	264	0,00
23.219 USD	30.008 AUD	19/07/2021	Citibank NA	1	689	0,00
293.160 USD	241.597 €	19/07/2021	Citibank NA	4	6.547	0,03
195.068 USD	160.000 €	26/08/2021	Goldman Sachs International	3	5.108	0,03
33.433 USD	44.000 AUD	22/09/2021	Goldman Sachs International	1	388	0,00
115.571 USD	964.499 NOK	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	3.478	0,02
58.199 USD	80.061 NZD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	2.257	0,01
34.454 USD	28.496 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	648	0,00
100.389 USD	10.811.626 ¥	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	2.965	0,02
55.037 USD	463.069 SEK	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	881	0,01
23.800 USD	89.951 PLN	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	169	0,00
183.447 USD	166.838 CHF	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	2.871	0,02
203.780 USD	250.760 CAD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	1.279	0,01
201.381 USD	261.657 AUD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	4.925	0,03
143.607 USD	1.196.913 SEK	19/07/2021	Standard Chartered Bank	3	3.629	0,02
35.311 USD	45.589 AUD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	1.082	0,01
94.954 USD	78.494 €	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	1.834	0,01
155.995 USD	219.576 NZD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	3	2.570	0,01
92.973 USD	84.362 CHF	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	1.665	0,01
165.860 USD	18.231.800 ¥	19/07/2021	Standard Chartered Bank	2	1.572	0,01
824.271 USD	757.438 CHF	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	4.465	0,02
46.792 USD	5.113.779 ¥	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	712	0,00
381 USD	3.226 TRY	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	13	0,00
1.069.583 USD	892.418 €	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	4	10.883	0,06
23.757 USD	197.228 NOK	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	836	0,00

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,82% (31 de diciembre de 2020: 2,10%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
35.460 USD	25.364 £	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	419	0,00
15.548 USD	131.789 SEK	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	136	0,00
48.102 USD	66.892 NZD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	1.362	0,01
46.748 USD	57.399 CAD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	396	0,00
4.233.639 USD	3.530.580 €	19/07/2021	UBS AG	1	45.217	0,23
69.979 ZAR	4.764 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	127	0,00
Clases EUR con cobertura						
1.027 €	1.218 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
91.414 USD	75.697 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	15	1.612	0,01
Clases GBP con cobertura						
7.694 £	10.591 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	39	0,00
7.694 £	10.592 USD	19/07/2021	UBS AG	1	37	0,00
7.579 £	10.429 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	42	0,00
697 USD	498 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	9	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					158.463	0,82

Contratos de futuros 0,04% (31 de diciembre de 2020: 0,01%)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
1	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2021	8.319	0,04
Minusvalía latente total sobre contratos de futuros ±		8.319	0,04

Contratos de opciones sobre índices adquiridos 0,00% (31 de diciembre de 2020: 0,03%)

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de compra					
2	07/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,800	(13)	10	0,00
1	14/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,800	(8)	7	0,00
1	21/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,800	(11)	10	0,00
1	14/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,750	(11)	0	0,00
1	07/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,750	(12)	0	0,00
Opciones de venta					
1	07/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,800	(481)	30	0,00
1	14/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,800	(741)	137	0,00
1	07/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,825	(769)	32	0,00
2	07/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,840	(334)	70	0,00
1	14/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,840	(352)	158	0,00

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de opciones sobre índices adquiridos 0,00% (31 de diciembre de 2020: 0,03%) (cont.)

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de venta (cont.)					
1	21/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$3,840	(581)	350	0,00
Total valor razonable en contratos de opciones sobre índices adquiridos[±]				804	0,00

Contratos de swap de rentabilidad total (0,02%) (31 de diciembre de 2020: 0,00%)

Importe nominal	Fecha de extinción	Tipo variable	Entidad de referencia	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto	
USD	44.807	20/08/2021	0,07 ¹	Goldman Sachs Basket GSCBNBRO ²	3.387	0,02
Plusvalía latente total sobre contratos de swap de rentabilidad total [∞]				3.387	0,02	

¹ El LIBOR a 1 meses es la referencia para este contrato de swap de rentabilidad total.

² La contraparte en este contrato de swap de rentabilidad total es Goldman Sachs International.

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	17.348.090	89,69

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,57%) (31 de diciembre de 2020: (3,21%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
107.685 AUD	83.398 USD	19/07/2021	BNP Paribas	2	(2.546)	(0,01)
63.091 AUD	48.870 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(1.500)	(0,01)
299.572 AUD	230.849 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	4	(5.926)	(0,03)
124.839 AUD	96.635 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(2.905)	(0,02)
22.751 CHF	24.880 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(256)	(0,00)
8.232 CHF	9.192 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(282)	(0,00)
9.949 CHF	11.042 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(274)	(0,00)
116.903 CHF	127.026 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	2	(497)	(0,00)
43.546 CHF	47.685 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(553)	(0,00)
125.655 €	150.980 USD	19/07/2021	BNP Paribas	3	(1.912)	(0,01)
155.755 €	189.518 USD	19/07/2021	Citibank NA	4	(4.741)	(0,02)
462.947 €	564.037 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	5	(14.831)	(0,08)
160.000 €	195.741 USD	26/08/2021	Goldman Sachs International	1	(5.781)	(0,03)
53.300 €	63.906 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(675)	(0,00)
39.278 €	47.694 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(1.098)	(0,01)
39.917 £	55.620 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(474)	(0,00)
62.989 £	88.425 USD	19/07/2021	Citibank NA	2	(1.405)	(0,01)

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (0,57%) (31 de diciembre de 2020: (3,21%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
63.000 £	87.956 USD	22/07/2021	Citibank NA	1	(920)	(0,01)
33.416 £	46.385 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(221)	(0,00)
146.450 £	203.597 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	4	(1.273)	(0,01)
3.243.457 HUF	11.046 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(90)	(0,00)
2.267.059 ¥	20.551 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(123)	(0,00)
18.699.015 ¥	171.111 USD	19/07/2021	Citibank NA	4	(2.612)	(0,01)
14.358.681 ¥	132.644 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(3.256)	(0,02)
97.183.896 ¥	891.932 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	4	(16.201)	(0,08)
4.024.358 ¥	36.764 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(500)	(0,00)
31.359.662 KRW	27.970 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(219)	(0,00)
112.400.000 KRW	100.000 USD	26/08/2021	Goldman Sachs International	1	(545)	(0,00)
564.359 NOK	66.248 USD	19/07/2021	BNP Paribas	2	(659)	(0,00)
1.104.683 NOK	133.215 USD	19/07/2021	Citibank NA	3	(4.829)	(0,03)
142.303 NOK	17.056 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(518)	(0,00)
2.449.506 NOK	290.402 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(5.723)	(0,03)
171.667 NZD	123.475 USD	19/07/2021	Citibank NA	2	(3.525)	(0,02)
66.484 NZD	47.452 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(997)	(0,01)
32.266 NZD	23.175 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(629)	(0,00)
81.247 PLN	21.736 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(392)	(0,00)
405.832 SEK	48.582 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(1.120)	(0,01)
394.508 SEK	47.434 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(1.296)	(0,01)
1.125.250 SEK	133.055 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(1.459)	(0,01)
75.172 SEK	8.986 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(195)	(0,00)
22.111 USD	120.114 BRL	19/07/2021	BNP Paribas	1	(1.784)	(0,01)
45.646 USD	653.724 ZAR	19/07/2021	BNP Paribas	1	(38)	(0,00)
42.206 USD	843.165 MXN	19/07/2021	Citibank NA	1	(52)	(0,00)
25.350 USD	545.408 CZK	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(5)	(0,00)
15.318 USD	19.006 CAD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(30)	(0,00)
44.400 USD	227.874 BRL	26/08/2021	Goldman Sachs International	1	(715)	(0,00)
468.928 USD	340.168 £	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(1.021)	(0,01)
49.694 USD	3.704.399 RUB	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(896)	(0,01)
55.531 USD	475.720 SEK	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(104)	(0,00)
79.989 USD	58.062 £	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(225)	(0,00)
326.752 ZAR	23.657 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(823)	(0,00)
Clases EUR con cobertura						
301.945 €	362.253 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	8	(4.046)	(0,02)
266.153 €	318.954 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(3.209)	(0,02)
319.987 €	383.762 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	15	(4.153)	(0,02)

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (0,57%) (31 de diciembre de 2020: (3,21%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases GBP con cobertura						
128 £	182 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(5)	(0,00)
117 £	165 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(4)	(0,00)
782 £	1.100 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	5	(20)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					(110.088)	(0,57)

Contratos de futuros (0,16%) (31 de diciembre de 2020: (0,07%))

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(1)	Euro-Bund Future September 2021	(795)	(0,00)
(1)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2021	(2.894)	(0,02)
(1)	US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2021	(3.631)	(0,02)
(3)	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2021	(23.443)	(0,12)
Minusvalía latente total sobre contratos de futuros ±		(30.763)	(0,16)

Contratos de opciones sobre índices suscritos (0,03%) (31 de diciembre de 2020: (0,21%))

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de compra					
1	07/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,380	159	(40)	(0,00)
1	14/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,390	274	(220)	(0,00)
1	07/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,400	502	(25)	(0,00)
1	07/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,415	54	(15)	(0,00)
1	14/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,425	136	(83)	(0,00)
1	21/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,440	214	(175)	(0,00)
Opciones de venta					
1	14/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,135	3.159	(670)	(0,00)
1	07/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,145	2.498	(122)	(0,00)
1	07/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,150	3.080	(130)	(0,00)
1	21/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,175	2.797	(1.670)	(0,01)
1	14/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,190	2.169	(1.010)	(0,01)
2	07/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,200	2.742	(485)	(0,00)
1	20/08/2021	MSCI Emerging Markets Index, Strike Price \$1,330	2.589	(1.785)	(0,01)
1	16/07/2021	MSCI Emerging Markets Index, Strike Price \$1,340	1.432	(560)	(0,00)
Total valor razonable en contratos de opciones sobre índices suscritos^e				(6.990)	(0,03)

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de swap de rentabilidad total (0,01%) (31 de diciembre de 2020: (0,00%))

Importe nocional	Fecha de extinción	Tipo variable	Entidad de referencia	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
USD (45.407)	20/08/2021	0,07 ¹	Goldman Sachs Basket GSCBNBST ²	(2.292)	(0,01)
Minusvalía latente total sobre contratos de swap de rentabilidad total [∞]				(2.292)	(0,01)

¹ El LIBOR a 1 meses es la referencia para este contrato de swap de rentabilidad total.

² La contraparte en este contrato de swap de rentabilidad total es Goldman Sachs International.

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(150.133)	(0,77)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	17.197.957	88,92
Otro activo neto	2.143.492	11,08
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	19.341.449	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	12.996.434	65,59
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	2.439.513	12,31
μ Fondos de inversión	1.741.170	8,79
± Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	(28.630)	(0,14)
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	49.470	0,25
Total inversiones	17.197.957	86,80

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
800.000	HSBC Holdings Plc, 4.70%, 29/12/2049	800.000
5.152	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	632.603
400.000	NGG Finance Plc, 5.63%, 18/06/2073	630.831
7.840	Samsung Electronics Co Ltd	595.213
400.000	Volkswagen International Finance NV, 4.63%, 29/12/2049	553.171
464.000	Atrium European Real Estate Ltd, 3.63%, 29/12/2049	550.520
480.000	United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 15/11/2044	540.179
400.000	Rolls-Royce Plc, 4.63%, 16/02/2026	527.897
400.000	CMA CGM SA, 7.50%, 15/01/2026	523.646
2.140	Alibaba Group Holding Ltd ADR	506.694
400.000	ZF Europe Finance BV, 3.00%, 23/10/2029	501.247
400.000	IPD 3 BV, 5.50%, 01/12/2025	494.600
400.000	Verisure Midholding AB, 5.25%, 15/02/2029	490.731
400.000	Fastighets AB Balder, 2.87%, 02/06/2081	486.370
400.000	Iberdrola International BV, 0.00%, 29/12/2049	481.140
400.000	Virgin Media Finance Plc, 3.75%, 15/07/2030	477.661
70.336	iShares MSCI India UCITS ETF	470.204
400.000	eG Global Finance Plc, 4.38%, 07/02/2025	469.250
3.536	Simon Property Group Inc	440.378
5.200	Tencent Holdings Ltd	436.222
440.000	United States Treasury Note/Bond, 1.88%, 15/02/2051	402.831
360.000	Wells Fargo & Co, 3.90%, 15/03/2170	360.000
299.985	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0.50%, 15/01/2028	338.351
400.000	United States Treasury Note/Bond, 1.38%, 15/08/2050	336.089

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

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
1.040.000	SSE Plc, 4.75%, 16/09/2077	1.080.040
920.000	UniCredit SpA, 8.00%, 29/12/2049	1.020.059
800.000	ING Groep NV, 5.75%, 29/12/2049	878.840
600.000	Constellium SE, 4.25%, 15/02/2026	742.012
460.000	TotalEnergies SE, 2.71%, 29/12/2049	578.946
436.000	Rossini Sarl, 6.75%, 30/10/2025	561.428
460.000	United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 15/11/2045	557.052
460.000	United States Treasury Note/Bond, 2.75%, 15/08/2042	520.324
400.000	Eni SpA, 3.38%, 29/12/2049	510.481
358.800	United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/08/2040	493.193
400.000	Kapla Holding SAS, 3.38%, 15/12/2026	486.839
400.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co, 4.75%, 15/04/2024	486.728
400.000	Iberdrola International BV, 0.00%, 29/12/2049	484.104
400.000	Bayer AG, 2.38%, 02/04/2075	483.088
400.000	United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 15/02/2047	474.435
400.000	Fastighets AB Balder, 2.87%, 02/06/2081	470.405
400.000	Intrum AB, 3.00%, 15/09/2027	469.272
320.000	Federal Home Loan Banks, 5.50%, 15/07/2036	459.654
400.000	United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 15/11/2044	456.691
400.000	Vivion Investments Sarl, 3.50%, 01/11/2025	445.138
359.682	NH Hotel Group SA, 3.75%, 01/10/2023	435.701
440.000	United States Treasury Note/Bond, 1.88%, 15/02/2051	418.314
460.000	United States Treasury Note/Bond, 1.25%, 15/05/2050	358.473
285.505	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0.25%, 15/02/2050	315.377

Neuberger Berman US Equity Index Putwrite Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 11,65%. Durante el mismo periodo, el Índice de referencia combinado¹ se anotó una rentabilidad del 9,54%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Otro buen trimestre para las Bolsas estadounidenses ha permitido que el S&P 500 alcance su mejor primer semestre desde 1998. Parece que estas ganancias tan abultadas de la Bolsa se deben sencillamente a que es allí donde se destinó el dinero. Según Goldman Sachs, los flujos destinados a fondos de renta variable global durante el primer semestre de 2021 alcanzaron un máximo récord no visto desde 1996. Los flujos, situados en 517.000 millones de dólares, se multiplicaron por más de 2,5 respecto al máximo anterior alcanzado en 2017, una cifra asombrosa cuyo impacto en los precios de las acciones es difícil de predecir. Con 125 días de negociación en el primer semestre de 2021, esto supone una demanda diaria media de aprox. 4.000 millones de dólares. En lo que va de año, el S&P 500 Index ha repuntado un 15,25%, el CBOE S&P 500 PutWrite ("PUT") ha escalado un 11,77% y el CBOE Russell 2000 PutWrite ("PUTR") se ha apreciado un 19,08%.

En el periodo semestral cerrado a 30 de junio de 2021, tanto las exposiciones a gran capitalización como a pequeña capitalización estadounidenses contribuyeron a la rentabilidad de la cartera. En lo que va de año, el S&P 500 PutWrite Strategy ha rendido un atractivo 11,67%, quedándose ligeramente por detrás respecto a la rentabilidad de PUT, que alcanzó el 11,77% (11 pb menos). Por otro lado, la estrategia renovable semanal CBOE S&P 500 One-Week PutWrite se quedó rezagada respecto a la estrategia renovable mensual de la PUT en -487 pb. Durante el mismo periodo, la estrategia Russell 2000 PutWrite se quedó a la zaga de la rentabilidad de PUTR al alcanzar el 14,46% frente al 19,08% registrada por esta última. La estrategia CBOE Russell 2000 One-Week PutWrite, que rentó el 2,76%, se quedó muy por detrás de la rentabilidad generada por la PUTR (19,08%). Las participaciones colaterales de la Cartera continuaron contribuyendo de forma favorable a la rentabilidad general.

Aunque los niveles de volatilidad implícita siguen descendiendo a escala mundial, los niveles de volatilidad materializada no dejan de retroceder, lo que produce unas primas de volatilidad implícita atractivas. A medida que los mercados van remontando desde el parón de 2020, prevemos que las primas seguirán normalizándose, aunque los niveles generales de volatilidad siguen siendo elevados en relación con los niveles históricamente bajos observados en los años previos a la pandemia. Sin embargo, como hemos escrito en ocasiones anteriores, lo normal va a ser experimentar volatilidad comparado con los periodos tranquilos anteriores a la pandemia por COVID-19. De cara al futuro, los mercados de volatilidad siguen descontando niveles más altos de volatilidad implícita para el segundo semestre de 2021 y principios de 2022. Las fuentes potenciales de volatilidad abundan y es poco probable que los mecanismos de control económico ofrezcan sus niveles históricos de eficacia.

En definitiva, la cartera continúa beneficiándose de las saludables ganancias de las Bolsas y de los elevados niveles de volatilidad, al captar rentabilidades de dos dígitos en el transcurso del primer semestre de 2021. Cuando examinamos las perspectivas del segundo semestre y de 2022, creemos que nuestra estrategia está jugando sus bazas y está en condiciones de seguir siendo competitiva frente a la mayoría de exposiciones a clases de activos. Después de muchos años forjándose un historial respetable, creemos que nuestras "empresas franquiciadas" por fin se encuentran en "plena forma", lo que hace arriesgada la táctica de hacer "retoques".

¹El índice de referencia combinado se compone de un 42,5% del CBOE S&P 500 One-Week PutWrite Index / 42,5% del CBOE S&P 500 PutWrite Index / 7,5% del CBOE Russell 2000 One-Week PutWrite Index y 7,5% del CBOE Russell 2000 PutWrite Index.

Neuberger Berman US Equity Index Putwrite Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		311.107.805	185.559.079
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	61.005.085	30.277.496
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		468.268	516.175
Cuentas a percibir por acciones emitidas		9.815.066	180.010
Ingresos a percibir y otros activos		1.004.725	639.516
Activos totales		383.400.949	217.172.276
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		2.478.005	12.380.414
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		633.492	80.847
Gastos devengados		194.223	98.451
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		9.778	73.495
Otras cuentas por pagar		44.395	14.900
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		3.359.893	12.648.107
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		380.041.056	204.524.169

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman US Equity Index Putwrite Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		2.573.099	4.967.009
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		29.084.554	(44.231.776)
		31.657.653	(39.264.767)
Gastos			
Comisión de gestión	5	688.119	1.309.769
Comisión de distribución	5	6.099	12.074
Comisión de administración	5	125.406	272.907
Comisión de compromiso	16	39.074	28.221
Comisión de depósito	5	6.068	6.961
Comisión del Depositario	5	6.904	25.722
Honorarios profesionales	7	61.385	36.269
Honorarios de los Consejeros	6	2.633	2.565
Costes de transacciones	7	32.179	59.728
Honorarios de auditoría	7	9.640	9.239
Reembolso de IVA		(1.019)	(1.945)
Otros gastos	7	4.721	10.865
Gastos no asumidos	5	(13)	–
Gastos totales		981.196	1.772.375
Costes financieros			
Repartos de dividendos abonados	1	58.983	68.382
		58.983	68.382
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		30.617.474	(41.105.524)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Neuberger Berman US Equity Index Putwrite Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	204.524.169	554.431.123
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	30.617.474	(41.105.524)
Suscripciones	171.971.676	496.545.080
Reembolsos	(27.072.263)	(518.099.957)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	380.041.056	491.770.722

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman US Equity Index Putwrite Fund (cont.)

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 81,85% (31 de diciembre de 2020: 85,29%)					
Dólar estadounidense					
39.600.000	United States Treasury Note/Bond	0,50%	15/03/2023	39.806.508	10,47
44.700.000	United States Treasury Note/Bond	1,50%	15/09/2022	45.443.836	11,96
44.700.000	United States Treasury Note/Bond	1,63%	15/12/2022	45.655.986	12,01
44.800.000	United States Treasury Note/Bond	1,75%	15/06/2022	45.507.416	11,97
47.400.000	United States Treasury Note/Bond	2,38%	15/03/2022	48.171.949	12,68
48.300.000	United States Treasury Note/Bond	2,63%	15/12/2021	48.865.245	12,86
37.400.000	United States Treasury Note/Bond	2,75%	15/09/2021	37.608.493	9,90
Total bonos del Estado *				311.059.433	81,85
Total inversiones				311.059.433	81,85

Contratos de divisas a plazo 0,01% (31 de diciembre de 2020: 5,44%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases EUR con cobertura						
1.267.984 USD	1.057.585 €	19/07/2021	Citibank NA	1	13.342	0,00
1.313.264 USD	1.094.767 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	14.512	0,01
1.509.136 USD	1.260.015 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	9	14.347	0,00
Clases GBP con cobertura						
301.584 £	415.258 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	1.386	0,00
306.864 £	422.391 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	1.548	0,00
297.083 £	408.798 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	1.628	0,00
4.568 USD	3.228 £	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	109	0,00
64.950 USD	46.420 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	5	820	0,00
Clases SGD con cobertura						
1.657 SGD	1.232 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	1	0,00
3.098 USD	4.139 SGD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	19	0,00
47.752 USD	63.303 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	660	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ^{oo}					48.372	0,01

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	311.107.805	81,86

Neuberger Berman US Equity Index Putwrite Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,02%) (31 de diciembre de 2020: (4,80%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases EUR con cobertura						
2.129.089 €	2.552.654 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(26.859)	(0,01)
2.353.353 €	2.823.825 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	10	(31.979)	(0,01)
2.204.232 €	2.641.506 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	7	(26.567)	(0,00)
Clases GBP con cobertura						
6.761 £	9.436 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(95)	(0,00)
39.079 £	54.984 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	9	(994)	(0,00)
172.982 USD	125.630 £	19/07/2021	Citibank NA	1	(578)	(0,00)
172.930 USD	125.630 £	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(630)	(0,00)
170.291 USD	123.754 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(678)	(0,00)
Clases SGD con cobertura						
48.798 SGD	36.501 USD	19/07/2021	Citibank NA	2	(200)	(0,00)
52.673 SGD	39.407 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	6	(225)	(0,00)
123.525 SGD	92.768 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	16	(877)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(89.682)	(0,02)

Contratos de opciones sobre índices suscritos (0,63%) (31 de diciembre de 2020: (1,26%))

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de venta					
(29)	16/07/2021	CBOE Russell 2000 Index, Strike Price \$2,250	158.632	(39.295)	(0,01)
(21)	16/07/2021	CBOE Russell 2000 Index, Strike Price \$2,280	101.065	(42.945)	(0,01)
(2)	16/07/2021	CBOE Russell 2000 Index, Strike Price \$2,300	10.318	(5.380)	(0,00)
(6)	16/07/2021	CBOE Russell 2000 Index, Strike Price \$2,320	30.204	(21.090)	(0,01)
(12)	09/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,210	74.509	(7.260)	(0,00)
(75)	02/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,220	425.922	(6.750)	(0,00)
(25)	09/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,220	164.159	(16.875)	(0,00)
(1)	09/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,225	6.101	(715)	(0,00)
(91)	09/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,230	459.663	(69.615)	(0,02)
(53)	09/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,240	298.812	(46.110)	(0,01)
(50)	23/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,245	275.948	(146.500)	(0,04)
(77)	23/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,265	399.473	(258.720)	(0,07)
(59)	23/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,275	291.540	(213.285)	(0,06)
(20)	30/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,275	121.316	(93.900)	(0,02)
(20)	30/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,280	116.846	(96.800)	(0,03)
(31)	30/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,285	173.478	(154.845)	(0,04)

Neuberger Berman US Equity Index Putwrite Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de opciones sobre índices suscritos (0,63%) (31 de diciembre de 2020: (1,26%)) (cont.)

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de venta (cont.)					
(75)	30/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,295	421.667	(399.000)	(0,10)
(13)	02/07/2021	Russell 2000 Index, Strike Price \$2,270	72.061	(3.153)	(0,00)
(40)	02/07/2021	Russell 2000 Index, Strike Price \$2,280	203.613	(13.600)	(0,00)
(8)	09/07/2021	Russell 2000 Index, Strike Price \$2,280	45.252	(9.640)	(0,00)
(2)	02/07/2021	Russell 2000 Index, Strike Price \$2,285	11.078	(820)	(0,00)
(5)	02/07/2021	Russell 2000 Index, Strike Price \$2,295	28.545	(3.025)	(0,00)
(25)	23/07/2021	Russell 2000 Index, Strike Price \$2,310	121.257	(100.375)	(0,03)
(11)	09/07/2021	Russell 2000 Index, Strike Price \$2,315	57.163	(26.125)	(0,01)
(7)	30/07/2021	Russell 2000 Index, Strike Price \$2,315	35.063	(35.245)	(0,01)
(9)	09/07/2021	Russell 2000 Index, Strike Price \$2,320	46.368	(23.445)	(0,01)
(19)	23/07/2021	Russell 2000 Index, Strike Price \$2,320	84.322	(84.645)	(0,02)
(14)	09/07/2021	Russell 2000 Index, Strike Price \$2,325	64.246	(39.970)	(0,01)
(17)	09/07/2021	Russell 2000 Index, Strike Price \$2,335	88.719	(58.225)	(0,02)
(16)	23/07/2021	Russell 2000 Index, Strike Price \$2,340	71.170	(87.360)	(0,02)
(5)	30/07/2021	Russell 2000 Index, Strike Price \$2,340	25.945	(31.200)	(0,01)
(95)	16/07/2021	S&P 500 Index, Strike Price \$4,180	600.207	(114.000)	(0,03)
(43)	16/07/2021	S&P 500 Index, Strike Price \$4,220	251.939	(68.585)	(0,02)
(22)	16/07/2021	S&P 500 Index, Strike Price \$4,230	128.739	(37.950)	(0,01)
(17)	16/07/2021	S&P 500 Index, Strike Price \$4,240	95.169	(31.875)	(0,01)
Total valor razonable en contratos de opciones sobre índices suscritos ±				(2.388.323)	(0,63)
				Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados				(2.478.005)	(0,65)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados				308.629.800	81,21
Otro activo neto				71.411.256	18,79
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables				380.041.056	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				311.059.433	81,13
± Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados				(2.388.323)	(0,62)
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC				(41.310)	(0,01)
Total inversiones				308.629.800	80,50

Neuberger Berman US Equity Index Putwrite Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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 período 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 período. Como mínimo, se presentan las 20 compras y las 20 ventas más importantes, siempre que se disponga de dicha información.

Total compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
44.700.000	United States Treasury Note/Bond, 1.63%, 15/12/2022	45.794.094
39.600.000	United States Treasury Note/Bond, 0.50%, 15/03/2023	39.842.043
31.100.000	United States Treasury Note/Bond, 1.50%, 15/09/2022	31.717.816
26.700.000	United States Treasury Note/Bond, 2.38%, 15/03/2022	27.285.922
25.000.000	United States Treasury Note/Bond, 1.75%, 15/06/2022	25.494.551
19.000.000	United States Treasury Note/Bond, 2.75%, 15/09/2021	19.272.828
4.800.000	United States Treasury Note/Bond, 2.63%, 15/06/2021	4.846.313

En el período no hubo ventas.

Neuberger Berman Global Equity Index Putwrite Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 8,36%. Durante el mismo periodo, el Índice de referencia combinado¹ se anotó una rentabilidad del 10,05%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Otro buen trimestre para las Bolsas estadounidenses ha permitido que el S&P 500 alcance su mejor primer semestre desde 1998. Los mercados internacionales se anotaron ganancias similares de manera concertada durante el trimestre, al apreciarse los índices MSCI EAFE y EM un 9,17% y 7,58%, respectivamente. Parece que estas ganancias tan abultadas de la Bolsa se deben sencillamente a que es allí donde se destinó el dinero. Según Goldman Sachs, los flujos destinados a fondos de renta variable global durante el primer semestre de 2021 alcanzaron un máximo récord no visto desde 1996. Los flujos, situados en 517.000 millones de dólares, se multiplicaron por más de 2,5 respecto al máximo anterior alcanzado en 2017, una cifra asombrosa cuyo impacto en los precios de las acciones es difícil de predecir. Con 125 días de negociación en el primer semestre de 2021, esto supone una demanda diaria media de aprox. 4.000 millones de dólares. En el año hasta la fecha, el MSCI ACWI Index se ha anotado una apreciable alza del 12,56%, mientras que el S&P 500 Index ha repuntado un 15,25%.

En el periodo semestral cerrado a 30 de junio de 2021, las exposiciones a mercados desarrollados no estadounidenses y mercados emergentes contribuyeron a la rentabilidad de la Cartera. En lo que va de año, la estrategia US Equity Index PutWrite ha arrojado una ganancia del 11,19%, quedándose ligeramente rezagada respecto a la rentabilidad del CBOE S&P 500 PutWrite ("PUT"), que alcanzó el 11,77% (58 pb menos). Por otro lado, la estrategia renovable semanal CBOE S&P 500 One-Week PutWrite se quedó rezagada respecto a la estrategia renovable mensual de la PUT en -487 pb. Durante el mismo periodo, la estrategia Non-US Developed Index PutWrite ha ganado un 7,13% aunque le costó seguir el ritmo del CBOE MSCI EAFE PutWrite Index, que arrojó una rentabilidad del 9,76% (263 pb menos). En lo que va de año, la estrategia Emerging Market Index PutWrite ha escalado hasta el 4,92%, aunque se quedó algo a la zaga del CBOE MSCI EM PutWrite Index, que tuvo una rentabilidad del 5% (8 pb menos). Las posiciones colaterales de la Cartera continuaron contribuyendo de forma favorable a la rentabilidad general.

Aunque los niveles de volatilidad implícita siguen descendiendo a escala mundial, los niveles de volatilidad materializada no dejan de retroceder, lo que produce unas primas de volatilidad implícita atractivas. A medida que los mercados van remontando desde el parón de 2020, preveemos que las primas seguirán normalizándose, aunque los niveles generales de volatilidad siguen siendo elevados en relación con los niveles históricamente bajos observados en los años previos a la pandemia. Sin embargo, como hemos escrito en ocasiones anteriores, lo normal va a ser experimentar volatilidad comparado con los periodos tranquilos anteriores a la pandemia por COVID-19. De cara al futuro, los mercados de volatilidad siguen descontando niveles más altos de volatilidad implícita para el segundo semestre de 2021 y principios de 2022. Las fuentes potenciales de volatilidad abundan y es poco probable que los mecanismos de control económico ofrezcan sus niveles históricos de eficacia.

En definitiva, la cartera continúa beneficiándose de las saludables ganancias de las Bolsas y de los elevados niveles de volatilidad, al captar rentabilidades de dos dígitos en el transcurso del primer semestre de 2021. Cuando examinamos las perspectivas del segundo semestre y de 2022, creemos que nuestra estrategia está jugando sus bazas y está en condiciones de seguir siendo competitiva frente a la mayoría de exposiciones a clases de activos. Después de muchos años forjándose un historial respetable, creemos que nuestras "empresas franquiciadas" por fin se encuentran en "plena forma", lo que hace arriesgada la táctica de hacer "retoques".

¹ El índice de referencia combinado se compone de un 50% del CBOE S&P 500 PutWrite, un 35% del CBOE MSCI EAFE PutWrite y un 15% del CBOE MSCI Emerging Markets PutWrite.

Neuberger Berman Global Equity Index Putwrite Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		15.168.205	26.474.836
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	2.314.035	3.137.643
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		33.925	21.474
Ingresos a percibir y otros activos		113.539	189.979
Activos totales		17.629.704	29.823.932
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		343.382	734.552
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		13.892	–
Gastos devengados		67.565	61.790
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		491	32
Otras cuentas por pagar		30.822	7.447
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		456.152	803.821
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		17.173.552	29.020.111

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global Equity Index Putwrite Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		236.054	542.854
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		1.202.402	(6.355.304)
		1.438.456	(5.812.450)
Gastos			
Comisión de gestión	5	37.036	177.560
Comisión de distribución	5	1.759	3.002
Comisión de administración	5	54.766	88.175
Comisión de compromiso	16	2.909	3.411
Comisión de depósito	5	5.961	5.962
Comisión del Depositario	5	511	2.892
Honorarios profesionales	7	60.883	39.968
Honorarios de los Consejeros	6	2.413	2.369
Costes de transacciones	7	21.518	45.608
Honorarios de auditoría	7	11.663	10.735
Reembolso de IVA		(120)	(201)
Otros gastos	7	3.993	5.852
Gastos no asumidos	5	(139.645)	(137.557)
Gastos totales		63.647	247.776
Costes financieros			
Repartos de dividendos abonados	1	51.721	189.815
		51.721	189.815
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		1.323.088	(6.250.041)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Neuberger Berman Global Equity Index Putwrite Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	29.020.111	56.924.076
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	1.323.088	(6.250.041)
Suscripciones	1.361.865	21.146.192
Reembolsos	(14.531.512)	(32.701.626)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	17.173.552	39.118.601

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global Equity Index Putwrite Fund (cont.)

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 87,79% (31 de diciembre de 2020: 88,17%)					
Dólar estadounidense					
400.000	United States Treasury Note/Bond	1,50%	15/09/2022	406.656	2,37
700.000	United States Treasury Note/Bond	1,63%	15/12/2022	714.971	4,16
1.000.000	United States Treasury Note/Bond	1,75%	15/06/2022	1.015.791	5,92
4.000.000	United States Treasury Note/Bond	2,38%	15/03/2022	4.065.143	23,67
4.100.000	United States Treasury Note/Bond	2,63%	15/12/2021	4.147.981	24,15
4.700.000	United States Treasury Note/Bond	2,75%	15/09/2021	4.726.201	27,52
Total bonos del Estado *				15.076.743	87,79
Total inversiones				15.076.743	87,79

Contratos de divisas a plazo 0,53% (31 de diciembre de 2020: 3,06%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases CHF con cobertura						
95.636 USD	87.218 CHF	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	1.236	0,01
79.826 USD	72.430 CHF	19/07/2021	Westpac Banking Corp	7	1.431	0,01
Clases EUR con cobertura						
2.445.012 USD	2.039.412 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	25.603	0,15
2.444.001 USD	2.039.412 €	19/07/2021	UBS AG	1	24.591	0,14
2.711.722 USD	2.261.798 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	18	28.493	0,16
Clases GBP con cobertura						
653.347 £	899.336 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	3.276	0,02
652.646 £	898.461 USD	19/07/2021	UBS AG	1	3.182	0,02
642.905 £	884.663 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	3.522	0,02
33.553 USD	24.195 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	6	128	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					91.462	0,53

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	15.168.205	88,32

Neuberger Berman Global Equity Index Putwrite Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,80%) (31 de diciembre de 2020: (1,50%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases CHF con cobertura						
816.722 CHF	890.112 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	11	(6.140)	(0,03)
693.991 CHF	754.366 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(3.231)	(0,02)
702.088 CHF	762.994 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	5	(3.094)	(0,02)
Clases EUR con cobertura						
3.248.919 €	3.896.970 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	9	(42.692)	(0,25)
3.096.447 €	3.710.995 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(37.597)	(0,22)
3.082.544 €	3.692.307 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	8	(35.402)	(0,20)
Clases GBP con cobertura						
842 £	1.173 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(10)	(0,00)
743 £	1.043 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(16)	(0,00)
3.234 £	4.555 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	8	(86)	(0,00)
863.092 USD	627.016 £	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(3.143)	(0,02)
863.178 USD	627.016 £	19/07/2021	UBS AG	1	(3.057)	(0,02)
849.922 USD	617.658 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(3.384)	(0,02)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					(137.852)	(0,80)

Contratos de opciones sobre índices suscritos (1,20%) (31 de diciembre de 2020: (1,03%))

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de venta					
(1)	09/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,210	6.209	(605)	(0,01)
(2)	02/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,220	11.358	(180)	(0,00)
(2)	09/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,230	9.904	(1.530)	(0,01)
(2)	09/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,240	11.276	(1.740)	(0,01)
(3)	23/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,265	15.564	(10.080)	(0,06)
(2)	23/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,275	9.883	(7.230)	(0,04)
(3)	30/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,295	16.867	(15.960)	(0,09)
(6)	23/07/2021	MSCI EAFE Index, Strike Price \$2,340	15.768	(21.390)	(0,13)
(6)	07/07/2021	MSCI EAFE Index, Strike Price \$2,350	14.247	(22.920)	(0,13)
(2)	09/07/2021	MSCI EAFE Index, Strike Price \$2,360	5.469	(10.360)	(0,06)
(4)	09/07/2021	MSCI EAFE Index, Strike Price \$2,370	12.573	(24.420)	(0,14)
(4)	16/07/2021	MSCI EAFE Index, Strike Price \$2,370	11.706	(24.600)	(0,14)
(4)	16/07/2021	MSCI EAFE Index, Strike Price \$2,380	11.411	(28.560)	(0,17)
(1)	16/07/2021	MSCI Emerging Markets Index, Strike Price \$1,340	1.729	(560)	(0,00)
(2)	16/07/2021	MSCI Emerging Markets Index, Strike Price \$1,350	4.513	(1.510)	(0,01)
(1)	02/07/2021	MSCI Emerging Markets Index, Strike Price \$1,370	1.544	(333)	(0,00)

Neuberger Berman Global Equity Index Putwrite Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de opciones sobre índices suscritos (1,20%) (31 de diciembre de 2020: (1,03%)) (cont.)

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de venta (cont.)					
(4)	09/07/2021	MSCI Emerging Markets Index, Strike Price \$1,370	7.710	(7.260)	(0,04)
(1)	16/07/2021	MSCI Emerging Markets Index, Strike Price \$1,370	2.384	(1.420)	(0,01)
(1)	02/07/2021	MSCI Emerging Markets Index, Strike Price \$1,375	2.655	(437)	(0,00)
(4)	23/07/2021	MSCI Emerging Markets Index, Strike Price \$1,375	8.394	(8.420)	(0,05)
(1)	09/07/2021	MSCI Emerging Markets Index, Strike Price \$1,380	1.988	(1.370)	(0,01)
(1)	16/07/2021	MSCI Emerging Markets Index, Strike Price \$1,380	2.429	(2.025)	(0,01)
(3)	07/07/2021	MSCI Emerging Markets Index, Strike Price \$1,390	7.468	(6.225)	(0,04)
(4)	16/07/2021	S&P 500 Index, Strike Price \$4,180	25.272	(4.800)	(0,03)
(1)	16/07/2021	S&P 500 Index, Strike Price \$4,220	5.859	(1.595)	(0,01)
Total valor razonable en contratos de opciones sobre índices suscritos ±				(205.530)	(1,20)

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(343.382)	(2,00)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	14.824.823	86,32
Otro activo neto	2.348.729	13,68
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	17.173.552	100,00

Análisis de la cartera	USD	% de los Total neto
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	15.076.743	85,52
± Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	(205.530)	(1,17)
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(46.390)	(0,26)
Total inversiones	14.824.823	84,09

Neuberger Berman Global Equity Index Putwrite Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

Total compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
700.000	United States Treasury Note/Bond, 1.63%, 15/12/2022	715.805
400.000	United States Treasury Note/Bond, 1.50%, 15/09/2022	408.172

Total ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
2.600.000	United States Treasury Note/Bond, 2.63%, 15/12/2021	2.647.696
2.000.000	United States Treasury Note/Bond, 2.75%, 15/09/2021	2.027.578
2.000.000	United States Treasury Note/Bond, 2.38%, 15/03/2021	2.004.922
1.400.000	United States Treasury Note/Bond, 2.63%, 15/06/2021	1.408.477
1.000.000	United States Treasury Note/Bond, 2.38%, 15/03/2022	1.026.992

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al -1,98%. Durante el mismo período, el índice de referencia de la Cartera, ICE BofA US Dollar 3-month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) (el "Índice"), rindió un 0,11%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

El periodo semestral analizado se caracterizó por un entorno de negociación arduo para dos asignaciones concretas de la estrategia: Valor relativo de la volatilidad y Neutral al mercado de renta variable, mientras que la estrategia "Seguimiento de tendencias" también arrojó pérdidas durante el periodo. Esto quedó parcialmente contrarrestado por las ganancias que generaron las asignaciones de la estrategia a Arbitraje estadístico, Global macro y Negociación a corto plazo. El año arrancó con pérdidas en enero, pero los resultados positivos logrados en febrero hicieron que la Cartera volviera a situarse casi a nivel plano en el trimestre. El segundo trimestre fue más flojo en términos de rentabilidad, ante las pérdidas que arrojaron las asignaciones a Seguimiento de tendencias, Valor relativo de la volatilidad, Negociación a corto plazo y Global Macro, contrarrestados por las ganancias de las asignaciones a Neutral al mercado de renta variable y Arbitraje estadístico.

Durante el primer trimestre la Cartera rindió un -0,27%, registrando un patrón de pérdidas desde enero que lograron compensarse en su mayoría en febrero y marzo. Arbitraje estadístico, Negociación a corto plazo y Global macro se anotaron buenos trimestres con aportaciones positivas más o menos en igual proporción, aunque Seguimiento de tendencias aportó rendimientos más modestos. Por lo tanto, los responsables de las pérdidas fueron Valor relativo de la volatilidad y Neutral al mercado de renta variable, dos estrategias que se vieron bastante acuciadas en el trimestre a tenor de los niveles históricos. El posicionamiento en divisas y renta fija fueron las áreas de negociación con resultados positivos en el trimestre, siendo el origen de las pérdidas la negociación de renta variable. En el conjunto del primer trimestre, especialmente en marzo, la renta variable continuó su trayectoria alcista, aunque los niveles constantemente altos de volatilidad de estilos y factores crearon flujos cruzados inestables en las estrategias de selección de valores. La renta variable se apreció con fuerza, al generar el MSCI World una rentabilidad del 4% en el mes y un 5,7% en el conjunto del trimestre, reflejando las ganancias logradas en todos los principales mercados. Estos avances vinieron sustentados por la continua pujanza de los datos económicos y los bajos tipos de interés, aunque vimos un aumento de los rendimientos a más largo plazo que produjo un pronunciamiento de la curva, sobre todo en Estados Unidos, especialmente en febrero. Por consiguiente, los rendimientos de los bonos soberanos en mercados desarrollados se ampliaron en el transcurso del trimestre, aunque en marzo asistimos a un movimiento de diferenciales mucho más discreto que en febrero. Las divisas en general perdieron valor frente al dólar estadounidense, dado que el US Dollar Index ("DXY"), índice que mide el valor del dólar con respecto a una cesta de divisas extranjeras, se apreció un 2,6% en el mes y un 3,7% en el trimestre. La volatilidad de la renta variable se redujo en el trimestre al aumentar la confianza de los inversores sobre las perspectivas económicas y seguir remitiendo el halo de temor creado desde el primer trimestre de 2020.

En el segundo trimestre, la Cartera arrojó una rentabilidad del -1,71%. Seguimiento de tendencias fue el principal lastre de los resultados, seguido de Valor relativo de la volatilidad, con pérdidas de menor relieve procedentes de Negociación a corto plazo y Global Macro. Las ganancias procedieron de Arbitraje estadístico y Neutral al mercado de renta variable. La negociación de divisas fue lo que más mermó los resultados, seguido de la renta fija, mientras que la negociación de renta variable resultó favorable en índices y valores pero negativa en opciones. Junio resultó ser otro mes sólido para la renta variable (el S&P se apreció un 2,2% y el MSCI World un 2,2%), y en el conjunto del trimestre asistimos a una continuación del potente ciclo bursátil alcista que viene dominando los mercados desde finales de marzo del año pasado. Al cierre del trimestre, la renta variable mundial se había apreciado un 7,1% (medido por el MSCI World Index), la renta variable estadounidense un 8,2% (S&P 500), Europa un 5,4% (MSCI Europe) y Asia un 2,2% (MSCI Asia Pacific). La tónica general vino marcada por unos datos económicos alentadores especialmente de Estados Unidos, al tiempo que los bancos centrales continuaron impartiendo el discurso más expansivo posible para mantener la calma en los mercados. La Reserva Federal estadounidense (la "Fed") dio un pequeño susto en junio tras publicar un informe actualizado que revelaba dos subidas de tipos previstas en 2023, lo que hizo que los mercados de bonos se tambalearan un primer momento. Sin embargo, esta situación no duró mucho, ya que los bancos centrales mantuvieron una previsión sumamente cauta tanto en Estados Unidos como en Europa. En este contexto, los rendimientos del Tesoro estadounidense a 10 años se estrecharon al cierre del trimestre hasta el 1,47%, mientras que el tramo corto de la curva se amplió al aumentar el rendimiento a 2 años hasta el 0,25% frente al 0,16% registrado a comienzos del trimestre y el 0,14% a comienzos de junio. Entre tanto, los rendimientos en Reino Unido y Europa experimentaron finalmente pocas variaciones en términos relativos durante el mes y el trimestre en general. El dólar estadounidense se depreció a principios del trimestre al huir los flujos de EE. UU. debido a la pujanza de las materias primas y al apetito por el riesgo; no obstante, el panorama cambió tras la previsión actualizada de la Fed en junio, que provocó una brusca reacción del dólar ante la posibilidad de que los tipos aumenten más pronto de lo esperado en un principio. Así las cosas, el dólar estadounidense se revalorizó en el mes frente a divisas como el euro (3%), la libra esterlina (2,7%) y el dólar australiano (3,1%), aunque en el conjunto del trimestre tuvo un comportamiento dispar, al depreciarse frente al euro (-1,1%), apreciarse modestamente frente a la libra (0,3%) y apreciarse frente al dólar australiano (1,3%). La volatilidad continuó disminuyendo en junio y en el conjunto del trimestre hasta marcar nuevos mínimos del año.

Junio cerró de manera favorable un difícil primer semestre del año en el cual los activos de riesgo, por lo general, prosiguieron su recorrido alcista. Desde el mínimo marcado el pasado marzo, el S&P 500 Total Return Index ha repuntado un 96,1% y el MSCI World Index un 88,3%, mientras que el CBOE S&P 500 Volatility Index ("VIX"), un índice representativo de la volatilidad de las acciones, ha caído un -74,3%, situándose a mínimos previos a la crisis. Para cualquier cartera que busque rentabilidades no correlacionadas y cierta opcionalidad si surgen acontecimientos negativos, esto ha creado sin duda algunos retos. Consideramos poco probable que los próximos 15 meses se parezcan a estos últimos. Aunque no estamos satisfechos con la rentabilidad lograda en el año hasta la fecha, estamos viendo algunos indicios positivos que, en nuestra opinión, son un buen presagio para tener mejores resultados de aquí en adelante.

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Informe del Gestor de inversiones (cont.)

En primer lugar, la estrategia Neutral al mercado de renta variable ("EMN") se ha estabilizado y ha vuelto a generar un alfa positivo; volatilidad de factores ha retrocedido y las correlaciones entre los precios de las acciones y los beneficios han mejorado tras tocar fondo a comienzos del año. Cuando las posiciones han sido convincentes, normalmente se han mantenido en la cartera de EMN a pesar de las pérdidas derivadas del ajuste al mercado; mientras, la exposición bruta se encuentra a niveles que pueden ampliarse si las condiciones siguen mejorando. En consecuencia, creemos que existe potencial para ver una reversión a la media en esta parte de la cartera después de un duro primer semestre, y es posible que los gestores añadan riesgo si las cosas comienzan a funcionar bien. AB Arya ha funcionado bien desde que se incorporó en el tercer trimestre del año pasado y creemos que la combinación de Sandbar y AB Arya ofrece un mecanismo de acceso de alta calidad y sumamente diversificado a un conjunto de oportunidades de selección de acciones verdaderamente global.

En segundo lugar, pensamos que la negociación de volatilidad (una fuente de malos rendimientos en lo que va de año) arrojará mejores oportunidades en el segundo semestre. Desde su incorporación a principios de este año, Portman Square ha ido creando pacientemente exposiciones en diversas áreas como arbitraje de bonos convertibles y dispersión. Los precios de los bonos convertibles han sido bastante baratos debido al volumen récord de emisiones registrado en el año hasta la fecha, lo cual ha creado la posibilidad de comprar volatilidad implícita con vencimiento lejano en acciones de crecimiento a precios que nos parecen atractivos. Análogamente, la negociación de dispersiones entre opciones sobre acciones individuales y opciones sobre índices ha producido puntos de entrada a niveles convincentes en el transcurso del segundo trimestre que nos ha permitido crear diversas posiciones interesantes con potencial, a nuestro juicio, de generar ganancias en los próximos 6-12 meses. Por último, dado que los niveles de volatilidad han regresado a mínimos previos a la crisis y la renta variable ha vuelto a marcar máximos históricos, creemos que existe más valor potencial en negociación de volatilidad sobre índices para la asignación de True Partner con convexidad positiva a sorpresas y menos riesgo de pérdida proporcional derivado de nuevos descensos de la volatilidad implícita. En nuestra opinión, este segmento (ahora que se ha creado) cuenta con dos gestores complementarios que acceden a una amplia gama de operaciones en sus respectivas áreas de especialidad.

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		1.287.055.333	1.221.696.201
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	676.515.823	431.937.961
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		642.160.001	28.445.207
Cuentas a percibir por acciones emitidas		21.403.274	4.128.409
Cuentas por cobrar de intermediarios		315.750.596	287.815.875
Ingresos a percibir y otros activos		16.066.905	3.085.795
Activos totales		2.958.951.932	1.977.109.448
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		134.587.217	134.435.677
Descubierto bancario	3	267.821	2.559
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		2.929.249	453.654
Adeudado a los intermediarios		3.486.902	41.891.528
Gastos devengados		1.635.973	1.253.376
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		603.083.978	5.035.273
Otras cuentas por pagar		20.283.015	24.975.271
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		766.274.155	208.047.338
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		2.192.677.777	1.769.062.110

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		5.959.286	311.949
Ingresos por dividendos		–	13.947
Ingresos varios		359.632	668.003
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(14.656.062)	38.059.462
		(8.337.144)	39.053.361
Gastos			
Comisión de gestión	5	6.815.298	4.106.662
Comisión de distribución	5	121.847	138.870
Comisión de administración	5	1.261.768	1.128.420
Comisión de compromiso	16	128.374	52.685
Comisión de depósito	5	87.981	70.125
Comisión del Depositario	5	98.460	61.063
Honorarios profesionales	7	117.612	65.194
Honorarios de los Consejeros	6	2.412	2.376
Comisión de rentabilidad	5	8.061.226	23.158.366
Costes de transacciones	7	6.289.953	4.439.901
Honorarios de auditoría	7	11.050	11.021
Reembolso de IVA		(8.466)	(4.380)
Otros gastos	7	2.041.752	281.825
Gastos no asumidos	5	–	(199.814)
Gastos totales		25.029.267	33.312.314
Costes financieros			
Gastos por intereses		46.333	8.041
		46.333	8.041
Impuestos retenidos en origen		2.395.812	1.832.849
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		(35.808.556)	3.900.157

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	1.769.062.110	1.195.308.356
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	(35.808.556)	3.900.157
Suscripciones	676.984.129	452.131.264
Reembolsos	(217.559.906)	(218.356.333)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	2.192.677.777	1.432.983.444

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

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 Tesoro 39,22% (31 de diciembre de 2020: 51,15%)					
Dólar estadounidense					
95.000.000	United States Cash Management Bill	0,00%	26/10/2021	94.986.106	4,33
80.000.000	United States Treasury Bill	0,00%	20/07/2021	79.998.100	3,65
100.000.000	United States Treasury Bill	0,00%	03/08/2021	99.996.168	4,56
70.000.000	United States Treasury Bill	0,00%	05/08/2021	69.997.153	3,19
80.000.000	United States Treasury Bill	0,00%	24/08/2021	79.995.200	3,65
70.000.000	United States Treasury Bill	0,00%	02/09/2021	69.994.181	3,19
90.000.000	United States Treasury Bill	0,00%	30/09/2021	89.989.194	4,11
85.000.000	United States Treasury Bill	0,00%	14/10/2021	84.989.463	3,88
70.000.000	United States Treasury Bill	0,00%	21/10/2021	69.990.745	3,19
120.000.000	United States Treasury Bill	0,00%	02/12/2021	119.976.044	5,47
Total bonos del Tesoro **				859.912.354	39,22
Bonos de empresa 11,04% (31 de diciembre de 2020: 5,44%)					
Euro					
5.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA*	5,88%	29/12/2049	6.403.860	0,29
5.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA*	6,00%	29/12/2049	6.772.070	0,31
2.400.000	Prysmian SpA*	0,00%	02/02/2026	2.883.900	0,13
10.000.000	UniCredit SpA**	6,63%	29/12/2049	12.758.031	0,58
7.000.000	UniCredit SpA*	9,25%	29/12/2049	8.882.822	0,41
Total euro				37.700.683	1,72
Libra esterlina					
7.500.000	Lloyds Banking Group Plc*	7,63%	29/12/2049	11.332.207	0,52
Total libra esterlina				11.332.207	0,52
Dólar estadounidense					
4.000.000	2001 Cat Re Ltd**	12,04%	08/01/2024	4.153.400	0,19
2.000.000	Alamo Re II Pte Ltd*	5,79%	08/06/2023	2.082.100	0,09
3.000.000	Atlas Capital Reinsurance 2020 DAC**	8,29%	10/06/2024	3.151.650	0,14
2.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA*	6,13%	29/12/2049	2.165.000	0,10
2.000.000	Blue Halo Re Ltd**	13,29%	28/06/2023	2.089.600	0,09
1.150.000	Bonanza Re Ltd**	4,79%	23/12/2024	1.160.292	0,05
4.150.000	Cape Lookout Re Ltd**	3,29%	22/03/2024	4.162.450	0,19
1.500.000	Cosaint Re Pte Ltd**	9,29%	03/04/2024	1.530.750	0,07
15.200.000	Credit Agricole SA*	7,88%	29/12/2049	17.214.046	0,78
6.000.000	Credit Suisse Group AG*	7,50%	29/12/2049	6.540.000	0,30
5.000.000	Easton Re Pte Ltd*	4,04%	08/01/2024	5.044.250	0,23

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

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 11,04% (31 de diciembre de 2020: 5,44%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
2.750.000	Everglades Re II Ltd [†]	5,79%	14/05/2024	2.757.700	0,13
1.000.000	First Coast Re III Pte Ltd ^{**}	6,04%	07/04/2025	1.002.050	0,05
1.500.000	FloodSmart Re Ltd ^{**}	13,04%	01/03/2024	1.491.750	0,07
2.000.000	Herbie Re Ltd [†]	6,29%	08/01/2025	2.114.400	0,10
3.000.000	Herbie Re Ltd ^{**}	9,04%	08/07/2024	3.077.700	0,14
2.000.000	Herbie Re Ltd ^{**}	9,04%	08/01/2025	2.103.300	0,10
1.500.000	Herbie Re Ltd [†]	17,25%	06/06/2025	1.502.250	0,07
14.300.000	Intesa Sanpaolo SpA ^{**}	7,70%	29/12/2049	16.418.116	0,75
3.000.000	Kendall Re Ltd ^{**}	4,04%	02/05/2024	3.015.000	0,14
3.000.000	Kilimanjaro III Re Ltd [†]	4,29%	21/04/2025	3.042.900	0,14
2.900.000	Kilimanjaro III Re Ltd [†]	4,29%	20/04/2026	2.944.950	0,13
3.000.000	Matterhorn Re Ltd ^{**}	5,59%	07/12/2022	3.013.050	0,14
3.000.000	MetroCat Re Ltd ^{**}	5,54%	08/05/2023	3.034.800	0,14
3.000.000	Mona Lisa Re Ltd [†]	7,54%	09/01/2023	3.024.450	0,14
4.000.000	Mystic Re IV Ltd [†]	9,04%	08/01/2024	4.096.200	0,19
3.500.000	Mystic Re IV Ltd ^{**}	5,54%	08/01/2025	3.512.775	0,16
14.800.000	Natwest Group Plc ^{**}	8,00%	29/12/2049	17.550.284	0,80
4.500.000	Northshore Re II Ltd [†]	5,79%	08/01/2024	4.635.000	0,21
1.500.000	Pelican IV Re Ltd ^{**}	5,29%	07/05/2024	1.505.100	0,07
3.000.000	Phoenician Re Ltd [†]	3,04%	14/12/2023	3.058.500	0,14
4.000.000	Residential Reinsurance 2021 Ltd [†]	2,54%	06/06/2025	4.008.000	0,18
3.935.000	Residential Reinsurance 2021 Ltd [†]	3,79%	06/06/2025	3.942.476	0,18
2.425.000	Residential Reinsurance 2021 Ltd [†]	5,29%	06/06/2025	2.430.335	0,11
1.500.000	Residential Reinsurance 2021 Ltd [†]	9,29%	06/06/2025	1.502.250	0,07
2.250.000	Sanders Re II Ltd [†]	5,54%	07/06/2023	2.279.363	0,10
3.750.000	Sanders RE II Ltd [†]	3,54%	07/04/2025	3.753.750	0,17
10.000.000	Standard Chartered Plc [†]	7,50%	29/12/2049	10.442.300	0,48
2.000.000	Stratosphere Re Ltd ^{**}	2,79%	07/02/2023	2.010.700	0,09
3.250.000	Sussex Capital UK Pcc Ltd ^{**}	7,79%	08/01/2025	3.337.263	0,15
3.500.000	Titania RE Ltd [†]	4,54%	21/06/2024	3.513.125	0,16
8.300.000	UBS Group AG [†]	6,88%	29/12/2049	9.471.794	0,43
9.344.000	UBS Group AG [†]	7,00%	29/12/2049	10.296.574	0,47
1.500.000	Ursa Re II Ltd ^{**}	3,79%	07/12/2023	1.559.400	0,07
2.250.000	Vista RE Ltd ^{**}	6,79%	21/05/2024	2.267.775	0,10
Total dólar estadounidense				193.008.918	8,80
Total bonos de empresa				242.041.808	11,04

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

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 del Estado 0,18% (31 de diciembre de 2020: 0,30%)					
Dólar estadounidense					
1.000.000	International Bank for Reconstruction & Development	6,54%	13/03/2024	1.024.750	0,04
3.000.000	International Bank for Reconstruction & Development	10,04%	13/03/2024	3.032.175	0,14
Total bonos del Estado *				4.056.925	0,18
Total inversiones				1.106.011.087	50,44

Contratos de divisas a plazo 0,73% (31 de diciembre de 2020: 5,24%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
1.050.000 AUD	87.384.780 ¥	15/09/2021	Citibank NA	1	703	0,00
2.532.270 AUD	1.375.000 £	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	1.746	0,00
4.120.000 BRL	807.439 USD	15/09/2021	BNP Paribas	3	6.123	0,00
116.940.000 BRL	22.986.427 USD	15/09/2021	Citibank NA	7	105.305	0,00
3.580.000 BRL	698.994 USD	15/09/2021	UBS AG	3	7.935	0,00
2.600.000 CAD	231.751.520 ¥	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	11.000	0,00
3.503.415 CAD	2.375.000 €	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	10.700	0,00
2.237.450 CHF	1.750.000 £	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	4.978	0,00
168.110.000 CLP	228.488 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	1.927	0,00
150.683.695 CLP	200.000 USD	22/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	6.833	0,00
73.579.847 CLP	100.000 USD	30/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	974	0,00
226.004.542 CLP	300.000 USD	19/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	10.249	0,00
73.125.903 CLP	100.000 USD	01/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	432	0,00
893.654.440 CLP	1.200.000 USD	26/07/2021	JPMorgan Chase Bank	7	26.512	0,00
452.045.084 CLP	600.000 USD	21/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	20.510	0,00
177.490.000 CLP	242.932 USD	15/09/2021	UBS AG	1	339	0,00
391.847.131 CNY	60.300.000 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	3	201.608	0,01
4.769.198 €	21.410.000 PLN	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	39.575	0,01
11.289.543 €	50.500.000 PLN	15/09/2021	Citibank NA	4	141.311	0,02
125.000 €	1.269.467 NOK	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	793	0,00
500.000 €	65.767.850 ¥	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	640	0,00
47.700.000 €	40.915.054 £	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	79.601	0,01
100.000 €	35.003.470 HUF	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	464	0,00
550.000 €	652.975 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	301	0,00
2.375.000 €	3.751.488 AUD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	3	1.585	0,00
1.500.000 €	2.203.347 CAD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	781	0,00
300.000 €	1.354.453 PLN	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	182	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,73% (31 de diciembre de 2020: 5,24%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
375.000 €	3.794.529 SEK	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.188	0,00
180.000 €	1.923.100 TRY	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	853	0,00
200.000 €	2.139.657 TRY	15/09/2021	UBS AG	1	629	0,00
294.912 €	1.330.000 PLN	15/09/2021	UBS AG	1	851	0,00
5.625.000 £	7.172.246 CHF	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	5.177	0,00
1.500.000 £	229.887.000 ¥	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	541	0,00
1.807.495 £	2.100.000 €	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	5.066	0,00
141.533.250 HUF	400.000 €	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	3.278	0,00
231.392.290 INR	3.100.000 USD	26/07/2021	JPMorgan Chase Bank	4	3.799	0,00
56.233 INR	756 USD	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	0	0,00
2.606.502.417 ¥	30.880.000 AUD	15/09/2021	Citibank NA	12	308.928	0,01
100.770.521 ¥	1.190.000 AUD	15/09/2021	Deutsche Bank AG	2	14.841	0,00
576.568.688 ¥	3.750.000 £	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	3	15.331	0,00
62.534.640 ¥	800.000 NZD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	4.618	0,00
36.474.041 ¥	430.000 AUD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	5.914	0,00
217.105.980 ¥	2.600.000 AUD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	4.365	0,00
2.165.599.460 ¥	16.400.000 €	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	3	54.827	0,01
233.958.920 ¥	2.600.000 CAD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	8.894	0,00
959.298.280 ¥	11.500.000 AUD	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	2	12.381	0,00
1.671.738.320 ¥	19.810.000 AUD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	8	194.814	0,02
945.139.976 ¥	11.170.000 AUD	15/09/2021	UBS AG	12	132.562	0,00
2.149.122.172 KRW	1.900.000 USD	26/07/2021	JPMorgan Chase Bank	3	1.763	0,00
906.315.912 KRW	800.000 USD	16/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	2.037	0,00
452.097.956 KRW	400.000 USD	28/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	59	0,00
255.111 KRW	226 USD	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1	0,00
226.595.478 KRW	200.000 USD	19/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	521	0,00
1.246.017.918 KRW	1.100.000 USD	21/07/2021	JPMorgan Chase Bank	4	2.629	0,00
453.485.822 KRW	400.000 USD	23/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	1.296	0,00
679.603.166 KRW	600.000 USD	22/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	1.393	0,00
42.500.000 MXN	2.096.167 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	29.590	0,00
129.460.000 MXN	6.395.895 USD	17/09/2021	Royal Bank of Scotland	2	41.986	0,00
5.400.000 MXN	268.363 USD	17/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	172	0,00
2.240.000 PLN	494.858 €	15/09/2021	Citibank NA	1	747	0,00
905.432 PLN	200.000 €	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	526	0,00
381.433 PLN	100.000 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	208	0,00
2.560.000 PLN	565.596 €	15/09/2021	UBS AG	1	801	0,00
117.959.680 RUB	1.600.000 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	7.343	0,00
1.271.264 SEK	125.000 €	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	355	0,00
3.487.611 SEK	3.500.000 NOK	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	1.134	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,73% (31 de diciembre de 2020: 5,24%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
672.868 SGD	500.000 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	3	529	0,00
15.312.582 TRY	1.420.000 €	15/09/2021	BNP Paribas	4	8.937	0,00
1.740.000 TRY	191.828 USD	15/09/2021	BNP Paribas	1	844	0,00
45.978.324 TRY	4.230.000 €	15/09/2021	Citibank NA	6	66.938	0,02
1.950.000 TRY	215.684 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	241	0,00
19.712.485 TRY	2.200.000 USD	18/08/2021	JPMorgan Chase Bank	7	13.710	0,00
19.063.411 TRY	1.750.000 €	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	2	32.304	0,01
15.436.634 TRY	1.420.000 €	15/09/2021	Société Générale	1	22.673	0,01
2.868.633 TRY	260.000 €	15/09/2021	UBS AG	1	8.825	0,00
1.960.000 TRY	216.638 USD	15/09/2021	UBS AG	1	394	0,00
95.189.564 TWD	3.400.000 USD	16/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	13.738	0,00
2.799.693 TWD	100.000 USD	19/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	430	0,00
5.591.586 TWD	200.000 USD	23/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	649	0,00
111.500.722 TWD	4.000.000 USD	26/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	2.129	0,00
5.584.484 TWD	200.000 USD	28/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	480	0,00
2.785.857 TWD	100.000 USD	02/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	54	0,00
514.163 USD	152.250.000 HUF	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	475	0,00
25.647.272 USD	34.430.000 SGD	15/09/2021	Barclays Bank Plc	2	38.382	0,00
15.470.690 USD	758.630.000 PHP	15/09/2021	Barclays Bank Plc	4	27.763	0,00
2.852.349 USD	2.620.000 CHF	15/09/2021	Barclays Bank Plc	6	12.126	0,00
270.775 USD	8.650.000 THB	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	969	0,00
1.791.858 USD	2.004.820.000 KRW	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	18.085	0,00
867.379 USD	730.000 €	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	303	0,00
2.605.883 USD	1.880.000 £	15/09/2021	BNP Paribas	3	8.314	0,00
5.525.901 USD	608.970.000 ¥	15/09/2021	BNP Paribas	12	35.578	0,00
523.417 USD	154.480.000 HUF	15/09/2021	BNP Paribas	1	2.205	0,00
5.276.696 USD	4.370.000 €	15/09/2021	BNP Paribas	5	86.116	0,01
1.433.454 USD	1.770.000 CAD	15/09/2021	BNP Paribas	3	4.107	0,00
4.854.039 USD	152.970.000 THB	15/09/2021	BNP Paribas	8	82.673	0,00
4.226.135 USD	5.530.000 AUD	15/09/2021	BNP Paribas	4	73.146	0,00
6.206.417 USD	304.310.000 PHP	15/09/2021	BNP Paribas	4	11.779	0,00
36.305.254 USD	2.720.210.000 INR	15/09/2021	BNP Paribas	15	51.013	0,00
1.967.068 USD	2.770.000 NZD	15/09/2021	BNP Paribas	3	31.973	0,00
2.320.830 USD	3.120.000 SGD	15/09/2021	BNP Paribas	1	187	0,00
14.017.649 USD	438.580.000 THB	15/09/2021	Citibank NA	1	337.674	0,02
304.698 USD	1.530.000 BRL	15/09/2021	Citibank NA	1	2.575	0,00
3.163.159 USD	26.290.000 SEK	15/09/2021	Citibank NA	1	86.890	0,01
1.681.761 USD	1.210.000 £	15/09/2021	Citibank NA	2	9.922	0,00
11.815.855 USD	883.970.000 INR	15/09/2021	Citibank NA	11	34.538	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,73% (31 de diciembre de 2020: 5,24%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
3.540.100 USD	4.970.000 NZD	15/09/2021	Citibank NA	5	68.109	0,00
1.891.867 USD	208.690.000 ¥	15/09/2021	Citibank NA	6	10.370	0,00
2.387.543 USD	2.665.480.000 KRW	15/09/2021	Citibank NA	2	29.248	0,00
3.249.613 USD	159.160.000 PHP	15/09/2021	Citibank NA	4	9.697	0,00
413.315 USD	3.700.000 TRY	15/09/2021	Citibank NA	1	3.611	0,00
14.409.390 USD	19.280.000 SGD	15/09/2021	Citibank NA	5	69.006	0,00
5.004.747 USD	6.580.000 AUD	15/09/2021	Citibank NA	9	63.214	0,00
1.762.062 USD	2.180.000 CAD	15/09/2021	Citibank NA	3	1.623	0,00
20.241.255 USD	75.870.000 PLN	15/09/2021	Citibank NA	11	307.532	0,02
1.483.698 USD	1.220.000 €	15/09/2021	Citibank NA	3	34.612	0,00
701.988 USD	509.980.000 CLP	15/09/2021	Citibank NA	1	3.000	0,00
1.772.563 USD	1.610.000 CHF	15/09/2021	Citibank NA	3	27.236	0,00
4.280.100 USD	60.960.000 ZAR	15/09/2021	Citibank NA	4	52.466	0,00
12.984.537 USD	10.710.000 €	15/09/2021	Deutsche Bank AG	5	263.462	0,02
7.615.583 USD	9.970.000 AUD	15/09/2021	Deutsche Bank AG	7	128.187	0,01
1.016.021 USD	8.630.000 SEK	15/09/2021	Deutsche Bank AG	2	6.200	0,00
11.305.191 USD	96.640.000 NOK	15/09/2021	Deutsche Bank AG	9	71.335	0,00
251.386 USD	18.820.000 INR	15/09/2021	Deutsche Bank AG	1	558	0,00
307.147 USD	380.000 CAD	15/09/2021	Deutsche Bank AG	1	282	0,00
64.437.303 USD	7.053.480.000 ¥	15/09/2021	Deutsche Bank AG	11	844.870	0,04
3.011.883 USD	4.280.000 NZD	15/09/2021	Deutsche Bank AG	4	21.919	0,00
358.337 USD	1.790.000 BRL	15/09/2021	Deutsche Bank AG	1	4.872	0,00
19.778.066 USD	18.050.000 CHF	15/09/2021	Deutsche Bank AG	10	210.884	0,00
39.311.910 USD	33.000.000 €	30/07/2021	Goldman Sachs International	1	153.972	0,01
12.456.810 USD	9.000.000 £	30/07/2021	Goldman Sachs International	1	22.745	0,00
2.600.000 USD	190.069.671 RUB	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	3	10.072	0,00
1.677.417 USD	33.700.000 MXN	17/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.559	0,00
100.000 USD	7.333.629 INR	15/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.496	0,00
378.627 USD	10.533.403 TWD	23/07/2021	JPMorgan Chase Bank	4	646	0,00
2.852.548 USD	40.480.000 ZAR	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	5	45.222	0,00
100.000 USD	847.862 NOK	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.454	0,00
600.000 USD	667.221.284 KRW	15/07/2021	JPMorgan Chase Bank	4	9.545	0,00
239.845 USD	1.980.000 NOK	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	9.681	0,00
773.918 USD	873.817.878 KRW	21/07/2021	JPMorgan Chase Bank	5	657	0,00
100.000 USD	2.756.812 TWD	19/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.108	0,00
800.000 USD	892.919.599 KRW	16/07/2021	JPMorgan Chase Bank	4	9.817	0,00
300.000 USD	335.253.417 KRW	19/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	3.323	0,00
100.000 USD	2.756.707 TWD	01/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.060	0,00
500.000 USD	556.666.538 KRW	12/07/2021	JPMorgan Chase Bank	4	7.373	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,73% (31 de diciembre de 2020: 5,24%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
2.196.338 USD	2.700.000 CAD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	15.958	0,00
11.874.080 USD	10.720.000 CHF	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	10	253.016	0,02
16.997.117 USD	15.625.000 CHF	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	4	78.191	0,00
3.500.000 USD	260.658.149 INR	28/07/2021	JPMorgan Chase Bank	5	4.504	0,00
1.334.556 USD	11.190.000 SEK	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	2	25.182	0,00
1.300.000 USD	1.747.112 SGD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	366	0,00
300.000 USD	217.531.890 CLP	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	1.237	0,00
18.601.127 USD	24.880.000 SGD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	6	95.486	0,00
300.000 USD	333.683.514 KRW	14/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	4.706	0,00
200.000 USD	5.518.245 TWD	09/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	2.221	0,00
2.200.000 USD	18.804.218 SEK	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	532	0,00
100.000 USD	2.751.507 TWD	15/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.332	0,00
3.400.000 USD	93.549.236 TWD	16/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	45.088	0,00
200.000 USD	5.526.056 TWD	08/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	1.902	0,00
3.300.000 USD	90.962.955 TWD	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	37.867	0,00
100.000 USD	2.750.443 TWD	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.285	0,00
3.100.000 USD	230.702.487 INR	26/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	5.454	0,00
3.500.000 USD	260.225.596 INR	22/07/2021	JPMorgan Chase Bank	12	7.722	0,00
100.000 USD	2.761.012 TWD	12/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.017	0,00
200.000 USD	14.890.031 INR	29/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	345	0,00
261.018 USD	2.340.000 TRY	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.908	0,00
100.000 USD	378.038 PLN	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	683	0,00
100.000 USD	71.894.153 CLP	07/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.272	0,00
300.000 USD	4.271.148 ZAR	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	2.137	0,00
1.538.955 USD	1.890.000 CAD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	3	12.705	0,00
700.000 USD	779.045.306 KRW	07/07/2021	JPMorgan Chase Bank	3	9.899	0,00
200.000 USD	58.790.760 HUF	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	1.459	0,00
41.780.754 USD	34.680.000 €	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	32	588.701	0,02
34.714.014 USD	29.125.000 €	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	3	150.599	0,01
1.100.000 USD	7.122.280 CNY	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	313	0,00
100.000 USD	7.304.886 INR	09/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.809	0,00
100.000 USD	7.342.129 INR	07/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.284	0,00
20.739.671 USD	14.937.500 £	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	5	102.377	0,00
2.400.000 USD	175.260.377 INR	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	43.309	0,00
100.330 USD	7.307.984 INR	01/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	2.011	0,00
100.000 USD	324.413 ILS	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	412	0,00
42.068.709 USD	30.210.000 £	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	21	328.005	0,00
300.000 USD	216.180.890 CLP	14/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	3.192	0,00
400.000 USD	288.396.587 CLP	12/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	4.020	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,73% (31 de diciembre de 2020: 5,24%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
300.000 USD	217.885.322 CLP	19/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	897	0,00
100.000 USD	71.895.153 CLP	09/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.276	0,00
100.000 USD	71.895.153 CLP	08/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.274	0,00
200.000 USD	145.178.305 CLP	15/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	682	0,00
338.078 USD	450.000 AUD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	131	0,00
300.000 USD	21.926.547 INR	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	5.011	0,00
13.921.636 USD	18.500.000 AUD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	3	30.485	0,00
3.100.000 USD	27.364.885 TRY	18/08/2021	JPMorgan Chase Bank	5	26.927	0,00
2.800.000 USD	205.742.573 INR	12/07/2021	JPMorgan Chase Bank	3	35.482	0,00
9.100.764 USD	1.003.710.000 ¥	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	23	51.566	0,00
59.206.441 USD	6.562.500.000 ¥	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	3	62.880	0,00
700.000 USD	779.778.249 KRW	01/07/2021	JPMorgan Chase Bank	3	7.571	0,00
200.000 USD	144.118.305 CLP	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	2.086	0,00
300.000 USD	333.738.494 KRW	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	3.646	0,00
2.100.000 USD	2.331.586.934 KRW	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	8	33.611	0,00
200.000 USD	14.897.531 INR	02/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	343	0,00
100.000 USD	111.041.261 KRW	09/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.732	0,00
1.894.627 USD	2.700.000 NZD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	8.118	0,00
100.000 USD	72.057.153 CLP	01/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.035	0,00
100.000 USD	111.642.472 KRW	08/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.152	0,00
1.001.393 USD	110.000.000 ¥	16/09/2021	Morgan Stanley	1	9.650	0,00
10.708.863 USD	13.000.000 CAD	16/09/2021	Morgan Stanley	2	210.836	0,02
8.248.532 USD	9.200.000.000 KRW	16/09/2021	Morgan Stanley	1	108.838	0,01
14.701.443 USD	12.100.000 €	16/09/2021	Morgan Stanley	1	329.036	0,02
7.383.373 USD	9.550.000 AUD	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	2	211.393	0,01
3.427.217 USD	166.950.000 PHP	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	1	28.726	0,00
4.834.108 USD	41.210.000 NOK	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	2	43.678	0,00
235.263 USD	17.610.000 INR	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	1	562	0,00
8.702.747 USD	6.240.000 £	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	2	81.033	0,00
24.593.194 USD	775.100.000 THB	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	4	416.650	0,02
10.113.462 USD	13.530.000 SGD	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	4	49.906	0,00
708.258 USD	500.000 £	15/09/2021	Société Générale	2	17.415	0,00
1.175.856 USD	57.580.000 PHP	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	3.738	0,00
10.662.420 USD	7.670.000 £	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	14	64.896	0,00
3.820.138 USD	5.040.000 AUD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	5	35.135	0,00
1.512.084 USD	1.688.750.000 KRW	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	17.955	0,00
263.848 USD	3.790.000 ZAR	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	1.008	0,00
1.473.036 USD	12.330.000 NOK	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	6	39.743	0,00
24.364.299 USD	20.190.000 €	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	17	383.116	0,02

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,73% (31 de diciembre de 2020: 5,24%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
5.950.460 USD	656.170.000 ¥	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	16	34.595	0,00
2.446.038 USD	3.470.000 NZD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	7	21.932	0,00
9.077.916 USD	8.280.000 CHF	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	6	101.946	0,00
1.549.447 USD	2.080.000 SGD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	2.351	0,00
9.336.208 USD	698.250.000 INR	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	7	30.116	0,00
468.651 USD	580.000 CAD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	278	0,00
671.967 USD	2.550.000 PLN	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	1.992	0,00
16.818.907 USD	143.470.000 SEK	15/09/2021	UBS AG	3	31.063	0,00
2.650.167 USD	2.220.000 €	15/09/2021	UBS AG	4	13.305	0,00
2.486.085 USD	2.806.440.000 KRW	15/09/2021	UBS AG	2	3.077	0,00
3.441.736 USD	4.560.000 AUD	15/09/2021	UBS AG	4	17.210	0,00
5.513.431 USD	46.920.000 NOK	15/09/2021	UBS AG	9	59.245	0,00
868.635 USD	630.130.000 CLP	15/09/2021	UBS AG	2	4.967	0,00
4.944.162 USD	242.390.000 PHP	15/09/2021	UBS AG	2	9.989	0,00
18.519.193 USD	16.720.000 CHF	15/09/2021	UBS AG	20	393.804	0,03
239.979 USD	340.000 NZD	15/09/2021	UBS AG	1	2.459	0,00
333.482 USD	240.000 £	15/09/2021	UBS AG	1	1.878	0,00
2.590.264 USD	194.170.000 INR	15/09/2021	UBS AG	2	2.418	0,00
8.808.546 USD	33.360.000 PLN	15/09/2021	UBS AG	6	43.698	0,00
1.435.087 USD	19.860.000 ZAR	15/09/2021	UBS AG	4	57.777	0,00
672.577 USD	3.400.000 BRL	15/09/2021	UBS AG	2	1.192	0,00
20.163.760 ZAR	1.400.000 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	6.189	0,00
3.890.000 ZAR	269.244 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	531	0,00
8.920.000 ZAR	616.167 USD	15/09/2021	UBS AG	2	2.443	0,00
Clases CHF con cobertura						
549.478 USD	505.485 CHF	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	2.371	0,00
616.701 USD	566.632 CHF	19/07/2021	UBS AG	3	3.412	0,00
623.508 USD	573.081 CHF	19/07/2021	Westpac Banking Corp	7	3.239	0,00
Clases EUR con cobertura						
348.760 €	413.723 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	20	0,00
4.709.424 USD	3.883.194 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	102.687	0,01
1.804.175 USD	1.505.769 €	19/07/2021	UBS AG	1	17.841	0,00
12.843.729 USD	10.605.657 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	29	261.952	0,01
Clases GBP con cobertura						
317.233.139 £	436.673.637 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	1.589.931	0,07
317.233.139 £	436.716.780 USD	19/07/2021	UBS AG	2	1.546.787	0,07
342.195.507 £	470.813.413 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	13	1.936.139	0,09
20.772.976 USD	14.825.369 £	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	291.449	0,01

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,73% (31 de diciembre de 2020: 5,24%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases GBP con cobertura (cont.)						
15.677.028 USD	11.248.380 £	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	137.179	0,01
8.120.910 USD	5.770.169 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	29	149.314	0,01
Clases SGD con cobertura						
340 USD	452 SGD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	4	0,00
4.812 USD	6.388 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	5	59	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					16.251.780	0,73

Contratos de futuros 1,94% (31 de diciembre de 2020: 0,61%)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(251)	1 Month SOFR Future August 2021	5.875	0,00
(706)	1 Month SOFR Future July 2021	22.338	0,00
1	10-Year Mini Japanese Government Bond Future September 2021	3	0,00
(50)	3-Month Euro Euribor Future September 2023	2.965	0,00
(582)	3-Month Euro Euribor Future June 2022	2.609	0,00
(3)	3-Month Euro Euribor Future March 2022	89	0,00
(407)	3-Month Euro Euribor Future September 2021	0	0,00
(200)	3-Month Euro Euribor Future December 2021	6.098	0,00
(1.000)	3-Month Euro Euribor 2yr Mid-Curve Future September 2021	21.609	0,00
2.800	90-Day Eurodollar Future December 2024	420.044	0,02
(1.721)	90-Day Eurodollar Future December 2023	75.000	0,00
(2.331)	90-Day Eurodollar Future June 2023	21.300	0,00
(374)	90-Day Eurodollar Future September 2021	21.037	0,00
350	90-Day Eurodollar Future December 2022	17.500	0,00
(1.749)	90-Day Sterling Future September 2022	114.704	0,01
(2.345)	90-Day Sterling Future March 2022	28.389	0,00
1.400	90-Day Sterling Future July 2021	24.175	0,00
(66)	90-Day Sterling Future June 2022	11.204	0,00
(529)	90-Day Sterling Future September 2021	9.135	0,00
(22)	90-Day Sterling Future December 2022	5.008	0,00
78	Amsterdam Index Future July 2021	59.103	0,00
(5.026)	Australian Dollar Currency Future September 2021	12.365.933	0,56
58	Australian Government Bond 10-Year Future September 2021	43.333	0,00
(1.575)	Bankers Acceptance Future June 2022	65.998	0,00
(153)	Bankers Acceptance Future December 2022	36.582	0,00
(150)	Bankers Acceptance Future September 2022	34.069	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de futuros 1,94% (31 de diciembre de 2020: 0,61%) (cont.)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(253)	Bankers Acceptance Future December 2021	6.592	0,00
(257)	Bankers Acceptance Future March 2022	6.016	0,00
(176)	Bankers Acceptance Future September 2021	71	0,00
(2.436)	British Pound Currency Future September 2021	1.382.072	0,06
(64)	CAC40 Index Future July 2021	23.095	0,00
31	Canadian 10-Year Bond Future September 2021	20.617	0,00
(646)	Canadian Dollar Currency Future September 2021	1.355.436	0,06
(582)	CBOE VIX Index Future July 2021	496.839	0,02
(839)	CBOE VIX Index Future August 2021	373.111	0,02
(213)	CBOE VIX Index Future September 2021	228.688	0,01
(143)	CBOE VIX Index Future October 2021	11.741	0,00
192	DAX Index Future September 2021	18.589	0,00
58	DJIA Mini E-CBOT Future September 2021	185.020	0,01
15	Dollar Index Future September 2021	3.835	0,00
1	E-mini Energy Future September 2021	30	0,00
(1)	E-mini Euro Future September 2021	156	0,00
1	E-mini Health Care Future September 2021	1.160	0,00
1	E-mini Industrial Future September 2021	10	0,00
1	E-mini Materials Future September 2021	1.730	0,00
164	E-mini Russell 2000 Index Future September 2021	25.205	0,00
(1)	E-Mini S&P Real Estate Future September 2021	25	0,00
(4)	Euro Currency Future September 2021	493	0,00
(5.181)	Euro FX Currency Future September 2021	15.912.922	0,72
(344)	Euro Stoxx 50 Future September 2021	49.984	0,00
41	Euro-BOBL Future September 2021	3.143	0,00
211	Euro-BTP Future September 2021	146.684	0,01
3.621	Euro-Bund Future September 2021	926.793	0,04
70	Euro-Bund Future September 2021	2.425	0,00
(142)	Euro-Bund Future August 2021	11.939	0,00
(142)	Euro-Bund Future August 2021	29.853	0,00
32	Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2021	13.970	0,00
72	Euro-OAT Future September 2021	5.028	0,00
2.123	Euro-Schatz Future August 2021	11.326	0,02
(4.200)	Euro-Schatz Future September 2021	20.969	0,00
(2.100)	Euro-Schatz Future September 2021	22.936	0,00
22	FTSE/JSE Top 40 Index Future September 2021	5.419	0,00
(8)	FTSE/MIB Index Future September 2021	739	0,00
(3)	FTSE/MIB Index Future September 2021	581	0,00
(8)	GXU1 Future December 2049	13.379	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de futuros 1,94% (31 de diciembre de 2020: 0,61%) (cont.)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(41)	Hang Seng China Enterprises Index Future July 2021	23.281	0,00
(6)	IBEX 35 Index Future July 2021	8.161	0,00
(7)	Indian Rupee Currency Future July 2021	164	0,00
(21)	Japan Government 10-Year Bond (OSE) Future September 2021	6.847	0,00
(1.908)	Japanese Yen Currency Future September 2021	1.841.370	0,09
92	KOSPI 200 Index Future September 2021	2.475	0,00
311	KOSPI 200 Mini Future July 2021	156.766	0,01
(414)	Mexican Peso Currency Future September 2021	134.550	0,01
251	MSCI Emerging Markets Index Future September 2021	11.290	0,00
344	MSCI Singapore Index Future July 2021	24.751	0,00
387	Nasdaq 100 E-mini Future September 2021	1.645.130	0,08
(36)	New Zealand Dollar Currency Future September 2021	77.400	0,01
11	Nikkei 225 (CME) Future September 2021	12.950	0,00
(10)	Nikkei 225 (OSE) Future September 2021	32.435	0,00
(434)	Nikkei 225 Mini Future July 2021	62.681	0,00
17	Norwegian Krone Currency Future September 2021	73.125	0,00
1	S&P 500 Consumer Staples Index September 2021	220	0,00
484	S&P 500 E-mini Future September 2021	62.537	0,00
(11)	S&P E-mini S&P MidCap 400 Future September 2021	2.840	0,00
158	S&P/TSX 60 Index Future September 2021	42.326	0,00
251	SGX FTSE Taiwan Future July 2021	197.150	0,01
(7)	SGX Nifty 50 Future July 2021	902	0,00
57	Short-Term Euro-BTP Future September 2021	534	0,00
(288)	South African Rand Currency (CME) Future September 2021	507.862	0,02
(558)	SPI 200 Index Future September 2021	583.276	0,03
(16)	STOXX Europe 600 Index Future September 2021	486	0,00
(3)	STOXX Europe 600 Insurance Future September 2021	77	0,00
(2)	STOXX Europe 600 Utilities September 2021	59	0,00
69	Swedish Krona Currency Future September 2021	252.452	0,01
(188)	Swiss Franc Currency Future September 2021	356.411	0,02
17	Swiss Market Index Future September 2021	1.807	0,00
13	TAIEX Future July 2021	3.613	0,00
(13)	TOPIX Index Future September 2021	26.764	0,00
815	United Kingdom Long Gilt Future September 2021	375.324	0,02
(6)	United States Dollar/Chinese Yuan Renminbi Currency Future September 2021	186	0,00
487	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2021	346.484	0,02
18	US Treasury 10-Year Ultra Future September 2021	5.406	0,00
833	US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2021	518.605	0,03
12	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2021	14.000	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de futuros 1,94% (31 de diciembre de 2020: 0,61%) (cont.)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
432	Yen Denominated Nikkei Future September 2021	404.849	0,02
(20)	Yen Denominated Nikkei Future September 2021	22.645	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de futuros [±]		42.572.912	1,94

Contratos de opciones sobre índices adquiridos 0,66% (31 de diciembre de 2020: 1,39%)

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de compra					
254	20/08/2021	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,050 [±]	(276.612)	276.217	0,01
487	16/07/2021	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,075 [±]	(242.938)	242.564	0,01
420	16/07/2021	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,100 [±]	(174.894)	143.446	0,01
84	20/08/2021	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,100 [±]	(63.015)	62.359	0,00
214	16/07/2021	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,125 [±]	(130.867)	47.204	0,00
126	16/07/2021	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,150 [±]	(59.900)	17.184	0,00
83	16/07/2021	FTSE 100 Index, Strike Price GBP7,100 [±]	(134.163)	57.330	0,00
71	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW428 [±]	(125.552)	182.835	0,01
141	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW430 [±]	(217.523)	297.363	0,01
131	09/12/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW430 [±]	(588.609)	561.271	0,03
131	09/12/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW440 [±]	(486.508)	430.404	0,02
49	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW443 [±]	(53.003)	17.840	0,00
131	09/12/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW443 [±]	(493.951)	399.869	0,02
178	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW445 [±]	(121.122)	38.330	0,00
330	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW448 [±]	(173.066)	40.292	0,00
219	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW450 [±]	(87.515)	14.099	0,00
34	12/08/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW450 [±]	(33.630)	25.889	0,00
393	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW453 [±]	(68.655)	13.087	0,00
91	12/08/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW453 [±]	(77.584)	55.554	0,00
151	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW455 [±]	(48.100)	2.682	0,00
137	12/08/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW455 [±]	(96.550)	66.909	0,00
66	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW458 [±]	(24.288)	586	0,00
78	12/08/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW458 [±]	(44.981)	30.822	0,00
154	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW460 [±]	(45.057)	1.026	0,00
68	12/08/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW460 [±]	(32.789)	21.134	0,00
310	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW463 [±]	(76.446)	688	0,00
79	12/08/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW463 [±]	(31.946)	19.291	0,00
220	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW465 [±]	(45.246)	488	0,00
68	12/08/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW465 [±]	(21.925)	13.284	0,00
47	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW468 [±]	(7.845)	104	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de opciones sobre índices adquiridos 0,66% (31 de diciembre de 2020: 1,39%) (cont.)

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de compra (cont.)					
17	12/08/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW468 [±]	(4.567)	2.566	0,00
9	12/08/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW470 [±]	(1.857)	1.039	0,00
3	09/12/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW485 [±]	(2.182)	2.484	0,00
50	16/07/2021	NASD 100 E-mini, Strike Price \$13,700 [±]	(396.699)	879.750	0,04
12	16/07/2021	NASD 100 E-mini, Strike Price \$14,500 [±]	(38.050)	50.040	0,00
84	16/07/2021	NASD 100 E-mini, Strike Price \$14,600 [±]	(270.013)	256.200	0,01
7	09/07/2021	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY29,000 [±]	(21.235)	9.145	0,00
62	09/07/2021	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY29,125 [±]	(157.047)	58.654	0,00
65	09/07/2021	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY29,250 [±]	(332.836)	41.580	0,00
128	09/07/2021	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY29,375 [±]	(628.937)	56.510	0,00
95	09/07/2021	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY29,500 [±]	(427.324)	29.102	0,00
42	13/08/2021	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY32,250 [±]	(309.268)	3.027	0,00
8	13/08/2021	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY33,000 [±]	(34.845)	288	0,00
15	10/09/2021	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY33,250 [±]	(28.288)	1.892	0,00
28	16/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,070 [±]	(176.853)	315.350	0,02
408	16/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,220 [±]	(1.061.841)	1.769.700	0,07
112	16/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,240 [±]	(324.949)	392.000	0,02
17	16/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,270 [±]	(32.740)	39.950	0,00
84	02/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,280 [±]	(71.473)	71.400	0,00
42	09/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,280 [±]	(53.062)	58.380	0,00
84	16/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,280 [±]	(137.623)	168.000	0,01
43	23/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,280 [±]	(89.800)	106.425	0,01
167	09/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,290 [±]	(180.720)	179.525	0,01
66	23/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,290 [±]	(123.132)	141.900	0,01
21	02/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,300 [±]	(8.418)	6.300	0,00
460	17/09/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,500 [±]	(365.750)	460.000	0,02
743	17/12/2021	S&P 500 Index, Strike Price \$25 [±]	(151.750)	134.027	0,01
30	16/07/2021	S&P 500 Index, Strike Price \$4,200 [±]	(211.899)	340.650	0,02
83	15/07/2021	S&P ASX 200 Index, Strike Price AUD7,350 [±]	(58.888)	34.396	0,00
50	16/07/2021	Swiss Market Index, Strike Price CHF12,050 [±]	(74.991)	28.561	0,00
61	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,300 [±]	(34.288)	59.112	0,00
54	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,400 [±]	(25.575)	44.770	0,00
80	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,500 [±]	(30.174)	56.707	0,00
14	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,600 [±]	(3.839)	8.266	0,00
128	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,700 [±]	(46.462)	63.397	0,00
429	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,800 [±]	(134.434)	169.367	0,01

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de opciones sobre índices adquiridos 0,66% (31 de diciembre de 2020: 1,39%) (cont.)

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de compra (cont.)					
145	07/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,900 [±]	(21.620)	18.735	0,00
259	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,900 [±]	(82.477)	82.266	0,01
89	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD18,000 [±]	(22.418)	22.200	0,00
600	16/07/2021	Three Year Mid-Curve Option on Euribor, Strike Price \$99 [±]	(4.686)	3.750	0,00
375	13/08/2021	Three Year Mid-Curve Option on Euribor, Strike Price \$99 [±]	(9.960)	7.031	0,00
Opciones de venta					
100	02/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,200 [±]	(15.906)	6.750	0,00
15	02/07/2021	CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$4,250 [±]	(6.772)	3.075	0,00
350	21/07/2021	CBOE VIX Index, Strike Price \$14 [±]	(4.585)	1.750	0,00
85	20/08/2021	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,000 [±]	(69.309)	68.343	0,01
683	16/07/2021	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,050 [±]	(351.143)	351.527	0,02
252	20/08/2021	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,050 [±]	(256.484)	282.709	0,01
716	16/07/2021	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,075 [±]	(495.776)	449.176	0,02
14	16/07/2021	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,100 [±]	(22.546)	10.726	0,00
7.000	16/07/2021	Euro Stoxx Bank, Strike Price EUR90 [±]	(221.245)	332.052	0,02
30	16/07/2021	FTSE 100 Index, Strike Price GBP7,050 [±]	(42.450)	32.119	0,00
74	16/07/2021	FTSE 100 Index, Strike Price GBP7,100 [±]	(124.051)	103.250	0,01
8	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW418 [±]	(10.837)	231	0,00
25	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW420 [±]	(37.937)	999	0,00
94	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW423 [±]	(160.769)	5.217	0,00
42	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW425 [±]	(79.637)	3.450	0,00
131	09/12/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW430 [±]	(595.966)	456.578	0,02
109	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW435 [±]	(224.629)	44.281	0,00
16	01/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW440 [±]	(9.220)	5.754	0,00
1	12/08/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW440 [±]	(1.977)	1.891	0,00
131	09/12/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW440 [±]	(563.887)	601.985	0,03
131	09/12/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW443 [±]	(582.571)	638.336	0,03
16	16/07/2021	NASD 100 E-mini, Strike Price \$13,600 [±]	(130.894)	8.480	0,00
194	16/07/2021	NASD 100 E-mini, Strike Price \$14,400 [±]	(773.519)	485.000	0,02
94	16/07/2021	NASD 100 E-mini, Strike Price \$14,500 [±]	(319.522)	299.860	0,01
8	09/07/2021	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY28,625 [±]	(26.688)	12.974	0,00
49	09/07/2021	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY28,875 [±]	(206.826)	128.030	0,01
13	09/07/2021	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY29,000 [±]	(44.814)	42.166	0,00
9	09/07/2021	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY29,125 [±]	(46.894)	36.084	0,00
128	16/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,230 [±]	(426.571)	126.400	0,01
59	16/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,270 [±]	(123.214)	84.075	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de opciones sobre índices adquiridos 0,66% (31 de diciembre de 2020: 1,39%) (cont.)

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de venta (cont.)					
147	02/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,280 [±]	(112.478)	62.475	0,00
83	09/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,280 [±]	(114.722)	79.680	0,00
81	02/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,290 [±]	(76.208)	48.600	0,00
105	09/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,290 [±]	(145.516)	119.438	0,01
76	16/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,290 [±]	(182.141)	133.000	0,01
16	17/09/2021	S&P 500 Index, Strike Price \$4,265 [±]	(174.426)	157.920	0,01
2	15/07/2021	S&P ASX 200 Index, Strike Price AUD7,200 [±]	(753)	526	0,00
3	15/07/2021	S&P ASX 200 Index, Strike Price AUD7,250 [±]	(2.711)	1.083	0,00
30	15/07/2021	S&P ASX 200 Index, Strike Price AUD7,300 [±]	(20.736)	14.865	0,00
20	15/07/2021	S&P ASX 200 Index, Strike Price AUD7,325 [±]	(14.948)	11.562	0,00
50	16/07/2021	Swiss Market Index, Strike Price CHF12,050 [±]	(79.303)	88.386	0,01
8	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,100 [±]	(1.025)	380	0,00
6	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,200 [±]	(894)	318	0,00
2	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,300 [±]	(328)	117	0,00
254	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,200 [±]	(109.796)	50.595	0,00
75	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,300 [±]	(39.932)	17.227	0,00
86	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,600 [±]	(33.481)	33.798	0,00
1	07/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,700 [±]	(182)	194	0,00
210	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,700 [±]	(95.965)	98.358	0,01
Total valor razonable en contratos de opciones sobre índices adquiridos				14.796.383	0,66

Contratos de opciones sobre índices adquiridos 0,04% (31 de diciembre de 2020: 0,33%)

Importe nominal	Fecha de vencimiento	Tipo ¹	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de compra					
100.000.000 USD	02/07/2021	United States Dollar/Japanese Yen Currency Option, Strike Price JPY111	(121.000)	486.500	0,02
Opciones de venta					
35.000.000 USD	09/12/2021	United States Dollar/Mexican Peso Currency Option, Strike Price MXN20	(505.435)	347.340	0,02
Total valor razonable en contratos de opciones sobre divisas adquiridos[∞]				833.840	0,04

¹ La contraparte en todos los contratos de opciones de divisas es Goldman Sachs International.

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de opciones sobre renta variable adquiridos 0,56% (31 de diciembre de 2020: 0,39%)

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de compra					
5.000.000	17/02/2023	Absolute Dispersion Option on Stock Basket, Strike 36% ^{oo}	(125.000)	20.700	0,00
7.500.000	15/07/2022	Absolute Dispersion Option on Stock Basket, Strike 45% ^{oo}	(356.250)	74.640	0,01
102	21/01/2022	Alibaba Group Holding, Strike Price \$225 ⁺	(172.234)	256.275	0,01
22	16/06/2023	Alphabet Inc, Strike Price \$2,700 [±]	(545.844)	622.050	0,03
4	20/01/2023	Amazon.com Inc, Strike Price \$3,150 [±]	(224.658)	262.320	0,01
276.700	09/12/2022	Dai-ichi Life Holdings Inc, Strike Price JPY2,040 ^{oo}	(619.424)	594.821	0,03
117	17/09/2021	Digimarc Corp, Strike Price \$45 [±]	(72.009)	13.162	0,00
4.000	17/12/2021	Deutsche Post AG, Strike Price EUR60 [±]	(218.038)	839.617	0,04
1.366	19/11/2021	Expedia Inc, Strike Price \$260 [±]	(705.789)	118.842	0,01
42	17/09/2021	Facebook Inc, Strike Price \$275 [±]	(151.894)	317.625	0,02
25	20/01/2023	Facebook Inc, Strike Price \$285 [±]	(155.490)	232.500	0,01
33.768	09/12/2022	Sony Corp, Strike Price JPY11,320 ^{oo}	(379.530)	314.375	0,02
73.300	09/12/2022	Taiyo Yuden Co Ltd, Strike Price JPY4,985 ^{oo}	(592.208)	701.083	0,03
2.200	17/12/2021	TOTAL SE, Strike Price EUR60 [±]	(67.700)	2.609	0,00
3.073	21/01/2022	Uber Technologies Inc, Strike Price \$85 [±]	(870.457)	170.552	0,01
Opciones de venta					
670	21/01/2022	Airbnb Inc, Strike Price \$105 [±]	(376.021)	222.775	0,01
9.500	17/09/2021	ams AG, Strike Price CHF12 [±]	(622.642)	118.191	0,01
48	17/09/2021	ams AG, Strike Price CHF16 [±]	(6.959)	1.817	0,00
52.150	17/06/2022	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR3 [±]	(709.519)	185.534	0,01
1.199	17/06/2022	Banco BPM SpA, Strike Price EUR1 [±]	(103.769)	44.647	0,00
725	17/12/2021	Basic Fit NV, Strike Price EUR24 [±]	(64.584)	55.886	0,00
16	15/10/2021	Booking Holdings Inc, Strike Price \$1,640 [±]	(89.296)	25.760	0,00
1.800	17/12/2021	Cellnex Telecom SA, Strike Price EUR31 [±]	(327.430)	47.260	0,00
23.200	17/06/2022	Credit Agricole SA, Strike Price EUR6 [±]	(1.157.514)	453.963	0,02
8.700	17/06/2022	Credit Suisse Group, Strike Price CHF7 [±]	(367.217)	301.185	0,01
276.700	09/12/2022	Dai-ichi Life Holdings Inc, Strike Price JPY2,040 ^{oo}	(983.892)	766.855	0,03
889	16/07/2021	Daqo New Energy Corp, Strike Price \$50 [±]	(140.368)	40.005	0,00
3.000	17/12/2021	Deutsche Wohnen SE, Strike Price EUR28 [±]	(275.010)	32.019	0,00
693	17/09/2021	Dufry AG, Strike Price CHF40 [±]	(70.189)	78.720	0,00
10.312	17/06/2022	Intesa Sanpaolo SpA, Strike Price EUR1 [±]	(616.194)	458.588	0,02
294	17/12/2021	J2 Global Inc, Strike Price \$65 [±]	(86.673)	10.290	0,00
404	17/12/2021	J2 Global Inc, Strike Price \$85 [±]	(115.590)	36.360	0,00
208	17/09/2021	Just Eat Takeaway.com NV, September 2021, Strike Price EUR50 [±]	(37.078)	11.717	0,00
231	17/12/2021	Just Eat Takeaway.com NV, December 2021, Strike Price EUR50 [±]	(67.729)	24.381	0,00
889	16/07/2021	JinkoSolar Holding Co, Strike Price \$36 [±]	(105.487)	26.670	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de opciones sobre renta variable adquiridos 0,56% (31 de diciembre de 2020: 0,39%) (cont.)

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de venta					
27.632	17/12/2021	Lloyds Banking Group Plc, Strike Price GBP28 [±]	(385.303)	95.431	0,01
419	21/01/2022	Microchip Technology Inc, Strike Price \$88 [±]	(212.511)	41.900	0,00
8.443	17/12/2021	Natwest Group Plc, Strike Price GBP80 [±]	(296.317)	0	0,00
4.551	17/06/2022	Natwest Group Plc, Strike Price GBP120 [±]	(269.858)	157.174	0,01
168	17/12/2021	Nexi SpA, Strike Price EUR10 [±]	(43.005)	8.846	0,00
1.637	17/12/2021	Nexi SpA, December 2021, Strike Price EUR11 [±]	(478.328)	88.595	0,00
80	17/09/2021	Nexi SpA, September 2021, Strike Price EUR11 [±]	(14.539)	2.889	0,00
1.164	19/11/2021	Neurocrine Biosciences Inc, Strike Price \$70 [±]	(470.024)	270.630	0,01
4.080	21/01/2022	NortonLifeLock Inc, Strike Price \$15 [±]	(457.920)	51.000	0,00
160	17/09/2021	Palo Alto Networks, Inc, Strike Price \$230 [±]	(47.800)	0	0,00
187	21/01/2022	Pinduoduo Inc, Strike Price \$100 [±]	(101.243)	125.290	0,01
480	21/01/2022	Pinduoduo Inc, Strike Price \$90 [±]	(214.309)	196.800	0,01
113	17/12/2021	Prysmian SpA, Strike Price EUR20 [±]	(7.401)	1.847	0,00
600	17/12/2021	Safran SA, Strike Price EUR80 [±]	(281.510)	43.760	0,00
33.768	09/12/2022	Sony Corp, Strike Price JPY11,320 [°]	(574.923)	488.315	0,02
1.200	21/01/2022	Southwest Airlines Co, Strike Price \$35 [±]	(240.564)	54.600	0,00
832	21/01/2022	Spotify Technology, Strike Price \$160 [±]	(532.591)	174.720	0,01
480	21/01/2022	Spotify Technology, Strike Price \$165 [±]	(273.336)	94.800	0,01
1.950	17/06/2022	Standard Chartered Plc, Strike Price GBP400 [±]	(570.250)	700.395	0,03
890	16/07/2021	Sunrun Inc, Strike Price \$50 [±]	(176.030)	86.775	0,01
1.500	17/12/2021	Swiss Re AG, Strike Price CHF48 [±]	(128.876)	33.267	0,00
550	17/12/2021	Swiss Re AG, Strike Price CHF68 [±]	(75.776)	57.121	0,00
73.300	09/12/2022	Taiyo Yuden Co Ltd, Strike Price JPY4,985 [°]	(631.476)	402.106	0,02
6.755	17/06/2022	UniCredit SpA, Strike Price EUR6 [±]	(778.841)	588.790	0,03
3.000	17/09/2021	Twitter Inc, Strike Price \$45 [±]	(751.185)	103.500	0,01
20.500	17/06/2022	UBS Group AG, Strike Price CHF9 [±]	(627.746)	377.022	0,02
623	15/10/2021	Vishay Intertechnology Inc, Strike Price \$15 [±]	(19.631)	7.788	0,00
1.950	21/01/2022	Yandex NV, Strike Price \$40 [±]	(418.418)	112.125	0,01
900	19/11/2021	Yandex NV, Strike Price \$45 [±]	(140.106)	40.500	0,00
Total valor razonable en contratos de opciones sobre renta variable adquiridos				11.889.780	0,56

Contratos de opciones sobre renta fija adquiridos 0,00% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de venta					
140	23/07/2021	US Treasury 10-Year Note Futures, Strike Price \$131	(26.425)	15.313	0,00
Total valor razonable en contratos de opciones sobre renta fija adquiridos *				15.313	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(1.400)	1st Source Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(60.627)	360 Digitech Inc	Goldman Sachs International	27.057	0,00
(249.202)	360 Digitech Inc	Morgan Stanley	110.516	0,01
(11.800)	3D Systems Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(21.615)	3M Co	Morgan Stanley	0	0,00
29.700	8x8 Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(13.300)	A O Smith Corp	Morgan Stanley	0	0,00
15.000	AAON Inc	Morgan Stanley	0	0,00
35.300	AAR Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(6.058)	Aareal Bank AG	Morgan Stanley	1.065	0,00
12.400	AbbVie Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(83)	Abcam Plc	Morgan Stanley	42	0,00
(3.900)	ABC-Mart Inc	Morgan Stanley	1.345	0,00
(20.800)	Abercrombie & Fitch Co Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(1.258)	ABN AMRO Bank NV	Morgan Stanley	188	0,00
(1.448.629)	Absa Group Ltd	Morgan Stanley	8.776	0,00
(3.430.299)	ABSA Group Ltd	Goldman Sachs International	11.573	0,00
(1.980.728)	Academy Sports & Outdoors In	Goldman Sachs International	738.088	0,04
70.100	Acadia Realty Trust	Morgan Stanley	0	0,00
(55.430)	Acceleron Pharma Inc	Goldman Sachs International	2.084	0,00
2.500	Accenture Plc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
44.500	ACI Worldwide Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(49.200)	Acom Co Ltd	Morgan Stanley	10.180	0,00
(6.410)	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Morgan Stanley	857	0,00
(700)	Acuity Brands Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.700)	Adastria Co Ltd	Morgan Stanley	338	0,00
104.129	ADC Therapeutics SA	Goldman Sachs International	1.623	0,00
26.464	Adient Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.300)	ADLER Group SA	Morgan Stanley	1.512	0,00
1.617.303	Admiral Group Plc	Goldman Sachs International	38.891	0,00
(2.300)	Adobe Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.293.964)	Adobe Inc	Goldman Sachs International	302.423	0,02
(119.500)	ADT Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(6.400)	Advance Auto Parts Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.729.381)	Advanced Drainage Systems Inc	Goldman Sachs International	129.501	0,01
(8.300)	Advanced Energy Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
400	Advanced Micro Devices Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(285.352)	Advanced Micro Devices Inc	Goldman Sachs International	16.670	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(563.054)	Advantage Oil & Gas Ltd	Goldman Sachs International	389.081	0,02
(2.731.439)	Adyen NV	Morgan Stanley	55.532	0,00
(372.457)	Adyen NV	Goldman Sachs International	41.890	0,00
9.472	Aea-Bridges Impact Corp Class A	Morgan Stanley	9.093	0,00
7.000	AECOM	Morgan Stanley	0	0,00
(199)	Aedifica SA	Morgan Stanley	482	0,00
(34.373)	Aegon NV	Morgan Stanley	1.000	0,00
(7.600)	Aeon Co Ltd	Morgan Stanley	1.957	0,00
12.200	AerCap Holdings NV	Morgan Stanley	0	0,00
2.100	AeroVironment Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.400	Affiliated Managers Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(21.400)	Aflac Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(76.358.706)	AGC Inc	JPMorgan Chase Bank	55.010	0,00
(4.600)	AGC Inc	Morgan Stanley	6.026	0,00
(2.476.208)	AGCO Corp	Goldman Sachs International	38.551	0,00
7.463	AGCO Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(65)	Ageas SA	Morgan Stanley	87	0,00
204.570	Agile Property Holdings Ltd	Goldman Sachs International	3.009	0,00
3.541.912	Agile Property Holdings Ltd	Morgan Stanley	54.762	0,00
16.300	Agree Realty Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(3.600)	Aica Kogyo Co Ltd	Morgan Stanley	3.376	0,00
(2.300)	Aiful Corp	Morgan Stanley	97	0,00
(3.300)	Ain Holdings Inc	Morgan Stanley	2.433	0,00
(565.117)	Air France-KLM	Goldman Sachs International	318.783	0,02
(8.500)	Air Lease Corp	Morgan Stanley	0	0,00
35.600	Air Transport Services Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(13.300)	Air Water Inc	Morgan Stanley	1.983	0,00
(4.517.458)	Airbnb Inc Class A	Goldman Sachs International	219.504	0,01
(2.471.499)	Airbus SE	Goldman Sachs International	106.960	0,01
(114)	AIXTRON SE	Morgan Stanley	28	0,00
(500)	Ajinomoto Co Inc	Morgan Stanley	178	0,00
(3.800)	Akamai Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.000	Alamo Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.200	Alarm.com Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
10.700	Alaska Air Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.351)	Albemarle Corp	Morgan Stanley	0	0,00
24.500	Alcoa Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(38.982.121)	Alfa Laval AB	Goldman Sachs International	71.774	0,00
(3.305.369)	Alfa Laval AB	Morgan Stanley	7.492	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(2.285.193)	Alibaba Group Holding Ltd	Goldman Sachs International	117.783	0,01
2.100	Alleghany Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.800)	Allegheny Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
7.100	Allegiant Travel Co	Morgan Stanley	0	0,00
(22.486)	Allegion Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.272.789)	Allegion Plc	Goldman Sachs International	69.744	0,00
(2.507.659)	Allegro.eu SA	Goldman Sachs International	39.291	0,00
20.200	Alliance Data Systems Corp	Morgan Stanley	0	0,00
11.600	AllianceBernstein Holding LP	Morgan Stanley	0	0,00
(106.600)	Alliant Energy Corp	Morgan Stanley	0	0,00
5.386.719	Allianz SE	Goldman Sachs International	156.330	0,01
312.034	Allianz SE	Morgan Stanley	11.876	0,00
(15.500)	Allison Transmission Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
117.297	Allison Transmission Holdings Inc	Goldman Sachs International	6.152	0,00
(362)	Allreal Holding AG	Morgan Stanley	266	0,00
(146.000)	Allscripts Healthcare Solutions Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.300)	Allstate Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(12.731.980)	Alphabet Inc Class A	Goldman Sachs International	504.357	0,03
(443.792)	Alstom SA	JPMorgan Chase Bank	13.336	0,00
(64.468)	Alstom SA	Morgan Stanley	231.465	0,01
(1.051)	alstria office REIT-AG	Morgan Stanley	183	0,00
1.200	Altair Engineering Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
5.900	Alteryx Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
1.164.367	Altice USA Inc Class A	Goldman Sachs International	7.847	0,00
72.800	Altice USA Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(13.400)	Altra Industrial Motion Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.340.815)	Altria Group Inc	Goldman Sachs International	62.479	0,00
366.732	Alumina Ltd	Morgan Stanley	28.528	0,00
510.003	Amadeus IT Group SA	Morgan Stanley	28.627	0,00
624.857	Amadeus IT Group SA	Goldman Sachs International	19.661	0,00
(6.800)	Amano Corp	Morgan Stanley	9.302	0,00
(11.670.642)	Amazon.com Inc	Goldman Sachs International	321.708	0,02
(52.159)	Ambarella Inc	Goldman Sachs International	2.240	0,00
(688.512)	Ambarella Inc	Morgan Stanley	105.192	0,01
15.582	Ambrx Biopharma Inc	Morgan Stanley	24.931	0,00
1.770.964	Amcor Plc	Goldman Sachs International	86.454	0,01
22.600	Amdocs Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
1.546.209	Amdocs Ltd	Goldman Sachs International	46.499	0,00
7.700	Amedisys Inc	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(27.500)	Ameren Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(4.100)	American Airlines Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(118.019)	American Axle & Manufacturing Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(400)	American Eagle Outfitters Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(31.500)	American Equity Investment Life Holding Co	Morgan Stanley	0	0,00
(16.600)	American Express Co	Morgan Stanley	0	0,00
(27.100)	American Financial Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
71.700	American Homes 4 Rent Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(12.700)	American International Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
8.400	American States Water Co	Morgan Stanley	0	0,00
222.307	American Tower Corp	Goldman Sachs International	2.150	0,00
4.100	American Tower Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.600)	American Water Works Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
7.600	American Woodmark Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(206.584)	Ameriprise Financial Inc	Goldman Sachs International	10.063	0,00
35.300	Ameris Bancorp	Morgan Stanley	0	0,00
(8.900)	AmerisourceBergen Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(224.103)	Amorepacific Corp	Morgan Stanley	0	0,00
224.651	Amorepacific Group	Goldman Sachs International	993	0,00
176.058	Amorepacific Group	Morgan Stanley	2.089	0,00
225.996	Amorepacific Group	JPMorgan Chase Bank	2.338	0,00
(37.400)	Amphenol Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
27.121	Ampol Ltd	Morgan Stanley	832	0,00
393.865	Ampol Ltd	JPMorgan Chase Bank	11.072	0,00
15.409.571	ams AG	Morgan Stanley	1.530.051	0,07
(2.000)	ANA Holdings Inc	Morgan Stanley	862	0,00
(10.900)	Analog Devices Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.174.464)	Analog Devices Inc	Goldman Sachs International	102.052	0,00
28.400	Anaplan Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(14.700)	Andersons Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(20.331)	ANDRITZ AG	Morgan Stanley	0	0,00
21.600	Angi Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(67.710)	Anglo American Plc	Morgan Stanley	143.339	0,01
4.900	ANSYS Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.400	Antero Midstream Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(322.373)	Antero Resources Corp	Goldman Sachs International	5.550	0,00
(42.700)	Antero Resources Corp	Morgan Stanley	0	0,00
2.600	Anthem Inc	Morgan Stanley	0	0,00
932	AO World Plc	Morgan Stanley	9	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(21.200)	Aozora Bank Ltd	Morgan Stanley	1.298	0,00
3.021.996	AP Moller - Maersk A/S Class B	Goldman Sachs International	1.912	0,00
(355.409)	Apa Corp	Goldman Sachs International	57.893	0,00
12.298	Apartment Income REIT Corp	Morgan Stanley	114.121	0,01
(102)	Apartment Investment & Management Co Class A	Morgan Stanley	3.393	0,00
(13.400)	Apogee Enterprises Inc	Morgan Stanley	0	0,00
10.142	Apollo Strategic Growth	Morgan Stanley	12.069	0,00
(2.500)	Appfolio Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(4.100)	Appian Corp	Morgan Stanley	32.674	0,00
59.900	Apple Hospitality REIT Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.200	Apple Inc	Morgan Stanley	0	0,00
15.800	Applied Industrial Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
400	Applied Materials Inc	Morgan Stanley	0	0,00
89.254	AppLovin Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	5.664	0,00
547.417	AppLovin Corp Class A	Goldman Sachs International	46.398	0,00
14.900	AptarGroup Inc	Morgan Stanley	0	0,00
11.080	Aptiv Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(810.959)	Arc Resources Ltd	Goldman Sachs International	35.906	0,00
(160)	Arcadis NV	Morgan Stanley	110	0,00
38.400	ArcBest Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.096)	ArcelorMittal SA	Morgan Stanley	840	0,00
(40.600)	Arch Capital Group Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
500	Archer-Daniels-Midland Co	Morgan Stanley	0	0,00
85.400	Archrock Inc	Morgan Stanley	0	0,00
25	Arconic Corp	Morgan Stanley	0	0,00
6.400	Arcosa Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(248.320)	Arena Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	925	0,00
13.079	Ares Acquisition Corp	Morgan Stanley	16.349	0,00
(1.209.592)	Ares Management Corp Class A	Goldman Sachs International	183.662	0,01
(11.100)	Argo Group International Holdings Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(2.300)	Ariake Japan Co Ltd	Morgan Stanley	123	0,00
(4.300)	Arista Networks Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(17.300)	Armstrong World Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.800)	Arrow Electronics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(217.107)	Arthur J Gallagher & Co	Goldman Sachs International	1.110	0,00
22.800	Arthur J Gallagher & Co	Morgan Stanley	0	0,00
14.800	Artisan Partners Asset Management Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
1.300	Asahi Holdings Inc	Morgan Stanley	560	0,00
5.100	Asahi Intecc Co Ltd	Morgan Stanley	1.067	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(24.100)	Asahi Kasei Corp	Morgan Stanley	2.199	0,00
17.300	Asbury Automotive Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(978)	Ascential Plc	Morgan Stanley	1	0,00
17.400	ASGN Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.836)	Ashland Global Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(300)	ASKUL Corp	Morgan Stanley	233	0,00
418	ASM International NV	Morgan Stanley	276	0,00
(683.776)	ASML Holding NV	Goldman Sachs International	77.383	0,00
(387)	ASOS Plc	Morgan Stanley	58	0,00
91.116	ASOS Plc	Goldman Sachs International	12.744	0,00
11.300	Aspen Technology Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.698)	ASR Nederland NV	Morgan Stanley	1.315	0,00
(7.248.710)	Assa Abloy AB Class B	Goldman Sachs International	17.174	0,00
(34.856)	Assa Abloy AB Class B	Morgan Stanley	152	0,00
36.900	Associated Banc-Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.126.562	Associated British Foods Plc	Goldman Sachs International	80.596	0,01
(147.313)	Assura Plc	Morgan Stanley	2.399	0,00
(170)	Aston Martin Lagonda Global Holdings Plc	Morgan Stanley	13	0,00
(9.472.894)	AstraZeneca Plc	Goldman Sachs International	1.575.923	0,09
(4.003.782)	AstraZeneca Plc	JPMorgan Chase Bank	938.859	0,04
(569.571)	AstraZeneca Plc	Morgan Stanley	28.672	0,00
263.223	AT&T Inc	Morgan Stanley	9.989	0,00
235.843	AT&T Inc	Goldman Sachs International	11.048	0,00
(56.700)	Athene Holding Ltd Class A	Morgan Stanley	0	0,00
23.700	Atkore International Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
36.900	Atlantic Union Bankshares Corp	Morgan Stanley	0	0,00
6.600	Atlantica Sustainable Infrastructure Plc	Morgan Stanley	0	0,00
2.500	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.300)	Atlassian Corp Plc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(481.723)	Atlassian Corp Plc Class A	Goldman Sachs International	43.557	0,00
3.400	Atmos Energy Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(5.237)	Atos SE	Morgan Stanley	7.879	0,00
35	Atoss Software AG	Morgan Stanley	229	0,00
(400)	Atrion Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(72)	Aurubis AG	Morgan Stanley	25	0,00
11.896	Auto1 Group SE	Morgan Stanley	0	0,00
(8.500)	Autobacs Seven Co Ltd	Morgan Stanley	448	0,00
4.100	Autodesk Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.990.104)	Autodesk Inc	Goldman Sachs International	41.542	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
403.317	Autohome Inc	Goldman Sachs International	120.501	0,01
182.877	Autohome Inc	Morgan Stanley	84.218	0,01
(63.289)	Autoliv Inc	Morgan Stanley	0	0,00
359.286	Autoliv Inc	Goldman Sachs International	27.109	0,00
(2.397.778)	Automatic Data Processing Inc	Goldman Sachs International	25.636	0,00
7.700	Automatic Data Processing Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.300)	AutoNation Inc	Morgan Stanley	0	0,00
400	AutoZone Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(10.900)	Avalara Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.500)	AvalonBay Communities Inc	Morgan Stanley	0	0,00
25.900	Avanos Medical Inc	Morgan Stanley	0	0,00
9.009	Avanti Acquisition Corp	Morgan Stanley	9.370	0,00
(295)	Avast Plc	Morgan Stanley	23	0,00
14.300	Avaya Holdings Corp	Morgan Stanley	0	0,00
4.600	Avery Dennison Corp	Morgan Stanley	0	0,00
18.700	Avista Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(23.365)	Aviva Plc	Morgan Stanley	2.119	0,00
49.400	Avnet Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.949)	AXA SA	Morgan Stanley	1.359	0,00
10.600	Axalta Coating Systems Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(900)	Azbil Corp	Morgan Stanley	123	0,00
(24.631)	AZEK Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
8.800	AZZ Inc	Morgan Stanley	0	0,00
51.200	B&G Foods Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(31.303)	Babcock International Group Plc	Morgan Stanley	775	0,00
1.800	Badger Meter Inc	Morgan Stanley	0	0,00
132.727	BAE Systems Plc	Goldman Sachs International	8.832	0,00
(180.899)	Baidu Inc	Morgan Stanley	3.334	0,00
53.600	Baker Hughes Co	Morgan Stanley	0	0,00
676.322	Baker Hughes Co	Goldman Sachs International	19.106	0,00
(11.200)	Balchem Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(31.135)	Balfour Beatty Plc	Morgan Stanley	595	0,00
(123.384)	Ball Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(576)	Baloise Holding AG	Morgan Stanley	868	0,00
1.800	Banc of California Inc	Morgan Stanley	0	0,00
10.200	BancFirst Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.547.735	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Goldman Sachs International	17.673	0,00
(31.678)	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Morgan Stanley	3.387	0,00
(173.413)	Banco BPM SpA	Goldman Sachs International	53.493	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
1.493.866	Banco de Sabadell SA	Goldman Sachs International	301.002	0,02
(276.605)	Banco de Sabadell SA	Morgan Stanley	3.309	0,00
(33.430)	Banco Santander SA	Morgan Stanley	2.810	0,00
2.500	BancorpSouth Bank	Morgan Stanley	0	0,00
36.600	Bank of America Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(885.731)	Bank of America Corp	Goldman Sachs International	63.496	0,00
15.500	Bank of Hawaii Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(6.800)	Bank of Kyoto Ltd	Morgan Stanley	2.507	0,00
(19.400)	Bank of New York Mellon Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(22.400)	Bank OZK	Morgan Stanley	0	0,00
(1.427.001)	Bank Pekao SA	Goldman Sachs International	3.507	0,00
(351.605)	Bank Pekao SA	Morgan Stanley	36.181	0,00
(15.542)	Bankinter SA	Morgan Stanley	838	0,00
1.509.065	Bankinter SA	Goldman Sachs International	425.991	0,02
48.897	BankUnited Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.100)	Banner Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.646	Banque Cantonale Vaudoise	Morgan Stanley	1.362	0,00
(34.342)	Barclays Plc	Morgan Stanley	822	0,00
(326.778)	Barratt Developments Plc	Morgan Stanley	318.733	0,02
(27)	Barry Callebaut AG	Morgan Stanley	415	0,00
2.552.118	BASF SE	Goldman Sachs International	72.899	0,00
(86.148)	BASF SE	Morgan Stanley	179	0,00
2.523.318	Basic-Fit NV	Morgan Stanley	118.153	0,01
(1.512)	Bayer AG	Morgan Stanley	1.017	0,00
(101.227)	Bayerische Motoren Werke AG	Morgan Stanley	3.471	0,00
(447)	BayWa AG	Morgan Stanley	64	0,00
660	BE Semiconductor Industries NV	Morgan Stanley	69	0,00
25.400	Beacon Roofing Supply Inc	Morgan Stanley	0	0,00
440	Bechtle AG	Morgan Stanley	215	0,00
1.400	Becton Dickinson and Co	Morgan Stanley	0	0,00
(163.754)	Beigene Ltd	Morgan Stanley	37.796	0,00
(12.300)	Belden Inc	Morgan Stanley	0	0,00
19.100	Benchmark Electronics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(400)	Benefit One Inc	Morgan Stanley	179	0,00
(23)	Beneteau SA	Morgan Stanley	13	0,00
(1.500)	BeNext-Yumeshin Group Co	Morgan Stanley	134	0,00
100	Bengo4.com Inc	Morgan Stanley	484	0,00
(31.167)	Berkeley Group Holdings Plc	Morgan Stanley	72.140	0,00
(35.700)	Berkshire Hills Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(1.973.254)	Berry Global Group Inc	JPMorgan Chase Bank	344.767	0,02
15.300	Berry Global Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(14.200)	Best Buy Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.510)	BHP Group Plc	Morgan Stanley	580	0,00
(5.347.955)	Bid Corp Ltd	Goldman Sachs International	17.352	0,00
(1.657.746)	Bidvest Group Ltd	Morgan Stanley	19.666	0,00
(1.185)	Bilfinger SE	Morgan Stanley	127	0,00
(209.264)	BillerudKorsnas AB	Morgan Stanley	0	0,00
1.900	Bio-Rad Laboratories Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
23.300	BJ's Restaurants Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(799.524)	BJ's Wholesale Club Holdings	Goldman Sachs International	141.951	0,01
1.123	BKW AG	Morgan Stanley	523	0,00
(600)	Black Knight Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(12.700)	Blackbaud Inc	Morgan Stanley	0	0,00
8.400	Blackline Inc	Morgan Stanley	0	0,00
201.228	Blackline Inc	Goldman Sachs International	4.286	0,00
(100)	BlackRock Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(31.800)	Blackstone Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
50.498	Bloom Energy Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
11.900	Bloomin' Brands Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(25.700)	Blucora Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(938.130)	Blue Bird Corp	Morgan Stanley	177.229	0,01
26.729	Bluescape Opportunities Acquisition Class A	Morgan Stanley	36.083	0,00
(814.861)	BlueScope Steel Ltd	Morgan Stanley	37.373	0,00
(2.871)	BNP Paribas SA	Morgan Stanley	2.799	0,00
2.376.928	BNP Paribas SA	Goldman Sachs International	131.558	0,01
(12.969)	Boeing Co	Morgan Stanley	0	0,00
(33.842)	Boise Cascade Co	Morgan Stanley	0	0,00
(12.600)	BOK Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.895)	Boliden AB	Morgan Stanley	63	0,00
6.355.887	Booking Holdings Inc	Goldman Sachs International	361.074	0,01
(63.323)	Booking Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.900)	Boot Barn Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.002	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(40.465)	BorgWarner Inc	Morgan Stanley	0	0,00
300	Boston Beer Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
13.300	Boston Private Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(26.300)	Boston Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.700)	Boston Scientific Corp	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
27.400	Bottomline Technologies DE Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.263)	Bouygues SA	Morgan Stanley	1.553	0,00
(300)	Box Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
548.969	Boyd Gaming Corp	Goldman Sachs International	446	0,00
5.500	Boyd Gaming Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(5.842)	bpost SA	Morgan Stanley	942	0,00
34.400	Brandywine Realty Trust	Morgan Stanley	21	0,00
45.321	Brenntag AG	Morgan Stanley	1.274	0,00
(1.000)	Brewin Dolphin Holdings Plc	Morgan Stanley	54	0,00
8.600	Brighthouse Financial Inc	Morgan Stanley	0	0,00
5.000	Brinker International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(180.556)	Bristol-Myers Squibb Co	Goldman Sachs International	3.147	0,00
(950.760)	Bristol-Myers Squibb Co	JPMorgan Chase Bank	66.949	0,00
(1.700)	Bristol-Myers Squibb Co	Morgan Stanley	0	0,00
(3.293)	British Land Co Plc	Morgan Stanley	397	0,00
1.535.706	British Land Co Plc	Goldman Sachs International	57.569	0,00
(88.400)	Brixmor Property Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(27.600)	Brookfield Property Partners LP	Morgan Stanley	0	0,00
1.214	Brookfield Renewable Corp	Morgan Stanley	0	0,00
583.237	Brookfield Renewable Corp	Goldman Sachs International	36.442	0,00
12.200	Brooks Automation Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(56.700)	Brown & Brown Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.700)	Brown-Forman Corp Class B	Morgan Stanley	0	0,00
(6.100)	Bruker Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.500)	Bryn Mawr Bank Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(89.634)	BT Group Plc	Morgan Stanley	4.998	0,00
172.912	BT Group Plc	Goldman Sachs International	25.615	0,00
180	Bucher Industries AG	Morgan Stanley	1.012	0,00
(4.500)	Buckle Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.025.822)	Builders FirstSource Inc	JPMorgan Chase Bank	44.007	0,00
10.988	Builders FirstSource Inc	Morgan Stanley	0	0,00
20.000	Bunge Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(240)	Burberry Group Plc	Morgan Stanley	333	0,00
1.500	Burlington Stores Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(152.816)	C4 Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	5.301	0,00
(1.100)	Cable One Inc	Morgan Stanley	0	0,00
15.700	Cabot Corp	Morgan Stanley	0	0,00
88.200	Cabot Oil & Gas Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(100)	CACI International Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(23.600)	Cactus Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
1.062.272	Cadence BanCorp	Goldman Sachs International	66.583	0,00
26.300	Cadence BanCorp	Morgan Stanley	0	0,00
(54.017)	CaixaBank SA	Morgan Stanley	1.442	0,00
(36.700)	Caleres Inc	Morgan Stanley	0	0,00
19.900	California Water Service Group	Morgan Stanley	0	0,00
(8.200)	Callon Petroleum Co	Morgan Stanley	0	0,00
39.600	Cal-Maine Foods Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(30.700)	Camden Property Trust	Morgan Stanley	0	0,00
(2.667.646)	Cameco Corp	JPMorgan Chase Bank	831.640	0,04
1.219.224	Campbell Soup Co	Goldman Sachs International	74.688	0,00
31.300	Campbell Soup Co	Morgan Stanley	0	0,00
4.000	Canada Goose Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
10.243	Canadian National Railway Co	Morgan Stanley	0	0,00
(14.150)	Canadian Pacific Railway Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(9.059)	Canadian Solar Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(541)	CANCOM SE	Morgan Stanley	268	0,00
5.900	Capcom Co Ltd	Morgan Stanley	1.507	0,00
(1.490.527)	Capgemini SE	Goldman Sachs International	101.779	0,01
(454)	Capgemini SE	Morgan Stanley	492	0,00
(1.032.709)	Capita Plc	Goldman Sachs International	51.323	0,00
(7.237)	Capital & Counties Properties Plc	Morgan Stanley	122	0,00
19.200	Capital One Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(215.528)	Capital One Financial Corp	Goldman Sachs International	7.168	0,00
(395.669)	Capitec Bank Holdings Ltd	Goldman Sachs International	502	0,00
(4.775.709)	Capitec Bank Holdings Ltd	Morgan Stanley	76.202	0,00
(32.000)	Capri Holdings Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(35.557)	Cardinal Health Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(13.700)	Cardiovascular Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.600)	Cardlytics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
19.500	CareTrust REIT Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(100.365)	Cargotec OYJ Class B	Morgan Stanley	243	0,00
(18.100)	Carlyle Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(343)	Carmila SA	Morgan Stanley	149	0,00
27.800	Carnival Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(3.850)	Carnival Plc	Morgan Stanley	192	0,00
(10.000)	Carpenter Technology Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(15.442)	Carrefour SA	Morgan Stanley	2.492	0,00
49.026	Carrier Global Corp	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
176.723	Carter's Inc	Goldman Sachs International	4.464	0,00
4.700	Carter's Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.809)	Carvana Co	Morgan Stanley	0	0,00
(311.676)	Casella Waste Systems Inc Class A	Goldman Sachs International	21.263	0,00
101.726	Casper Sleep Inc	Goldman Sachs International	10.010	0,00
28.015	Caterpillar Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(32.500)	Cathay General Bancorp	Morgan Stanley	0	0,00
14.200	CBIZ Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.400	CBRE Group Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
147.552	CDK Global Inc	Goldman Sachs International	7.812	0,00
60.836	CDK Global Inc	Morgan Stanley	1.532	0,00
6.600	Cedar Fair LP	Morgan Stanley	0	0,00
19.998.967	Cellnex Telecom SA	Morgan Stanley	2.451.893	0,11
(99.637)	Centamin Plc	Morgan Stanley	3.311	0,00
(36.400)	Centene Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(47.781)	Centennial Resource Development Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(3.400)	Central Japan Railway Co	Morgan Stanley	15.341	0,00
(318.973)	Centrica Plc	Morgan Stanley	4.274	0,00
9.400	Century Communities Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(51.846)	Cerevel Therapeutics Holdings Inc	Goldman Sachs International	53.528	0,00
(5.500)	Ceridian HCM Holding Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.600	Cerner Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.970.351)	CEZ AS	Goldman Sachs International	17.265	0,00
(2.998.799)	CEZ AS	Morgan Stanley	20.977	0,00
864	CF Acquisition Corp	Morgan Stanley	881	0,00
83.053	CF Industries Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
21.599	CH Robinson Worldwide Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.200	Change Inc	Morgan Stanley	1.036	0,00
(7.700)	Charles River Laboratories International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.500)	Charles Schwab Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.532.214)	Charles Schwab Corp	Goldman Sachs International	146.201	0,01
13.903	Charter Communications Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
134.973	Check Point Software Tech	Morgan Stanley	2.458	0,00
11.800	Check Point Software Technologies Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
2.200	Cheesecake Factory Inc	Morgan Stanley	0	0,00
600	Chemed Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(49.000)	Chemours Co	Morgan Stanley	0	0,00
(807.482)	Chesapeake Energy Corp	Morgan Stanley	50.112	0,00
(4.300)	Chesapeake Utilities Corp	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
4.087.919	Chevron Corp	Goldman Sachs International	162.190	0,01
5.934	Chevron Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(72.400)	Chiba Bank Ltd	Morgan Stanley	12.384	0,00
39.733.730	Chiba Bank Ltd	Goldman Sachs International	7.714	0,00
(3.000)	Children's Place Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.633.940)	China Meidong Auto Holdings Ltd	Morgan Stanley	68.608	0,00
(1.390.129)	China Mengniu Dairy Co Ltd	Goldman Sachs International	10.336	0,00
472.471	China Merchants Bank Co Ltd Class H	Goldman Sachs International	2.024	0,00
1.399.004	China Oilfield Services Ltd	JPMorgan Chase Bank	6.702	0,00
(11.544.688)	China Resources Beer Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	20.526	0,00
(950.018)	China Resources Beer Holdings Co Ltd	Goldman Sachs International	1.607	0,00
4.092.783	China Resources Cement Holdings Ltd	Morgan Stanley	88.318	0,01
(1.732.345)	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	Morgan Stanley	41.876	0,00
(300)	Chipotle Mexican Grill Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(14.800)	Choice Hotels International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(11.476)	Chr Hansen Holding A/S	Morgan Stanley	38	0,00
(4.400)	Chubb Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(41.900)	Chubu Electric Power Co Inc	Morgan Stanley	2.501	0,00
22.500	Church & Dwight Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
17.134	Churchill Capital Corp	Morgan Stanley	35.298	0,00
(3.112)	Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA	Morgan Stanley	138	0,00
(16.549)	Cie Financiere Richemont SA Class A	Goldman Sachs International	822	0,00
(179.340)	Cie Financiere Richemont SA Class A	Morgan Stanley	83.218	0,01
34.150	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Goldman Sachs International	110.743	0,01
950.970	Ciena Corp	Goldman Sachs International	20.569	0,00
26.500	Cimarex Energy Co	Morgan Stanley	0	0,00
(2.900)	Cincinnati Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
19.500	Cinemark Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.900)	CIRCOR International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(9.500)	Cirrus Logic Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.125.984)	Cisco Systems Inc	Goldman Sachs International	3.768	0,00
4.000	Cisco Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(215.908)	Citigroup Inc	Goldman Sachs International	1.154	0,00
(10.600)	Citizen Watch Co Ltd	Morgan Stanley	662	0,00
(26.500)	Citizens Financial Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
11.100	Citrix Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.600)	City Holding Co	Morgan Stanley	0	0,00
(326.012)	Clear Channel Outdoor Holdings	Goldman Sachs International	115.970	0,00
(192.308)	Clear Channel Outdoor Holdings	JPMorgan Chase Bank	126.763	0,01

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(50.500)	Cleveland-Cliffs Inc	Morgan Stanley	0	0,00
7.954.879	Clorox Co	Goldman Sachs International	279.998	0,02
(27.100)	Cloudflare Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
236.245	CLP Holdings Ltd	Goldman Sachs International	1.139	0,00
(220.639)	CME Group Inc	Goldman Sachs International	143	0,00
11.200	CME Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
95.800	CMS Energy Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(8.100)	CNA Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(74.100)	CNH Industrial NV	Morgan Stanley	0	0,00
96.900	CNO Financial Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
5.749	CNP Assurances	Morgan Stanley	201	0,00
17.900	CNX Resources Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(32.100)	Coca-Cola Co	Morgan Stanley	0	0,00
(31.900)	Coca-Cola European Partners Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(500)	cocokara fine Inc	Morgan Stanley	373	0,00
29.900	Coeur Mining Inc	Morgan Stanley	0	0,00
425	Coface SA	Morgan Stanley	1	0,00
(430)	Cofinimmo SA	Morgan Stanley	937	0,00
2.500	Cognex Corp	Morgan Stanley	0	0,00
337.992	Cognizant Technology Solutions Corp Class A	Morgan Stanley	32.255	0,00
181.450	Cognizant Technology Solutions Corp Class A	Goldman Sachs International	18.718	0,00
(9.700)	Cohen & Steers Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(400)	Coherent Inc	Morgan Stanley	0	0,00
252.425	Coherus Biosciences Inc	JPMorgan Chase Bank	38.625	0,00
(1.120.643)	Coinbase Global Inc - Class A	Goldman Sachs International	121.682	0,01
(40.000)	Colfax Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(200)	Colgate-Palmolive Co	Morgan Stanley	0	0,00
(2.900)	COLOPL Inc	Morgan Stanley	282	0,00
(10.000)	Colowide Co Ltd	Morgan Stanley	98	0,00
33.500	Columbia Banking System Inc	Morgan Stanley	0	0,00
54.800	Columbia Property Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
9.900	Columbia Sportswear Co	Morgan Stanley	0	0,00
6.900	Columbus McKinnon Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(10.141.694)	Comcast Corp Class A	Goldman Sachs International	45.280	0,00
31.900	Comcast Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
27.800	Comerica Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.044.792)	Comerica Inc	Goldman Sachs International	51.246	0,00
6.900	Comfort Systems USA Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.150	Commerce Bancshares Inc	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(33.500)	Commercial Metals Co	Morgan Stanley	0	0,00
(36.079)	Commerzbank AG	Morgan Stanley	5.667	0,00
(67.700)	CommScope Holding Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.100)	CommVault Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.465.320)	Compagnie De Saint Gobai	Morgan Stanley	176.311	0,01
(2.909.594)	Compagnie De Saint Gobai	Goldman Sachs International	34.739	0,00
(32)	Computacenter Plc	Morgan Stanley	25	0,00
28.700	Conagra Brands Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(147.300)	Concordia Financial Group Ltd	Morgan Stanley	18.976	0,00
(630.033)	Conduit Holdings Ltd	Goldman Sachs International	62.839	0,00
(15.500)	ConnectOne Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.438)	ConocoPhillips	Morgan Stanley	0	0,00
16.100	Consolidated Edison Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(7.400)	Constellation Brands Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(1.110.494)	Constellation Brands Inc Class A	Goldman Sachs International	34.160	0,00
(447.491)	Contextlogic Inc Class A	Goldman Sachs International	47.779	0,00
(5.600)	Continental Resources Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(25.700)	ConvaTec Group Plc	Morgan Stanley	169	0,00
2.600	Cooper Cos Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.284	Corbion NV	Morgan Stanley	1.442	0,00
(31.300)	Core Laboratories NV	Morgan Stanley	0	0,00
(46.800)	CoreCivic Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.300)	CoreSite Realty Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(22.600)	Cornerstone OnDemand Inc	Morgan Stanley	0	0,00
53.800	Corning Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.097.304)	Corning Inc	Goldman Sachs International	11.477	0,00
(20.900)	Corporate Office Properties Trust	Morgan Stanley	0	0,00
(60.390.231)	Cosmo Energy Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	21.916	0,00
4.902.820	Cosmos Pharmaceutical Corp	Goldman Sachs International	118	0,00
14.200	CoStar Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
948.684	CoStar Group Inc	Goldman Sachs International	10.367	0,00
(2.000)	Costco Wholesale Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(18.100)	Coty Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
1.067.650	Country Garden Holdings Co Ltd	Goldman Sachs International	5.608	0,00
3.700	Coupa Software Inc	Morgan Stanley	0	0,00
682.149	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Goldman Sachs International	17.694	0,00
2.000	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.700	Credit Acceptance Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(10.853)	Credit Agricole SA	Morgan Stanley	1.482	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(24.200)	Credit Saison Co Ltd	Morgan Stanley	5.936	0,00
90	Credit Suisse	Goldman Sachs International	101	0,00
(29.318)	Credit Suisse Group AG	Morgan Stanley	2.465	0,00
(2.500)	Cree Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(264)	Crest Nicholson Holdings Plc	Morgan Stanley	29	0,00
40.400	Crestwood Equity Partners LP	Morgan Stanley	0	0,00
(13)	CRH Plc	Morgan Stanley	11	0,00
(5.700)	Crocs Inc	Morgan Stanley	0	0,00
83.505	Croda International Plc	Morgan Stanley	199.972	0,01
219.706	Crown Castle International Corp	Goldman Sachs International	956	0,00
13.000	Crown Castle International Corp	Morgan Stanley	0	0,00
106.439	Crown Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(13.900)	CSG Systems International Inc	Morgan Stanley	354	0,00
6.200	CSW Industrials Inc	Morgan Stanley	0	0,00
102.819	CSX Corp	Morgan Stanley	0	0,00
26.100	CubeSmart	Morgan Stanley	0	0,00
14.800	Cullen/Frost Bankers Inc	Morgan Stanley	0	0,00
53.629	Cullinan Oncology Inc	Goldman Sachs International	640	0,00
2.900	Cummins Inc	Morgan Stanley	0	0,00
15.800	Curtiss-Wright Corp	Morgan Stanley	0	0,00
64.100	Cushman & Wakefield Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(35.800)	Customers Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(35.100)	CVB Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(4.800)	CVS Health Corp	Morgan Stanley	0	0,00
16.100	CyberAgent Inc	Morgan Stanley	2.552	0,00
9.700	CyberArk Software Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
47.700	CyrusOne Inc	Morgan Stanley	0	0,00
24.486	Cyteir Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	83.252	0,01
16.600	Daicel Corp	Morgan Stanley	384	0,00
(69.430.143)	Daicel Corp	Goldman Sachs International	11.959	0,00
(4.500)	Daido Steel Co Ltd	Morgan Stanley	2.206	0,00
(400)	Daihen Corp	Morgan Stanley	108	0,00
(2.800)	Dai-ichi Life Holdings Inc	Morgan Stanley	2.597	0,00
208.344.919	Dai-ichi Life Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	221.297	0,01
(3.500)	Daiichikosho Co Ltd	Morgan Stanley	6.190	0,00
71.443.188	Daikin Industries Ltd	Morgan Stanley	47.197	0,00
1.383.459	Daimler AG	Morgan Stanley	46.077	0,00
(3.900)	Daito Trust Construction Co Ltd	Morgan Stanley	505	0,00
241.674	Dali Foods Group Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	1.298	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
1.976.942	Dali Foods Group Co Ltd	Morgan Stanley	12.252	0,00
152.971	Dali Foods Group Co Ltd	Goldman Sachs International	1.234	0,00
97.445	Dana Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.100	Danaher Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.069)	Danone SA	Morgan Stanley	33	0,00
(11.275)	Danske Bank A/S	Morgan Stanley	2.784	0,00
1.002.497	Daqo New Energy Corp	Goldman Sachs International	48.983	0,00
15.725	Daqo New Energy Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(12.700)	Darden Restaurants Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(10.900)	Datadog Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(10.500)	Dave & Buster's Entertainment Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.800)	DaVita Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.296)	DCC Plc	Morgan Stanley	813	0,00
(3.700)	DCM Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	80	0,00
(35.300)	DCP Midstream LP	Morgan Stanley	0	0,00
(1.700)	Deckers Outdoor Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.066	Deere & Co	Morgan Stanley	0	0,00
(51)	Delivery Hero SE	Morgan Stanley	11	0,00
6.200	Dell Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(109.811)	Delta Air Lines Inc	Morgan Stanley	0	0,00
9.400	DeNA Co Ltd	Morgan Stanley	8.676	0,00
(4.703.375)	Denbury Inc	Goldman Sachs International	2.624.702	0,13
(1.946.296)	Denbury Inc	Morgan Stanley	1.405.757	0,07
64.048.107	Denka Co Ltd	Goldman Sachs International	51.202	0,00
41.800	Denny's Corp	Morgan Stanley	0	0,00
51.700	Designer Brands Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(21.891)	Deutsche Bank AG	Morgan Stanley	2.023	0,00
(4.481)	Deutsche EuroShop AG	Morgan Stanley	800	0,00
(584.319)	Deutsche Lufthansa AG	Morgan Stanley	389	0,00
(12.494)	Deutsche Pfandbriefbank AG	Morgan Stanley	1.187	0,00
(3.970.406)	Deutsche Post AG	Goldman Sachs International	932.634	0,04
(1.559.241)	Deutsche Post AG	Morgan Stanley	4.963	0,00
(427)	Deutsche Telekom AG	Morgan Stanley	61	0,00
15.700.000	Deutsche Wohnen SE	Goldman Sachs International	1.135.419	0,05
(837.689)	Devon Energy Corp	Goldman Sachs International	341.368	0,02
17.321	Devon Energy Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.100)	Dexcom Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(858)	Dfds A/S	Morgan Stanley	113	0,00
90.900	DHT Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(1.043)	Dialog Semiconductor Plc	Morgan Stanley	73	0,00
(9.713)	Diamondback Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
5.133	Diamondhead Holdings Corp	Morgan Stanley	5.544	0,00
40.400	DiamondRock Hospitality Co	Morgan Stanley	0	0,00
58.723.876	DIC Corp	Morgan Stanley	11.571	0,00
(201.363)	Dicerna Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	66.425	0,00
(15.558)	Dicerna Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	2.820	0,00
400	Diebold Nixdorf Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(25)	D'ieteren Group	Morgan Stanley	10	0,00
(158.712)	Digimarc Corp	Goldman Sachs International	5.218	0,00
(100)	Digital Arts Inc	Morgan Stanley	100	0,00
18.800	Digital Realty Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.200)	Dillard's Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(5.300)	Dine Brands Global Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.400)	Diodes Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(700)	Dip Corp	Morgan Stanley	171	0,00
(23.890)	Direct Line Insurance Group Plc	Morgan Stanley	2.078	0,00
(135.811.884)	Disco Corp	Morgan Stanley	61.959	0,00
(1.700)	Discover Financial Services	Morgan Stanley	0	0,00
(1.596.925)	Discovery Communications Inc	Goldman Sachs International	3.599	0,00
945.260	Discovery Communications Inc	JPMorgan Chase Bank	159.155	0,01
52.200	Discovery Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.293.308	Discovery Ltd	Goldman Sachs International	29.341	0,00
(7.100)	DISH Network Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
47.600	Diversified Healthcare Trust	Morgan Stanley	0	0,00
395	DKSH Holding AG	Morgan Stanley	51	0,00
(9.000)	DocuSign Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.300)	Dolby Laboratories Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(35.700)	Dominion Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.600)	Domino's Pizza Inc	Morgan Stanley	0	0,00
34.602	Domtar Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(10.200)	Donaldson Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.400)	Dorman Products Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.436.284)	Dover Corp	JPMorgan Chase Bank	256.291	0,01
(114.269)	Dow Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.900)	Dowa Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	471	0,00
(5.500)	DR Horton Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.094.860	DR Horton Inc	Goldman Sachs International	614	0,00
(9.573)	Draegerwerk AG & Co KGaA	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(383)	Draper Esprit Plc	Morgan Stanley	66	0,00
(22.924)	Drax Group Plc	Morgan Stanley	1.965	0,00
1.700	Dril-Quip Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(91)	DSV PANALPINA A/S	Morgan Stanley	192	0,00
(112.283)	Duerr AG	Morgan Stanley	1.044	0,00
1.414.393	Dufry AG	Société Générale	173.901	0,01
(15.400)	Duke Energy Corp	Morgan Stanley	0	0,00
2.283	Dunelm Group Plc	Morgan Stanley	635	0,00
45.180	DuPont de Nemours Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.700)	Duskin Co Ltd	Morgan Stanley	1.839	0,00
13.900	Dycom Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(14.057)	E.ON SE	Morgan Stanley	1.945	0,00
3.000	Eagle Materials Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(200)	Earth Corp	Morgan Stanley	271	0,00
(3.000)	East Japan Railway Co	Morgan Stanley	3.123	0,00
21.700	East West Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(9.400)	EastGroup Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(462.314)	easyJet Plc	Morgan Stanley	531.902	0,03
(10.138)	Eaton Corp Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(700)	Ebara Corp	Morgan Stanley	142	0,00
17.700	EchoStar Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(8)	Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG	Morgan Stanley	20	0,00
(511)	Edenred	Morgan Stanley	678	0,00
(21.800)	Edwards Lifesciences Corp	Morgan Stanley	0	0,00
441.975	Eiffage SA	Goldman Sachs International	12.266	0,00
(2.035)	Eiffage SA	Morgan Stanley	1.152	0,00
(38.114)	Electrolux AB	Morgan Stanley	50	0,00
534.640	Electronic Arts Inc	Goldman Sachs International	6.311	0,00
(105.500)	Element Solutions Inc	Morgan Stanley	0	0,00
29.800	elf Beauty Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(14.100)	Eli Lilly & Co	Morgan Stanley	0	0,00
(10.576.574)	Eli Lilly & Co	Goldman Sachs International	365.192	0,01
30.917	Elis SA	Goldman Sachs International	2.141	0,00
102	Elisa Oyj	Morgan Stanley	1	0,00
497.484	Elkem ASA	Morgan Stanley	0	0,00
289.977	E-Mart Inc	JPMorgan Chase Bank	910	0,00
(10.100)	EMCOR Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.354)	Emerson Electric Co	Morgan Stanley	0	0,00
(19.700)	Empire State Realty Trust Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(300)	en Japan Inc	Morgan Stanley	61	0,00
(48.400)	Enable Midstream Partners LP	Morgan Stanley	0	0,00
(5.402)	Enagas SA	Morgan Stanley	1.270	0,00
23.600	Encompass Health Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(15.700)	Encore Capital Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(6.700)	Encore Wire Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(23.900)	Energy Transfer LP	Morgan Stanley	0	0,00
6.300	Enerpac Tool Group Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(18.200)	EnerSys	Morgan Stanley	0	0,00
(6.600)	Engie SA	Morgan Stanley	459	0,00
169.907	Eni SpA	Goldman Sachs International	5.724	0,00
(269.500)	EnLink Midstream LLC	Morgan Stanley	0	0,00
26.400	Enova International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
12.828	Enphase Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(7.500)	EnPro Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.000)	Ensign Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(36.846)	Entegris Inc	Morgan Stanley	0	0,00
900	Entergy Corp	Morgan Stanley	0	0,00
900	Enterprise Financial Services Corp	Morgan Stanley	0	0,00
13.700	Enterprise Products Partners LP	Morgan Stanley	0	0,00
17.000	EOG Resources Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.900)	EPAM Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(170.089)	Epiroc AB Class A	Morgan Stanley	0	0,00
6.600	ePlus Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(13.400)	EPR Properties	Morgan Stanley	0	0,00
(364)	EQT AB	Morgan Stanley	383	0,00
10.100	EQT Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.700)	Equinix Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(37.946.981)	Equinor ASA	Goldman Sachs International	211.567	0,01
(22.901.533)	Equinor ASA	Morgan Stanley	213.972	0,01
78.900	Equitrans Midstream Corp	Morgan Stanley	0	0,00
33.800	Equity Residential	Morgan Stanley	0	0,00
(144.789)	Erste Group Bank AG	Morgan Stanley	27.731	0,00
13.200	ESCO Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
11.600	Essent Group Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
6.200	Essential Utilities Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.700	Essex Property Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
62.607	Essity AB Class B	Morgan Stanley	0	0,00
(5.783)	Estee Lauder Cos Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(3.214)	Etablissements Franz Colruyt NV	Morgan Stanley	889	0,00
(802.969)	Etsy Inc	Morgan Stanley	154.863	0,01
(11)	Eurofins Scientific SE	Morgan Stanley	23	0,00
5.000	Euronet Worldwide Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.695.787)	Euronext NV	Goldman Sachs International	137.393	0,01
(353)	Euronext NV	Morgan Stanley	475	0,00
1.141.624	Europcar Mobility Group	Goldman Sachs International	50.359	0,00
(16.494)	Eutelsat Communications SA	Morgan Stanley	1.952	0,00
24.400	Evercore Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
5.000	Everest Re Group Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(51.200)	Evergy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
13.400	Eversource Energy	Morgan Stanley	0	0,00
(10.400)	Evo Payments Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
712.376	Evolution Mining Ltd	Morgan Stanley	58.680	0,00
34.503	Evonik Industries AG	Morgan Stanley	273	0,00
33.900	EW Scripps Co	Morgan Stanley	0	0,00
(17.500.000)	Expedia Group Inc	Goldman Sachs International	118.750	0,01
(25.800)	Expeditors International of Washington Inc	Morgan Stanley	0	0,00
442.605	Extra Space Storage Inc	Goldman Sachs International	386	0,00
(18.300)	Extra Space Storage Inc	Morgan Stanley	0	0,00
55.400	Extreme Networks Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(16.372)	Exxon Mobil Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.369.862)	Exxon Mobil Corp	Goldman Sachs International	532.130	0,03
(8.300)	Ezaki Glico Co Ltd	Morgan Stanley	21.180	0,00
(1.177.542)	F&F Co Ltd	Goldman Sachs International	253.699	0,01
6.000	F5 Networks Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(11.100)	Fabrinet	Morgan Stanley	0	0,00
(2.084.069)	Facebook Inc Class A	Goldman Sachs International	96.732	0,01
11.400	FactSet Research Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.000	Fair Isaac Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(88.154.260)	Fanuc Corp	Morgan Stanley	99.479	0,01
(3.500)	FARO Technologies Inc	Morgan Stanley	1.249	0,00
80.189.963	Fast Retailing Co Ltd	Goldman Sachs International	44.363	0,00
700	Fast Retailing Co Ltd	Morgan Stanley	6.622	0,00
(88.736)	Fastenal Co	Morgan Stanley	0	0,00
636.215	Fastly Inc - Class A	Goldman Sachs International	9.781	0,00
5.792	Faurecia SE	JPMorgan Chase Bank	568	0,00
(29.600)	Federal Realty Investment Trust	Morgan Stanley	0	0,00
(19.600)	Federal Signal Corp	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(59.300)	Federated Hermes Inc	Morgan Stanley	0	0,00
16.252	FedEx Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(428.227)	Ferguson PLC	Goldman Sachs International	113.081	0,00
78.927	Ferrari NV	Goldman Sachs International	78.686	0,00
(62.200)	Ferro Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(385.780)	Fiat Chrysler Automobile	JPMorgan Chase Bank	51.710	0,00
(968.908)	Fiat Chrysler Automobile	Morgan Stanley	8.398	0,00
2.700	Fidelity National Information Services Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(226.766)	Fifth Third Bancorp	Goldman Sachs International	2.050	0,00
2.600	Fifth Third Bancorp	Morgan Stanley	0	0,00
169.461	Fila Holdings Corp	Goldman Sachs International	694	0,00
(2.519.228)	Fincombank SpA	Goldman Sachs International	179.490	0,01
77.100	FireEye Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.318.387)	First Citizens BancShares Inc Class A	Goldman Sachs International	255.265	0,01
(1.500)	First Citizens BancShares Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
13.100	First Commonwealth Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(13.000)	First Financial Bancorp	Morgan Stanley	0	0,00
(30.800)	First Financial Bankshares Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(87.300)	First Hawaiian Inc	Morgan Stanley	0	0,00
39.400	First Horizon Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(29.200)	First Industrial Realty Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
16.800	First Interstate BancSystem Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
16.600	First Merchants Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(41.900)	First Midwest Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
721.682	First Republic Bank	Morgan Stanley	8.549	0,00
68.315	First Solar Inc	Morgan Stanley	0	0,00
8.572.367	Fiserv Inc	Goldman Sachs International	144.069	0,00
33.200	Fiserv Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.000	Five9 Inc	Morgan Stanley	0	0,00
183.657	Fix Price Group Ltd	Morgan Stanley	20.931	0,00
250.697	Fix Price Group Ltd	Goldman Sachs International	11.284	0,00
39.270	FleetCor Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.407.029	FleetCor Technologies Inc	Goldman Sachs International	192.418	0,01
1.700	Flex Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
2.500	Floor & Decor Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(259)	Flow Traders	Morgan Stanley	16	0,00
(54.300)	Flowers Foods Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(114.308)	Flowserve Corp	Morgan Stanley	0	0,00
392.563	Flowserve Corp	Goldman Sachs International	21.539	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(165)	Fluidra SA	Morgan Stanley	56	0,00
46.800	Fluor Corp	Morgan Stanley	0	0,00
653.991	Fluor Corp	Goldman Sachs International	40.617	0,00
(4)	Flutter Entertainment Plc	Morgan Stanley	12	0,00
(65.300)	FNB Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(29.800)	Focus Financial Partners Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(400)	Food & Life Cos Ltd	Morgan Stanley	153	0,00
20.900	Foot Locker Inc	Morgan Stanley	0	0,00
54	Forbo Holding AG	Morgan Stanley	99	0,00
(83.651)	Ford Motor Co	Morgan Stanley	0	0,00
34.100	FormFactor Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(692.084)	Fortescue Metals Group Ltd	Morgan Stanley	28.619	0,00
(8.000)	Fortinet Inc	Morgan Stanley	0	0,00
29.668	Fortistar Sustainable Solu Class A	Morgan Stanley	33.229	0,00
4.100	Fortive Corp	Morgan Stanley	0	0,00
2.899.398	Fortive Corp	Goldman Sachs International	14.518	0,00
(3.900)	Fortune Brands Home & Security Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.800	Forward Air Corp	Morgan Stanley	0	0,00
3.364.097	Fox Corp Class A	Goldman Sachs International	39.631	0,00
167.767	Fox Corp Class A	Morgan Stanley	16.202	0,00
6.100	Franklin Electric Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.015.852	Franklin Resources Inc	Goldman Sachs International	57.083	0,00
34.500	Franklin Resources Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(12.416)	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	Morgan Stanley	562	0,00
(1.337)	Frasers Group Plc	Morgan Stanley	50	0,00
(1.162)	Freenet AG	Morgan Stanley	109	0,00
28.669	Freeport-McMoRan Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(385.553)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	JPMorgan Chase Bank	48.430	0,00
(541.020)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Goldman Sachs International	38.782	0,00
(816)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Morgan Stanley	310	0,00
(2.401)	Fresenius SE & Co KGaA	Morgan Stanley	956	0,00
(2.398)	Fresnillo Plc	Morgan Stanley	556	0,00
(58.910)	Frontline Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(52.600)	FS KKR Capital Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(300)	Fuji Corp	Morgan Stanley	39	0,00
(8.800)	Fuji Electric Co Ltd	Morgan Stanley	3.191	0,00
(1.500)	Fuji Kyuko Co Ltd	Morgan Stanley	1.639	0,00
(18.100)	Fuji Media Holdings Inc	Morgan Stanley	5.723	0,00
7.400	FUJIFILM Holdings Corp	Morgan Stanley	18.763	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(1.000)	Fujimi Inc	Morgan Stanley	483	0,00
(1.600)	Fujitec Co Ltd	Morgan Stanley	610	0,00
7.500	Fujitsu General Ltd	Morgan Stanley	5.906	0,00
1.400	Fujitsu Ltd	Morgan Stanley	13.954	0,00
75.000	Fulton Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(5.000)	Furukawa Electric Co Ltd	Morgan Stanley	617	0,00
(132)	Future Plc	Morgan Stanley	51	0,00
452.367	Galaxy Entertainment Group Ltd	Goldman Sachs International	3.131	0,00
475	Gamma Communications Plc	Morgan Stanley	15	0,00
39.900	Gap Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.300	Garmin Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(1.800)	Gartner Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(50.800)	Gates Industrial Corp Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.325.300)	Gazprom OAO	Goldman Sachs International	33.834	0,00
(533.243)	Gazprom PJSC	Goldman Sachs International	102.999	0,01
231.318	GEA Group AG	Morgan Stanley	393	0,00
(3.659)	Generac Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(11.133)	General Dynamics Corp	Morgan Stanley	0	0,00
349.687	General Electric Co	Morgan Stanley	0	0,00
133.530	General Motors Co	Morgan Stanley	0	0,00
(60.400)	Genesis Energy LP	Morgan Stanley	0	0,00
(849.787)	Genius Sports Ltd	Goldman Sachs International	43.884	0,00
(8.259.005)	Genmab A/S	Goldman Sachs International	150.579	0,01
39.400	Gentex Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(4.900)	Gentherm Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.976	Genus Plc	Morgan Stanley	1.087	0,00
169.800	GEO Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(38)	Gerresheimer AG	Morgan Stanley	34	0,00
(686)	Gestamp Automocion SA	Morgan Stanley	37	0,00
(47.164)	Getinge AB	Morgan Stanley	0	0,00
7.200	Gibraltar Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.500	G-III Apparel Group Ltd	Morgan Stanley	154	0,00
(181.835)	Gilead Sciences Inc	Goldman Sachs International	8.037	0,00
(1.924.133)	Gilead Sciences Inc	JPMorgan Chase Bank	163.647	0,01
19.900	Glacier Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.990)	GlaxoSmithKline Plc	Morgan Stanley	168	0,00
10	Global Fashion Group SA	Morgan Stanley	6	0,00
4.400	Global Payments Inc	Morgan Stanley	0	0,00
16.600	Globe Life Inc	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(7.300)	Glory Ltd	Morgan Stanley	842	0,00
2.700	GMO Payment Gateway Inc	Morgan Stanley	10.584	0,00
4.000	GMS Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(447)	GN Store Nord AS	Morgan Stanley	339	0,00
100	GNI Group Ltd	Morgan Stanley	7	0,00
(7.300)	GoDaddy Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(76.000)	Golar LNG Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(2.460.409)	Goldman Sachs Group Inc	Morgan Stanley	872.805	0,04
(3.900)	Goldwin Inc	Morgan Stanley	7.195	0,00
11.400	Graco Inc	Morgan Stanley	0	0,00
81.700	GrafTech International Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(28.440)	Grainger Plc	Morgan Stanley	1.704	0,00
17.700	Grand Canyon Education Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(894)	Grand City Properties SA	Morgan Stanley	313	0,00
(22.000)	Granite Construction Inc	Morgan Stanley	0	0,00
47.446	Graphic Packaging Holding Co	Morgan Stanley	29.816	0,00
(65.000)	Gray Television Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(30.100)	Great Western Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.800)	Gree Inc	Morgan Stanley	1.023	0,00
(1.800)	Greenbrier Cos Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.678.555	Greentown Service Group Co Ltd	Goldman Sachs International	809	0,00
8.100	Greif Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(452)	Grifols SA	Morgan Stanley	49	0,00
36.484	Grifols SA	Goldman Sachs International	66	0,00
277.499	Grifols SA	JPMorgan Chase Bank	16.810	0,00
(7.900)	Group 1 Automotive Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.700	GS Yuasa Corp	Morgan Stanley	611	0,00
15.100	Guardant Health Inc	Morgan Stanley	0	0,00
63.300	Guess? Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(17.300)	Guidewire Software Inc	Morgan Stanley	0	0,00
15.800	GungHo Online Entertainment Inc	Morgan Stanley	2.615	0,00
(34.200)	Gunma Bank Ltd	Morgan Stanley	2.563	0,00
18.300	H&E Equipment Services Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.200)	H2O Retailing Corp	Morgan Stanley	1.287	0,00
(41.400)	Hachijuni Bank Ltd	Morgan Stanley	2.373	0,00
(1.000)	Haemonetics Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(8.000)	Hakuhodo DY Holdings Inc	Morgan Stanley	2.136	0,00
(5)	HAL Trust	Morgan Stanley	1	0,00
502.037	Halliburton Co	Morgan Stanley	21.162	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(7.600)	Hamamatsu Photonics KK	Morgan Stanley	7.826	0,00
(2)	Hamburger Hafen und Logistik AG	Morgan Stanley	1	0,00
1.100	Hamilton Lane Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(151.559)	Hammerson Plc	Morgan Stanley	2.211	0,00
12.300	Hancock Whitney Corp	Morgan Stanley	0	0,00
522.705	Hanesbrands Inc	Goldman Sachs International	21.390	0,00
24.500	Hanesbrands Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(18.500)	Hankyu Hanshin Holdings Inc	Morgan Stanley	33.573	0,00
(3.318.076)	Hannover Rueckversicheru SE	Goldman Sachs International	51.899	0,00
(6.300)	Hanover Insurance Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(600)	Hanwa Co Ltd	Morgan Stanley	67	0,00
2	Hapag-Lloyd AG	Morgan Stanley	1	0,00
(7.500)	Harsco Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.500	Hartford Financial Services Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(80.000)	Hawaiian Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(6.600)	Hazama Ando Corp	Morgan Stanley	163	0,00
2.500	HCA Healthcare Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.400	Health Catalyst Inc	Morgan Stanley	0	0,00
64.800	Healthcare Realty Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
29.600	Healthpeak Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(9.100)	Heartland Express Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.900	Heartland Financial USA Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(11.600)	Hecla Mining Co	Morgan Stanley	0	0,00
(1.300)	HEICO Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
302.886	HeidelbergCement AG	Goldman Sachs International	10.462	0,00
(133.413)	HeidelbergCement AG	Morgan Stanley	3.281	0,00
(1.200)	Heiwa Real Estate Co Ltd	Morgan Stanley	206	0,00
(5.000)	Helen of Troy Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(114.200)	Helix Energy Solutions Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
12.900	Helmerich & Payne Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(34.777)	Henkel AG & Co KGaA	Morgan Stanley	0	0,00
46.168	Hennessy Capital LLC	Morgan Stanley	112.657	0,00
(5.000)	Henry Schein Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(13.200)	Herc Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
14.200	Heritage Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
3.900	Herman Miller Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.722.057)	Herman Miller Inc	Goldman Sachs International	413.325	0,02
700	Hershey Co	Morgan Stanley	0	0,00
3.800	Hess Corp	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
150.700	Hewlett Packard Enterprise Co	Morgan Stanley	0	0,00
417.169	Hexagon AB	Morgan Stanley	175	0,00
(57.302)	Hexcel Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(34.100)	Highwoods Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(34.374)	Hikma Pharmaceuticals Plc	JPMorgan Chase Bank	4.595	0,00
(1.061.079)	Hikma Pharmaceuticals Plc	Goldman Sachs International	16.065	0,00
(159)	Hill & Smith Holdings Plc	Morgan Stanley	22	0,00
26.500	Hilton Grand Vacations Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(11.600)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
94.298.023	Hino Motors Ltd	Goldman Sachs International	30.046	0,00
48.900	Hino Motors Ltd	Morgan Stanley	742	0,00
23.879.242	HIS Co Ltd	Goldman Sachs International	539	0,00
24.628.337	HIS Co Ltd	Morgan Stanley	6.065	0,00
(4.400)	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	Morgan Stanley	14.489	0,00
(1.362)	Hiscox Ltd	Morgan Stanley	46	0,00
2.100	Hitachi Ltd	Morgan Stanley	2.371	0,00
14.200	HNI Corp	Morgan Stanley	0	0,00
71.498	Hochtief AG	Goldman Sachs International	2.750	0,00
(26.300)	Hokkaido Electric Power Co Inc	Morgan Stanley	4.018	0,00
(6.800)	Hokuriku Electric Power Co	Morgan Stanley	677	0,00
(12.500)	Holly Energy Partners LP	Morgan Stanley	0	0,00
26.400	HollyFrontier Corp	Morgan Stanley	0	0,00
22.619	Holmen AB	Morgan Stanley	42	0,00
58.500	Home BancShares Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.500)	Home Depot Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.589.521	Homeserve Plc	Goldman Sachs International	279.411	0,01
(1.563)	HomeServe Plc	Morgan Stanley	229	0,00
(15.213)	Honeywell International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.900)	Hope Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.200	Horace Mann Educators Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(3.000)	Horiba Ltd	Morgan Stanley	2.173	0,00
(864.956)	Horizon Therapeutics Plc	Goldman Sachs International	55.701	0,00
(2.367.165)	Horizon Therapeutics Plc	JPMorgan Chase Bank	305.963	0,02
15.000	Hormel Foods Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(65)	Hornbach Baumarkt AG	Morgan Stanley	31	0,00
(61)	Hornbach Holding AG & Co KGaA	Morgan Stanley	116	0,00
(4.900)	Hoshizaki Corp	Morgan Stanley	20.878	0,00
(1.020.436)	Hotel Shilla Co Ltd	Goldman Sachs International	20.755	0,00
(37.000)	Houlihan Lokey Inc	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
14.800	Howard Hughes Corp	Morgan Stanley	0	0,00
123.382	Howmet Aerospace Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.200)	Hoya Corp	Morgan Stanley	1.253	0,00
75.900	HP Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.799.929	HSBC Holdings Plc	Morgan Stanley	10.460	0,00
2.817.250	HSBC Holdings Plc	Goldman Sachs International	19.466	0,00
20.100	Hub Group Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
8.500	Hubbell Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(100)	HubSpot Inc	Morgan Stanley	0	0,00
36.900	Hudson Pacific Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.929)	HUGO BOSS AG	Morgan Stanley	932	0,00
951	Huhtamaki Oyj	Morgan Stanley	65	0,00
(39.900)	Hulic Co Ltd	Morgan Stanley	20.721	0,00
900	Humana Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3)	Hunter Douglas NV	Morgan Stanley	4	0,00
35.000	Huntington Bancshares Inc	Morgan Stanley	0	0,00
400	Huntington Ingalls Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.967)	Huntsman Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(349.853)	Husqvarna AB	Morgan Stanley	0	0,00
(9.400)	Hyatt Hotels Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
4.800	Hyster-Yale Materials Handling Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(309.436)	Hyundai Motor Co Ltd	Goldman Sachs International	7.711	0,00
(914.574)	IAC Interactivecorp	JPMorgan Chase Bank	0	0,00
(3.494.872)	IAC Interactivecorp	Goldman Sachs International	0	0,00
(400)	Ibiden Co Ltd	Morgan Stanley	204	0,00
1.300	ICF International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(9.100)	Ichigo Inc	Morgan Stanley	671	0,00
3.000	ICU Medical Inc	Morgan Stanley	0	0,00
19.700	IDACORP Inc	Morgan Stanley	0	0,00
60.521.769	Idemitsu Kosan Co Ltd	Morgan Stanley	1.593	0,00
(1.900)	IDEX Corp	Morgan Stanley	0	0,00
4.143.846	IDEX Corp	Goldman Sachs International	50.020	0,00
2.500	IHS Markit Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(12.600)	II-VI Inc	Morgan Stanley	0	0,00
10	Iliad SA	Morgan Stanley	1	0,00
(10.024)	Illinois Tool Works Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.405.437	Illinois Tool Works Inc	Goldman Sachs International	79.109	0,00
8.700	IMAX Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(48)	IMCD NV	Morgan Stanley	96	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
1.138.486	Imperial Oil Ltd	Goldman Sachs International	26.819	0,00
(390.200)	Inchcape Plc	Morgan Stanley	183.397	0,01
436.988	Incyte Corp	JPMorgan Chase Bank	35.137	0,00
(26.400)	Independence Realty Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
328.391	Independent Bank Group Inc	Goldman Sachs International	3.484	0,00
(12.600)	Independent Bank Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(147.583)	Indutrade AB	Morgan Stanley	0	0,00
(1.108.399)	Infineon Technologies AG	Goldman Sachs International	47.170	0,00
(122.800)	Infinera Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.431)	Informa Plc	Morgan Stanley	18	0,00
(15.655)	ING Groep NV	Morgan Stanley	1.061	0,00
(15.000)	Ingredion Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(75.645)	Inhibrx Inc	Goldman Sachs International	17.998	0,00
9.300	Innospec Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.016.230	Innovent Biologics Inc	Goldman Sachs International	1.709	0,00
(12.500)	Insperity Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.100)	Installed Building Products Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(33)	Instone Real Estate Group AG	Morgan Stanley	35	0,00
4.300	Insulet Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.800)	Integer Holdings Corp	Morgan Stanley	0	0,00
23.800	Integra LifeSciences Holdings Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(3.800)	Intel Corp	Morgan Stanley	0	0,00
33.836	Intel Corp	Goldman Sachs International	311	0,00
(170.679)	Intellia Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	211.000	0,01
(2.300)	Inter Parfums Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(235.620)	Intercontinental Exchange Inc	Goldman Sachs International	4.959	0,00
29.700	Intercontinental Exchange Inc	Morgan Stanley	0	0,00
172.196	InterContinental Hotels Group Plc	Goldman Sachs International	3.706	0,00
1.700	InterDigital Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(46.400)	Interface Inc	Morgan Stanley	0	0,00
20.500	International Bancshares Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(841.753)	International Flavors & Fragrances Inc	Goldman Sachs International	52.357	0,00
49.793	International Flavors & Fragrances Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.587.999)	International Flavors & Fragrances Inc	JPMorgan Chase Bank	316.782	0,02
(107.197)	International Paper Co	Morgan Stanley	0	0,00
1.490.127	Interpublic Group of Cos Inc	Goldman Sachs International	13.026	0,00
279.339	Interpublic Group of Cos Inc	JPMorgan Chase Bank	0	0,00
(908.689)	Interpublic Group of Cos Inc	Morgan Stanley	229.615	0,01
33	Intertrust NV	Morgan Stanley	2	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(2.800)	Intuit Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.677.114)	Intuit Inc	Goldman Sachs International	179.149	0,01
(63.573)	Invesco Ltd	Goldman Sachs International	8.265	0,00
80.600	Invesco Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(22.477)	Investec Plc	Morgan Stanley	2.177	0,00
(93.000)	Investors Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.900)	Invitae Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(15.400)	Invitation Homes Inc	Morgan Stanley	0	0,00
200	IPG Photonics Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(61)	IPSOS	Morgan Stanley	5	0,00
900	iRobot Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(15.200)	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	Morgan Stanley	3.884	0,00
167.279	ITM Power Plc	Goldman Sachs International	110.323	0,01
(3.900)	Ito En Ltd	Morgan Stanley	7.305	0,00
15.600	Itochu Techno-Solutions Corp	Morgan Stanley	9.398	0,00
(10.400)	Itron Inc	Morgan Stanley	0	0,00
9.800	ITT Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(35.426)	ITV Plc	Morgan Stanley	476	0,00
(39.750.709)	Iwatani Corp	Morgan Stanley	7.831	0,00
(44.056.265)	Iwatani Corp	Goldman Sachs International	5.037	0,00
(20.909)	IWG Plc	Morgan Stanley	951	0,00
(25.100)	Iyo Bank Ltd	Morgan Stanley	60	0,00
(7.200)	J & J Snack Foods Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(427)	JD Wetherspoon Plc	Morgan Stanley	69	0,00
(600)	JM Smucker Co	Morgan Stanley	0	0,00
10.000.600	J2 Global Inc	Morgan Stanley	1.036.000	0,05
(60.700)	Jabil Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.500	Jack Henry & Associates Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(500)	Jack in the Box Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.500)	Jacobs Engineering Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.700)	JAFCO Group Co Ltd	Morgan Stanley	4.974	0,00
12.200	Janus Henderson Group Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(14.100)	Japan Airlines Co Ltd	Morgan Stanley	12.944	0,00
(2.200)	Japan Airport Terminal Co Ltd	Morgan Stanley	4.326	0,00
(23.500)	Japan Exchange Group Inc	Morgan Stanley	25.361	0,00
(12.300)	Japan Post Insurance Co Ltd	Morgan Stanley	4.441	0,00
(100)	Japan Steel Works Ltd	Morgan Stanley	57	0,00
109.107.809	Japan Tobacco Inc	Goldman Sachs International	43.806	0,00
12.461	Jaws Mustang	Morgan Stanley	15.701	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(14.002)	JB Hunt Transport Services Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.639.981)	JD.com Inc Class A	Goldman Sachs International	42.012	0,00
(6.100)	Jefferies Financial Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.500)	JELD-WEN Holding Inc	Morgan Stanley	959	0,00
(1.097)	Jenoptik AG	Morgan Stanley	450	0,00
(1.500.783)	Jeronimo Martins SGPS SA	Morgan Stanley	108.595	0,01
67.300	JetBlue Airways Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(6.987)	JinkoSolar Holding Co Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(1.209.712)	Jiumaojiu International Holdings Ltd	Morgan Stanley	16.867	0,00
(2.743.450)	Jiumaojiu International Holdings Ltd	Goldman Sachs International	18.144	0,00
(300)	John Bean Technologies Corp	Morgan Stanley	0	0,00
23.200	Johnson & Johnson	Morgan Stanley	0	0,00
2.852.161	Johnson & Johnson	Goldman Sachs International	40.254	0,00
(2.895.538)	Johnson Controls International Plc	JPMorgan Chase Bank	422.052	0,02
16.484	Johnson Controls International Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.045.193)	Johnson Controls International Plc	Goldman Sachs International	150.437	0,01
(2.900)	JPMorgan Chase & Co	Morgan Stanley	0	0,00
100	JTOWER Inc	Morgan Stanley	104	0,00
(65.800)	Juniper Networks Inc	Morgan Stanley	0	0,00
36.713	Jupiter Fund Management Plc	Morgan Stanley	1.835	0,00
(2.832)	Just Group Plc	Morgan Stanley	3	0,00
(3.570)	Jyske Bank A/S	Morgan Stanley	1.234	0,00
(8.400)	Kagome Co Ltd	Morgan Stanley	2.610	0,00
900	Kaiser Aluminum Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(5.600)	Kaken Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	1.942	0,00
2.800	Kaman Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(4.300)	Kanamoto Co Ltd	Morgan Stanley	1.901	0,00
(3.000)	Kandenko Co Ltd	Morgan Stanley	905	0,00
5.450.210	Kaneka Corp	Goldman Sachs International	733	0,00
(42.900)	Kansai Electric Power Co Inc	Morgan Stanley	3.020	0,00
118.573.736	Kansai Paint Co Ltd	Goldman Sachs International	25.468	0,00
(18.000)	Kansai Paint Co Ltd	Morgan Stanley	12.410	0,00
100	Kansas City Southern	Morgan Stanley	2.736	0,00
(3.919.280)	Kanzhun Ltd	Morgan Stanley	11.154	0,00
1.800	Kao Corp	Morgan Stanley	1.689	0,00
115.835.342	Kao Corp	Goldman Sachs International	21.542	0,00
(113.682)	Karoon Energy Ltd	Morgan Stanley	25.621	0,00
(100)	Katitas Co Ltd	Morgan Stanley	14	0,00
300	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	Morgan Stanley	693	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
4.800	KB Home	Morgan Stanley	0	0,00
(518)	KBC Group NV	Morgan Stanley	204	0,00
25.300	KBR Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.100)	Keihan Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	3.247	0,00
(16.300)	Keikyu Corp	Morgan Stanley	4.881	0,00
(6.100)	Keio Corp	Morgan Stanley	19.489	0,00
(12.700)	Keisei Electric Railway Co Ltd	Morgan Stanley	12.803	0,00
400	Kellogg Co	Morgan Stanley	0	0,00
1.000	Kelly Services Inc	Morgan Stanley	0	0,00
573	Kemira Oyj	Morgan Stanley	48	0,00
4.000	Kemper Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(97.687)	Kennametal Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(648.683)	Keppel Corp Ltd	Morgan Stanley	2.929	0,00
31.021	Kerry Group Plc Class A	Goldman Sachs International	218.080	0,01
(4.727)	Kesko Oyj	Morgan Stanley	838	0,00
(611.548)	Keurig Dr Pepper Inc	Goldman Sachs International	37.300	0,00
139.700	KeyCorp	Morgan Stanley	0	0,00
(211.511)	KeyCorp	Goldman Sachs International	100	0,00
200	Keyence Corp	Morgan Stanley	714	0,00
(10.200)	Keysight Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(141)	Keywords Studios Plc	Morgan Stanley	25	0,00
(5.600)	Kforce Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.900)	KH Neochem Co Ltd	Morgan Stanley	590	0,00
(686.791)	Kia Corp	Goldman Sachs International	12.421	0,00
(1.900)	Kikkoman Corp	Morgan Stanley	1.928	0,00
(15.400)	Kilroy Realty Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.135.774	Kimberly-Clark Corp	Goldman Sachs International	8.073	0,00
142.400	Kimco Realty Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.400)	Kinden Corp	Morgan Stanley	174	0,00
(3.706.551)	Kinder Morgan Inc	Goldman Sachs International	177.074	0,01
81.200	Kinder Morgan Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(114)	Kinopolis Group NV	Morgan Stanley	153	0,00
1.287.666	Kingsoft Cloud Holdings Ltd	Goldman Sachs International	101.198	0,01
(15.700)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	8.697	0,00
296.826	Kirby Corp	Goldman Sachs International	31.309	0,00
(1.399.388)	KKR & Co Inc	Goldman Sachs International	57.719	0,00
3.100	KKR & Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.600	KLA Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.776)	Klepierre SA	Morgan Stanley	763	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(10.213)	Kloeckner & Co SE	Morgan Stanley	436	0,00
(111.201)	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(11.400)	Knoll Inc	Morgan Stanley	0	0,00
26.500	Knowles Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(3.800)	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	5.386	0,00
9.200	Kobe Bussan Co Ltd	Morgan Stanley	17.157	0,00
152.112.585	Kobe Steel Ltd	Goldman Sachs International	122.150	0,01
300	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	350	0,00
16.900	Kohl's Corp	Morgan Stanley	0	0,00
300	Kohnan Shoji Co Ltd	Morgan Stanley	375	0,00
(130)	Kojamo Oyj	Morgan Stanley	42	0,00
(7.500)	Kokuyo Co Ltd	Morgan Stanley	6.815	0,00
(1.700)	KOMEDA Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	4	0,00
(1.100)	Komeri Co Ltd	Morgan Stanley	3	0,00
68.352.280	Konami Holdings Corp	Goldman Sachs International	20.985	0,00
(124.427)	Kone Oyj Class B	Morgan Stanley	532	0,00
122.024	Konecranes OYJ	Morgan Stanley	9	0,00
247.518	Koninklijke KPN NV	Goldman Sachs International	34.164	0,00
924.244	Koninklijke Philips NV	Morgan Stanley	105.948	0,01
752.089	Koninklijke Philips NV	Goldman Sachs International	103.860	0,01
569.048	Koninklijke Vopak NV	Goldman Sachs International	34.590	0,00
(696)	Koninklijke Vopak NV	Morgan Stanley	43	0,00
6.100	Korn Ferry	Morgan Stanley	0	0,00
(2.400)	Kose Corp	Morgan Stanley	14.207	0,00
80.146	Kosmos Energy Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(400)	Kotobuki Spirits Co Ltd	Morgan Stanley	889	0,00
30.900	Kraft Heinz Co	Morgan Stanley	0	0,00
(6.802)	Kratos Defense & Security Solutions Inc	Morgan Stanley	17.869	0,00
(65.100)	Kroger Co	Morgan Stanley	0	0,00
(62)	Krones AG	Morgan Stanley	165	0,00
9.547.496	Kuaishou Technology	Goldman Sachs International	191.275	0,01
(21.400)	Kulicke & Soffa Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
500.102	Kumho Petro Chemical Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	2.890	0,00
54.571	Kumho Petrochemical Co Ltd	Goldman Sachs International	400	0,00
97.042.491	Kuraray Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	173.209	0,01
30.467.311	Kuraray Co Ltd	Goldman Sachs International	14.224	0,00
(9.500)	Kuraray Co Ltd	Morgan Stanley	2.900	0,00
(2.900)	Kusuri no Aoki Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	11.074	0,00
(217.543)	Kweichow Moutai Co Ltd Class A	Goldman Sachs International	4.570	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(300)	KYB Corp	Morgan Stanley	173	0,00
(3.200)	KYORIN Holdings Inc	Morgan Stanley	8	0,00
(300)	Kyoritsu Maintenance Co Ltd	Morgan Stanley	759	0,00
(16.600)	Kyowa Exeo Corp	Morgan Stanley	3.234	0,00
(19.900)	Kyushu Electric Power Co Inc	Morgan Stanley	3.474	0,00
(30.000)	Kyushu Financial Group Inc	Morgan Stanley	1.354	0,00
(11.700)	Kyushu Railway Co	Morgan Stanley	2.499	0,00
(300)	L Brands Inc	Morgan Stanley	0	0,00
62	Laboratorios Farmaceuticos Rovi SA	Morgan Stanley	65	0,00
100	Laboratory Corp of America Holdings	Morgan Stanley	0	0,00
(271.142)	Lafargeholcim Ltd	Goldman Sachs International	2.000	0,00
(16.800)	Lakeland Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
5.400	Lakeland Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.100	Lam Research Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(767.485)	Lamar Advertising Co Class A	Goldman Sachs International	39.087	0,00
(479.471)	Lamar Advertising Co Class A	Morgan Stanley	115.504	0,01
12.100	Lamb Weston Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(7.700)	Lancaster Colony Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(6.379)	Land Securities Group Plc	Morgan Stanley	660	0,00
643.807	Lanxess AG	Morgan Stanley	60.823	0,00
1.030.913	Lanxess AG	Goldman Sachs International	69.909	0,00
31.300	Las Vegas Sands Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(300)	Lasertec Corp	Morgan Stanley	3.462	0,00
(11.600)	Lattice Semiconductor Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(35.200)	Laureate Education Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(5.600)	Lazard Ltd Class A	Morgan Stanley	0	0,00
838.695	Lazard Ltd Class A	Goldman Sachs International	1.441	0,00
36.000	La-Z-Boy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(31.865)	Lear Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(4.841)	Legal & General Group Plc	Morgan Stanley	371	0,00
(269)	Legend Holdings Corp (Right, 31/12/2021)	Morgan Stanley	0	0,00
2.245.029	Leggett & Platt Inc	Goldman Sachs International	40.433	0,00
(12.700)	Leggett & Platt Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(834.831)	Legrand SA	Goldman Sachs International	44.193	0,00
(1.200)	Leidos Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(23.400)	Lennar Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(4.833)	Lennox International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(546.250)	Leonardo SpA	Goldman Sachs International	278.704	0,01
28.700	Levi Strauss & Co Class A	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(2.975.967)	LG Chem Ltd	Goldman Sachs International	10.525	0,00
(579.049)	LG Household & Health Care Ltd	Goldman Sachs International	46.400	0,00
4.400	LGI Homes Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.400)	LHC Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
16.914	Liberty Broadband Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.877.725)	Liberty Global Plc Class A	JPMorgan Chase Bank	123.123	0,01
(2.765.780)	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM Class A	Goldman Sachs International	58.129	0,00
(206.073)	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM Class C	Goldman Sachs International	2.676	0,00
35.700	Liberty Oilfield Services Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(3.188.042)	Life Healthcare Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	45.027	0,00
(243.275)	Life Healthcare Group Holdings Ltd	Goldman Sachs International	1.382	0,00
(26.800)	Life Storage Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(24.413)	Lincoln Electric Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
27.300	Lincoln National Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(6.423)	Linde Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.900)	Lindsay Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(185.018)	Lithia Motors Inc Class A	Morgan Stanley	6.603	0,00
6.500	Littelfuse Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.700)	Live Nation Entertainment Inc	Morgan Stanley	0	0,00
14.300	Live Oak Bancshares Inc	Morgan Stanley	0	0,00
21.300	Livent Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(8.200)	LivePerson Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(22.000)	LKQ Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.508.106)	Lloyds Banking Group Plc	Goldman Sachs International	91.840	0,01
(193.968)	Lloyds Banking Group Plc	Morgan Stanley	1.151	0,00
(6.675)	Lockheed Martin Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.466.065)	London Stock Exchange Group Plc	Goldman Sachs International	317.680	0,02
(8.895)	LondonMetric Property Plc	Morgan Stanley	686	0,00
374.745	Longfor Group Holdings Ltd	Goldman Sachs International	1.738	0,00
26.943	Loomis AB	Morgan Stanley	0	0,00
33.678	Lotte Chemical Corp	Morgan Stanley	2.113	0,00
354.822	Lotte Chemical Corp	JPMorgan Chase Bank	44.047	0,00
347.735	Lotte Shopping Co Ltd	Goldman Sachs International	13.699	0,00
181.909	Louisiana-Pacific Corp	Morgan Stanley	0	0,00
3.600	Lowe's Cos Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(800.571)	Lowe's Cos Inc	Goldman Sachs International	68.373	0,00
(1.621.694)	LPL Financial Holdings Inc	Goldman Sachs International	18.623	0,00
30.400	LTC Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.078.331)	Lukoil PJSC	Goldman Sachs International	98.020	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(3.700)	Lululemon Athletica Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(16.800)	Lumen Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.100	Lumentum Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.802.348)	Lyft Inc Class A	Goldman Sachs International	156.221	0,01
(29.000)	Lyft Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
29.377	LyondellBasell Industries NV Class A	Morgan Stanley	0	0,00
12.900	M/I Homes Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.600	M3 Inc	Morgan Stanley	13.247	0,00
(5.400)	Mabuchi Motor Co Ltd	Morgan Stanley	5.566	0,00
(83.300)	Macerich Co	Morgan Stanley	0	0,00
24.800	Mack-Cali Realty Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(27.200)	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
350.914	Macquarie Infrastructure Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(17.200)	Macy's Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(100)	Madison Square Garden Entertainment Corp	Morgan Stanley	0	0,00
899.682	Madison Square Garden Sports Corp Class A	Goldman Sachs International	16.439	0,00
9.200	Madison Square Garden Sports Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(4.800)	Maeda Road Construction Co Ltd	Morgan Stanley	1.034	0,00
(6.900)	Magellan Health Inc	Morgan Stanley	18	0,00
14.600	Magellan Midstream Partners LP	Morgan Stanley	0	0,00
11.269	Magna International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.370)	Magnitogorsk Iron & Steel Works PJSC	JPMorgan Chase Bank	8	0,00
(2.000)	Mandom Corp	Morgan Stanley	556	0,00
7.500	Manhattan Associates Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(6.100)	Mani Inc	Morgan Stanley	389	0,00
(996.188)	Manitowoc Co Inc	Goldman Sachs International	180.809	0,01
(43.277)	ManpowerGroup Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(12.800)	ManTech International Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(21.427)	Mapfre SA	Morgan Stanley	5	0,00
24.700	Marathon Oil Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(646.128)	Marathon Oil Corp	Goldman Sachs International	84.242	0,01
(7.100)	Marcus & Millichap Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(94.505)	Marks & Spencer Group Plc	Morgan Stanley	5.148	0,00
8.008.417	Marriott International Inc Class A	Goldman Sachs International	435.425	0,02
12.100	Marriott International Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(35.900)	Marsh & McLennan Cos Inc	Morgan Stanley	0	0,00
11.356	Marshalls Plc	Morgan Stanley	349	0,00
(10.661)	Martin Marietta Materials Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.633.526)	Martin Marietta Materials Inc	JPMorgan Chase Bank	289.423	0,01

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(2.500)	Maruha Nichiro Corp	Morgan Stanley	936	0,00
(6.200)	Maruichi Steel Tube Ltd	Morgan Stanley	10.275	0,00
(4.200)	Maruwa Unyu Kikan Co Ltd	Morgan Stanley	53	0,00
12.407	Marvell Technology Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.689.771)	Marvell Technology Inc	Goldman Sachs International	388.098	0,02
14.900	Masco Corp	Morgan Stanley	0	0,00
616.599	Masco Corp	Goldman Sachs International	41.205	0,00
5.400	Masonite International Corp	Morgan Stanley	0	0,00
11.800	MasTec Inc	Morgan Stanley	0	0,00
11.700	Mastercard Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(7.685.061)	Mastercard Inc Class A	Goldman Sachs International	22.768	0,00
(10.900)	Matador Resources Co	Morgan Stanley	0	0,00
(6.674.836)	Match Group Inc	Goldman Sachs International	732.762	0,03
(23.700)	Matsui Securities Co Ltd	Morgan Stanley	3.699	0,00
(2.900)	Matsumotokiyoshi Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	1.422	0,00
(875)	Maxeon Solar Technologies Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(6.700)	Maxim Integrated Products Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.800)	Maximus Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.900	McCormick & Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.100	McDonald's Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.600	McKesson Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(51.757)	McPhy Energy SA	Goldman Sachs International	168.667	0,01
20.144	MDC Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
98.800	MDU Resources Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(181.900)	Mebuki Financial Group Inc	Morgan Stanley	486	0,00
(16.300)	Medallia Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.954	Mediaset Espana Comunicacion SA	Morgan Stanley	121	0,00
1.546.009	MediaTek Inc	Goldman Sachs International	3.782	0,00
(8.900)	Medipal Holdings Corp	Morgan Stanley	4.409	0,00
(2.500)	MEDNAX Inc	Morgan Stanley	0	0,00
400	MedPeer Inc	Morgan Stanley	120	0,00
6.700	Medtronic Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(741.783)	Meggitt Plc	Morgan Stanley	398.712	0,02
(6.600)	Megmilk Snow Brand Co Ltd	Morgan Stanley	5.819	0,00
(900)	Meidensha Corp	Morgan Stanley	236	0,00
(4.600)	MEIJI Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	6.263	0,00
(2.100)	Meitec Corp	Morgan Stanley	5.322	0,00
27.900.000	Meituan	Morgan Stanley	1.564.370	0,07
(2.417.496)	Meituan Class B	Goldman Sachs International	34.183	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(2.964)	Melia Hotels International SA	Morgan Stanley	161	0,00
600	MercadoLibre Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(50.100)	Merck & Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(165.769)	Merck KGaA	JPMorgan Chase Bank	3.373	0,00
(2)	Merck KGaA	Morgan Stanley	1	0,00
20.600	Mercury General Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(6.800)	Mercury Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(33.600)	Meredith Corp	Morgan Stanley	0	0,00
7.300	Merit Medical Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
13.700	Meritage Homes Corp	Morgan Stanley	0	0,00
44.800	Meritor Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(6.800)	Meta Financial Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.200)	METAWATER Co Ltd	Morgan Stanley	1.261	0,00
(18.500)	Methode Electronics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(442.838)	MetLife Inc	Goldman Sachs International	2.833	0,00
23.700	MetLife Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.817	Metropole Television SA	Morgan Stanley	801	0,00
5.578	Metsa Board Oyj	Morgan Stanley	3	0,00
535.218	Metso Outotec Oyj	Morgan Stanley	0	0,00
(100)	Mettler-Toledo International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.884.019	Meyer Burger Technology AG	Goldman Sachs International	189.855	0,01
(7.900)	MGE Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
17.400	MGIC Investment Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(67.700)	MGM Resorts International	Morgan Stanley	0	0,00
9.200	Microchip Technology Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(459.943)	Microchip Technology Inc	Goldman Sachs International	12.158	0,00
(454.189)	Micron Technology Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.025.002)	Micron Technology Inc	Goldman Sachs International	180.099	0,01
(11.730.713)	Microsoft Corp	Goldman Sachs International	755.428	0,04
4.800	Mid-America Apartment Communities Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.159.538)	Middleby Corp	JPMorgan Chase Bank	174.616	0,01
1.000	Middleby Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(3.219.116)	Middleby Corp	Goldman Sachs International	48.140	0,00
(500)	Middlesex Water Co	Morgan Stanley	0	0,00
(2.800)	Mimasu Semiconductor Industry Co Ltd	Morgan Stanley	1.126	0,00
(5.200)	Mimecast Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(6.000)	Minerals Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(800)	MISUMI Group Inc	Morgan Stanley	379	0,00
(990)	Mitchells & Butlers Plc	Morgan Stanley	65	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(20.309.495)	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	Goldman Sachs International	9.413	0,00
(208.784.238)	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	JPMorgan Chase Bank	373.896	0,02
(31.484.967)	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	Morgan Stanley	32.662	0,00
(265.199.768)	Mitsubishi Corp	Goldman Sachs International	32.416	0,00
(900)	Mitsubishi Corp	Morgan Stanley	90	0,00
(10.700)	Mitsubishi Electric Corp	Morgan Stanley	9.502	0,00
(10.200)	Mitsubishi Estate Co Ltd	Morgan Stanley	5.059	0,00
5.464.907	Mitsubishi Estate Co Ltd	Goldman Sachs International	706	0,00
96.476.978	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Goldman Sachs International	52.342	0,00
(13.400)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Morgan Stanley	10.819	0,00
(8.900)	Mitsubishi Logistics Corp	Morgan Stanley	15.754	0,00
(800)	Mitsubishi Materials Corp	Morgan Stanley	78	0,00
100.800	Mitsubishi Motors Corp	Morgan Stanley	5.077	0,00
(37.600)	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	Morgan Stanley	2.864	0,00
(2.600)	Mitsui & Co Ltd	Morgan Stanley	682	0,00
1.400	Mitsui Chemicals Inc	Morgan Stanley	755	0,00
(163.846.985)	Mitsui Chemicals Inc	Goldman Sachs International	54.052	0,00
(2.800)	Mitsui Fudosan Co Ltd	Morgan Stanley	1.323	0,00
(900)	Mitsui Mining & Smelting Co Ltd	Morgan Stanley	671	0,00
199.878.143	Mitsui Mining & Smelting Co Ltd	Goldman Sachs International	258.453	0,01
1.400	Mitsui OSK Lines Ltd	Morgan Stanley	2.686	0,00
(4.300)	Miura Co Ltd	Morgan Stanley	3.926	0,00
200	Mixi Inc	Morgan Stanley	44	0,00
(41.300)	Mizuho Financial Group Inc	Morgan Stanley	6.234	0,00
11.100	MKS Instruments Inc	Morgan Stanley	0	0,00
879.258	MMC Norilsk Nickel OJSC	Morgan Stanley	715	0,00
11.800	Model N Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(37.200)	Moelis & Co Class A	Morgan Stanley	0	0,00
8.300	Mohawk Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.200	Molina Healthcare Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(16.800)	Molson Coors Beverage Co	Morgan Stanley	0	0,00
(47.200)	Momentive Global Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(883.751)	Momo Inc	Goldman Sachs International	71.026	0,00
(1.286.784)	Mondelez International Inc Class A	Goldman Sachs International	61.087	0,00
(11.100)	Mondelez International Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(34.705)	Mondi Plc	Morgan Stanley	26.635	0,00
1.300	Monex Group Inc	Morgan Stanley	338	0,00
(6.177)	Moneysupermarket.com Group Plc	Morgan Stanley	433	0,00
(5.000)	MongoDB Inc	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(1.900)	Monolithic Power Systems Inc	Morgan Stanley	8.962	0,00
(2.250.439)	Monolithic Power Systems Inc	Goldman Sachs International	167.507	0,01
3.000	MonotaRO Co Ltd	Morgan Stanley	1.467	0,00
22.400	Monster Beverage Corp	Morgan Stanley	0	0,00
23.387	Monte Rosa Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	86.532	0,01
(12.300)	Moody's Corp	Morgan Stanley	0	0,00
8.700	Moog Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(2.077.434)	Morgan Stanley	Goldman Sachs International	143.201	0,01
8.900	Morningstar Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(261)	MorphoSys AG	Morgan Stanley	406	0,00
55.292	Mosaic Co	Morgan Stanley	0	0,00
(1.612)	Mowi ASA	Morgan Stanley	472	0,00
(1.415.150)	MPLX LP	Goldman Sachs International	495.425	0,02
2.200	MPLX LP	Morgan Stanley	0	0,00
4.300	MRC Global Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(18.900)	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Morgan Stanley	9.516	0,00
(37.854)	MSC Industrial Direct Co Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(7.400)	MSCI Inc	Morgan Stanley	0	0,00
438.747	MSCI Inc	Goldman Sachs International	2.441	0,00
6.200	Mueller Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
33.700	Mueller Water Products Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
700	Murata Manufacturing Co Ltd	Morgan Stanley	1.245	0,00
(13.400)	Murphy Oil Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.600)	Nabors Industries Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(9.600)	Nankai Electric Railway Co Ltd	Morgan Stanley	7.633	0,00
(17.600)	Nasdaq Inc	Morgan Stanley	0	0,00
15.700	National Bank Holdings Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(3.385)	National Express Group Plc	Morgan Stanley	174	0,00
(23.400)	National Fuel Gas Co	Morgan Stanley	0	0,00
(6.367)	National Grid Plc	Morgan Stanley	333	0,00
4.800	National Instruments Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(200)	National Retail Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(6.513)	Natixis SA	Morgan Stanley	76	0,00
(117.900)	Navient Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(26.700)	Navistar International Corp	Morgan Stanley	0	0,00
13.800	NBT Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
19.700	NCR Corp	Morgan Stanley	0	0,00
10.200	NEC Corp	Morgan Stanley	18.565	0,00
(2.200)	NEC Networks & System Integration Corp	Morgan Stanley	35	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(5.997.381)	Nedbank Group Ltd	Goldman Sachs International	49.172	0,00
800	Neenah Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.500	Nelnet Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6	Neoen SA	Morgan Stanley	2	0,00
(5.700)	NeoGenomics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.428.756	Neste Oil Oyj	Goldman Sachs International	479	0,00
741.740	Neste Oil Oyj	Morgan Stanley	3.503	0,00
(120)	Nestle SA	Morgan Stanley	151	0,00
(3.373.837)	Nestle SA	Goldman Sachs International	164.215	0,01
300	NET One Systems Co Ltd	Morgan Stanley	32	0,00
(6.100)	NetApp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.993.561)	Netflix Inc	Goldman Sachs International	111.061	0,01
8.500	NETGEAR Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.500)	NetScout Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.949.491	Neurocrine Biosciences Inc	Goldman Sachs International	18.213	0,00
(6.200)	Nevro Corp	Morgan Stanley	0	0,00
31.600	New Jersey Resources Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(553.034)	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	Morgan Stanley	0	0,00
(14.700)	New Relic Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.216.148)	New World Development Co Ltd	Morgan Stanley	4.333	0,00
2.144.359	New York Times Co Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
26.500	Newmark Group Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
1.900	NewMarket Corp	Morgan Stanley	0	0,00
940	Nexans SA	Morgan Stanley	1.273	0,00
(2.459.029)	NexGen Energy Ltd	JPMorgan Chase Bank	213.456	0,01
7.222.003	Nexi SpA	Goldman Sachs International	1.102.719	0,06
(8.800)	NexPoint Residential Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.200)	Nexstar Media Group Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
819.689	Nexstar Media Group Inc Class A	Goldman Sachs International	2.302	0,00
7.678	NextEra Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(9.300)	NextEra Energy Partners LP	Morgan Stanley	1.699	0,00
36.900	NextGen Healthcare Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(800)	NGK Insulators Ltd	Morgan Stanley	377	0,00
228.500	NGL Energy Partners LP	Morgan Stanley	0	0,00
(21.500)	NHK Spring Co Ltd	Morgan Stanley	1.678	0,00
(4.500)	Nichirei Corp	Morgan Stanley	539	0,00
2.700	Nidec Corp	Morgan Stanley	2.489	0,00
686.080	Nielsen Holdings Plc	Goldman Sachs International	27.462	0,00
(4.100)	Nihon Kohden Corp	Morgan Stanley	854	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
10.800	Nihon Unisys Ltd	Morgan Stanley	7.611	0,00
(9.084.828)	NIKE Inc Class B	Goldman Sachs International	56.384	0,00
87.370.032	Nikkei 225 (SGX)	Morgan Stanley	10.362	0,00
(18.600)	Nikon Corp	Morgan Stanley	4.176	0,00
(63.094.925)	Nintendo Co Ltd	Morgan Stanley	71.952	0,00
(1.400)	Nippo Corp	Morgan Stanley	564	0,00
(3.800)	Nippon Express Co Ltd	Morgan Stanley	4.259	0,00
100	Nippon Gas Co Ltd	Morgan Stanley	45	0,00
(12.900)	Nippon Kayaku Co Ltd	Morgan Stanley	774	0,00
55.438.248	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Goldman Sachs International	21.550	0,00
120.287.071	Nippon Paint Holdings Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	4.108	0,00
13.200	Nippon Sanso Holdings Corp	Morgan Stanley	13.006	0,00
(6.000)	Nippon Shinyaku Co Ltd	Morgan Stanley	2.875	0,00
(3.200)	Nippon Shokubai Co Ltd	Morgan Stanley	7.240	0,00
(6.400)	Nippon Steel Corp	Morgan Stanley	1.494	0,00
16.300	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Morgan Stanley	810	0,00
600	Nippon Yusen KK	Morgan Stanley	145	0,00
(44.300)	NiSource Inc	Morgan Stanley	0	0,00
121.310.083	Nissan Chemical Corp	JPMorgan Chase Bank	68.790	0,00
7.420.216	Nissan Chemical Corp	Goldman Sachs International	3.149	0,00
825.185	Nissan Motor Co Ltd	Morgan Stanley	25.886	0,00
(7.500)	Nisshin Seifun Group Inc	Morgan Stanley	1.657	0,00
3.600	Nisshinbo Holdings Inc	Morgan Stanley	29	0,00
(57.867.875)	Nisshinbo Holdings Inc	Goldman Sachs International	14.631	0,00
(2.100)	Nissin Foods Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	2.462	0,00
1.600	Nitori Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	5.806	0,00
(600)	Nitto Boseki Co Ltd	Morgan Stanley	815	0,00
69.167.225	Nitto Denko Corp	Goldman Sachs International	18.257	0,00
203.889.118	Nitto Denko Corp	JPMorgan Chase Bank	44.627	0,00
(169.619)	Nkarta Inc	Goldman Sachs International	7.248	0,00
(65)	NKT A/S	Morgan Stanley	16	0,00
2.610.858	NN Group NV	Goldman Sachs International	194.344	0,01
(2.536)	NN Group NV	Morgan Stanley	1.607	0,00
(5.900)	NOF Corp	Morgan Stanley	5.093	0,00
15.400	NOK Corp	Morgan Stanley	4.946	0,00
(29.207)	Nokia Oyj	Morgan Stanley	1.947	0,00
(2.800)	Nomura Co Ltd	Morgan Stanley	442	0,00
(5.300)	Nomura Real Estate Holdings Inc	Morgan Stanley	5.114	0,00
9.500	Nomura Research Institute Ltd	Morgan Stanley	4.737	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(37.347.885)	Nordea Bank Abp	Goldman Sachs International	4.783.343	0,22
(118)	Nordic Semiconductor ASA	Morgan Stanley	45	0,00
(7.042.136)	Nordnet Ab Publ	Goldman Sachs International	38.592	0,00
(9.700)	Nordson Corp	Morgan Stanley	0	0,00
15.100	Nordstrom Inc	Morgan Stanley	0	0,00
17.592	Norfolk Southern Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(7.015)	Norsk Hydro ASA	Morgan Stanley	200	0,00
1	Northern Data AG	Morgan Stanley	2	0,00
(214.952)	Northern Trust Corp	Goldman Sachs International	11.767	0,00
(6.234)	Northrop Grumman Corp	Morgan Stanley	0	0,00
14.300	Northwest Bancshares Inc	Morgan Stanley	0	0,00
900	Northwest Natural Holding Co	Morgan Stanley	0	0,00
(2.600)	NortonLifeLock Inc	Morgan Stanley	0	0,00
12.180.000	NortonLifeLock Inc	Morgan Stanley	1.363.538	0,06
(13.400)	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
114.700	NOV Inc	Morgan Stanley	0	0,00
7.000	Novanta Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(330)	Novartis AG	Morgan Stanley	192	0,00
(318.877)	Novatek OAO	Goldman Sachs International	4.569	0,00
(455.760)	Novatek PJSC	Goldman Sachs International	4.635	0,00
(3.229.730)	Novo Nordisk A/S Class B	JPMorgan Chase Bank	98.356	0,01
(4.453.289)	Novo Nordisk A/S Class B	Goldman Sachs International	40.797	0,00
(120.178)	Novolipetsk Iron & Steel Corp	Morgan Stanley	8.501	0,00
227.668	Novolipetsk Steel PJSC	JPMorgan Chase Bank	5.223	0,00
151.723	Novolipetsk Steel PJSC	Morgan Stanley	1.567	0,00
5.628	Novus Capital Corp	Morgan Stanley	6.642	0,00
(42.000)	NOW Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.700)	NS Solutions Corp	Morgan Stanley	17	0,00
(1.900)	NSK Ltd	Morgan Stanley	284	0,00
6.600	Nu Skin Enterprises Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(1.600)	Nuance Communications Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(11.400)	Nucor Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(73.500)	Nutanix Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(28.700)	Nutrien Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
9.200	NuVasive Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(748.424)	Nuvei Corp	Goldman Sachs International	158.590	0,01
(37.900)	nVent Electric Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(600)	NXP Semiconductors NV	Morgan Stanley	0	0,00
(2.558.575)	NXP Semiconductors NV	Goldman Sachs International	52.424	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(46.100)	Obayashi Corp	Morgan Stanley	7.271	0,00
(900)	OBIC Business Consultants Co Ltd	Morgan Stanley	407	0,00
(300)	Obic Co Ltd	Morgan Stanley	615	0,00
(905)	OC Oerlikon Corp AG	Morgan Stanley	4	0,00
(540.994)	Occidental Petroleum Corp	Morgan Stanley	40.892	0,00
(5.162)	Occidental Petroleum Corp (Warrants, 03/08/2027)	Morgan Stanley	0	0,00
(3.388.068)	Occidental Petroleum Corp	Goldman Sachs International	254.049	0,01
26.300	OceanFirst Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(12.200)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Morgan Stanley	9.060	0,00
11.100	Oil States International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
300	Oisix ra daichi Inc	Morgan Stanley	1.070	0,00
(2.400)	Okamura Corp	Morgan Stanley	143	0,00
8.400	Okta Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.586.611)	Okta Inc	Goldman Sachs International	83.815	0,01
(4.400)	Old Dominion Freight Line Inc	Morgan Stanley	0	0,00
56.300	Old National Bancorp	Morgan Stanley	0	0,00
20.080	Olin Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(5.700)	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
37.200	Omega Healthcare Investors Inc	Morgan Stanley	0	0,00
20.600	Omnicom Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.641.862	Omnicom Group Inc	Goldman Sachs International	25.726	0,00
2.100	Omron Corp	Morgan Stanley	2.579	0,00
60.700	ON Semiconductor Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.195.856)	ON Semiconductor Corp	Goldman Sachs International	39.268	0,00
(1.700)	ONE Gas Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.400	OneMain Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
17.100	ONEOK Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.000)	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	313	0,00
(600)	Optim Corp	JPMorgan Chase Bank	129	0,00
(200)	Oporun Co Ltd	Morgan Stanley	42	0,00
7.400	Oracle Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.774.706	Oracle Corp	Goldman Sachs International	19.373	0,00
(18.881)	Orange SA	Morgan Stanley	516	0,00
(1.400)	O'Reilly Automotive Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.137)	Organon & Co	Goldman Sachs International	4.580	0,00
(3.893)	Organon & Co	JPMorgan Chase Bank	19.946	0,00
(530)	Organon & Co	Morgan Stanley	0	0,00
(60.800)	Orient Corp	Morgan Stanley	2.055	0,00
(800)	Oriental Land Co Ltd	Morgan Stanley	1.173	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
269.628	Orion Oyj	Goldman Sachs International	4.391	0,00
(13.300)	ORIX Corp	Morgan Stanley	7.220	0,00
(14.885)	Orkla ASA	Morgan Stanley	997	0,00
193	Orpea SA	Morgan Stanley	552	0,00
12.928.526	Orsted AS	Morgan Stanley	135.164	0,01
13.038.015	Orsted AS	Goldman Sachs International	79.030	0,00
(6.800)	Osaka Gas Co Ltd	Morgan Stanley	592	0,00
(400)	Osaka Organic Chemical Industry Ltd	Morgan Stanley	7	0,00
(5.275.538)	Oshkosh Corp	Goldman Sachs International	777.011	0,04
3.900	Oshkosh Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(1.689.629)	Oshkosh Corp	JPMorgan Chase Bank	465.293	0,02
(7.500)	OSI Systems Inc	Morgan Stanley	247	0,00
127.283	Otis Worldwide Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(72.400.507)	OTP Bank Nyrt	Goldman Sachs International	15.950	0,00
(400)	Outsourcing Inc	Morgan Stanley	63	0,00
(7.700)	Oxford Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
531.286	OZ Minerals Ltd	Morgan Stanley	39.638	0,00
(80.363)	PACCAR Inc	Morgan Stanley	0	0,00
170.791	Pacira BioSciences Inc	Goldman Sachs International	405	0,00
36	Packaging Corp of America	Morgan Stanley	0	0,00
11.900	PacWest Bancorp	Morgan Stanley	0	0,00
(89.278)	Pagegroup Plc	Morgan Stanley	52.848	0,00
(200)	PagerDuty Inc	Morgan Stanley	0	0,00
400	Palo Alto Networks Inc	Morgan Stanley	0	0,00
10.000.000	Palo Alto Networks Inc	Morgan Stanley	1.379.000	0,06
(2.400)	PALTAC Corp	Morgan Stanley	3.304	0,00
71.713.383	Pan Pacific International Holdings Corp	Goldman Sachs International	2.328	0,00
18.800	Panasonic Corp	Morgan Stanley	5.658	0,00
(18.483.158)	Pandora A/S	Morgan Stanley	701.994	0,03
(9.655.162)	Pandora A/S	Goldman Sachs International	134.287	0,01
(3.100)	Papa John's International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.037)	Paragon Banking Group Plc	Morgan Stanley	133	0,00
175.800	Paramount Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.196.590	Parker-Hannifin Corp	Goldman Sachs International	8.822	0,00
10.647	Parker-Hannifin Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(4.600)	Parsons Corp	Morgan Stanley	0	0,00
20.700	Patrick Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
346	PATRIZIA AG	Morgan Stanley	9	0,00
15.600	Patterson Cos Inc	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(120.600)	Patterson-UTI Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(22.400)	Paychex Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.400	Paycom Software Inc	Morgan Stanley	0	0,00
700	Paylocity Holding Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(7.959.746)	PayPal Holdings Inc	Goldman Sachs International	528.196	0,03
(1.400)	PayPal Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(6.400)	PDC Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.977)	Pearson Plc	Morgan Stanley	179	0,00
(15.300)	Pebblebrook Hotel Trust	Morgan Stanley	0	0,00
(6.800)	Pegasystems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
9.600	Penn National Gaming Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.712)	Pennon Group Plc	Morgan Stanley	1.010	0,00
(1.700)	PennyMac Financial Services Inc	Morgan Stanley	0	0,00
8.227	Penske Automotive Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(172.054)	Pentair Plc	JPMorgan Chase Bank	0	0,00
(900)	Penumbra Inc	Morgan Stanley	0	0,00
21.000	People's United Financial Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(35.900)	PepsiCo Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.700)	Performance Food Group Co	Morgan Stanley	0	0,00
(4.400)	PerkinElmer Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(75.555)	Persimmon Plc	Morgan Stanley	263.889	0,01
(4.477.530)	PetroChina Co Ltd	Morgan Stanley	155.140	0,01
(2.089)	Pets at Home Group Plc	Morgan Stanley	84	0,00
39.800	Pfizer Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.042.821	PG&E Corp	Goldman Sachs International	22.200	0,00
29.300	PGT Innovations Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(47)	Pharma Mar SA	Morgan Stanley	166	0,00
(1.111.060)	Philip Morris International	Goldman Sachs International	165.352	0,01
(16.200)	Phillips 66	Morgan Stanley	0	0,00
(1.457.382)	Phoenix Group Holdings Plc	Goldman Sachs International	8.177	0,00
(13.600)	Phreesia Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(96.100)	Physicians Realty Trust	Morgan Stanley	0	0,00
2.641.490	PICC Property & Casualty Co Ltd	Goldman Sachs International	39.904	0,00
54.500	Pilgrim's Pride Corp	Morgan Stanley	0	0,00
965.654	Pinduoduo Inc	Goldman Sachs International	81.497	0,01
4.389.481	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	Goldman Sachs International	4.710	0,00
(18.600)	Pinnacle Financial Partners Inc	Morgan Stanley	0	0,00
11.300	Pinnacle West Capital Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(7.000)	Pinterest Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
10.055	Pioneer Natural Resources Co	Morgan Stanley	0	0,00
14.300	PJT Partners Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(2.083.346)	PKO Bank Polski SA	Goldman Sachs International	28.988	0,00
44.299.467	Plaid Inc	JPMorgan Chase Bank	42.629	0,00
12.900	Plantronics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(19.621)	Playtech Plc	Morgan Stanley	4.661	0,00
3.500	Plexus Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(33.402)	Plug Power Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(444)	Plus500 Ltd	Morgan Stanley	218	0,00
(24.400)	PNC Financial Services Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(12.000)	PNM Resources Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.300)	Pola Orbis Holdings Inc	Morgan Stanley	8.369	0,00
(889.591)	Polaris Inc	Goldman Sachs International	15.087	0,00
(1.318.085)	Polski Koncern Naftowy Orlen	Goldman Sachs International	26.085	0,00
(2.016)	Polymetal International Plc	Morgan Stanley	1.131	0,00
611.132	Polyus PJSC	Goldman Sachs International	24.914	0,00
609.696	Polyus PJSC GDR	Goldman Sachs International	48.792	0,00
(3.300)	Pool Corp	Morgan Stanley	0	0,00
22.500	Portland General Electric Co	Morgan Stanley	0	0,00
24.800	Post Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
848	Postal Savings Bank of China Ltd	JPMorgan Chase Bank	0	0,00
(36.934)	PostNL NV	Morgan Stanley	2.481	0,00
15.900	Power Integrations Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(166.191)	Powszechny Zakład Ubezpieczeń SA	Morgan Stanley	2.896	0,00
(1.746.734)	Powszechny Zakład Ubezpieczeń SA	Goldman Sachs International	25.487	0,00
(19.748)	PPG Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.900)	Preferred Bank/Los Angeles CA	Morgan Stanley	0	0,00
(54.688.999)	Premier Anti-Aging Co Ltd	Goldman Sachs International	930	0,00
(80.480)	Primary Health Properties Plc	Morgan Stanley	1.806	0,00
14.709	Primavera Capital Group	Morgan Stanley	15.003	0,00
300	Primerica Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(820.139)	Primo Water Corp	Goldman Sachs International	46.364	0,00
(3.800)	Procter & Gamble Co	Morgan Stanley	0	0,00
3.400	Progress Software Corp	Morgan Stanley	0	0,00
18.000	Progressive Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(10.100)	Prologis Inc	Morgan Stanley	0	0,00
5.500	Proofpoint Inc	Morgan Stanley	0	0,00
79.200	ProPetro Holding Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(23.800)	PROS Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(637.585)	ProSiebenSat.1 Media SE	Morgan Stanley	75.409	0,00
(17.800)	Prosperity Bancshares Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.155)	Proximus SADP	Morgan Stanley	494	0,00
179.000	Prysmian SpA	Goldman Sachs International	211.794	0,01
10.700	PS Business Parks Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(394)	PSP Swiss Property AG	Morgan Stanley	345	0,00
(700)	PTC Inc	Morgan Stanley	0	0,00
9.700	Public Service Enterprise Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.200	Public Storage	Morgan Stanley	0	0,00
440.271	Public Storage	Goldman Sachs International	1.524	0,00
(768)	Publicis Groupe SA	Morgan Stanley	604	0,00
(19.900)	PulteGroup Inc	Morgan Stanley	0	0,00
601	Puma SE	Morgan Stanley	395	0,00
7.200	Pure Storage Inc	Morgan Stanley	0	0,00
5.400	PVH Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(3.500)	Q2 Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
25.628	QIAGEN NV	Morgan Stanley	613	0,00
(547.389)	QinetiQ Group Plc	Morgan Stanley	157.892	0,01
3.400	Qorvo Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(16.500)	QTS Realty Trust Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.900)	Quaker Chemical Corp	Morgan Stanley	0	0,00
2.400	QUALCOMM Inc	Morgan Stanley	0	0,00
164.172	Qualys Inc	Goldman Sachs International	1.378	0,00
147.926	Qualys Inc	Morgan Stanley	2.166	0,00
13.100	Quanta Services Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.600)	Quest Diagnostics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.320)	Quilter Plc	Morgan Stanley	16	0,00
(51.700)	Radian Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
100	Raksul Inc	Morgan Stanley	222	0,00
52.682.248	Rakuten Inc	Morgan Stanley	34.375	0,00
27.327.513	Rakuten Inc	Goldman Sachs International	13.656	0,00
(8.600)	Ralph Lauren Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(93.200)	Range Resources Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(8.600)	Rapid7 Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.904.645	Raymond James Financial Inc	Goldman Sachs International	29.665	0,00
6.685.509	Rayonier Inc	Goldman Sachs International	34.697	0,00
(27.103)	Raytheon Technologies Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(8.000)	RBC Bearings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
36.400	Realty Income Corp	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(2.300)	Recruit Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	1.439	0,00
(11.007)	Red Electrica Corp SA	Morgan Stanley	6.461	0,00
(27.700)	Red Rock Resorts Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(201.394)	Regal Beloit Corp	JPMorgan Chase Bank	39.774	0,00
(3.261.604)	Regal Beloit Corp	Morgan Stanley	96.406	0,01
161.600	Regions Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(433.378)	Regions Financial Corp	Goldman Sachs International	19.289	0,00
5.400	Reinsurance Group of America Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
7.600	Reliance Steel & Aluminum Co	Morgan Stanley	0	0,00
285.165	Remgro Ltd	Goldman Sachs International	981	0,00
606	Remy Cointreau SA	Morgan Stanley	665	0,00
4.400	RenaissanceRe Holdings Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(100)	Renasant Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(265.925)	Renault SA	Morgan Stanley	329.776	0,02
1.216.502	Renault SA	Goldman Sachs International	13.261	0,00
82.100	Renesas Electronics Corp	Morgan Stanley	25.100	0,00
24.023.476	Rengo Co Ltd	Goldman Sachs International	10.818	0,00
2.700	Rent-A-Center Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(5.865)	Rentokil Initial Plc	Morgan Stanley	327	0,00
(18.567)	Repsol SA	Morgan Stanley	4.887	0,00
(15.500)	Republic Services Inc	Morgan Stanley	0	0,00
13.200	Resideo Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(112.100)	Resona Holdings Inc	Morgan Stanley	11.878	0,00
(3.900)	Resorttrust Inc	Morgan Stanley	1.090	0,00
68.500	Retail Opportunity Investments Corp	Morgan Stanley	0	0,00
83.600	Retail Properties of America Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(102.461)	Rexel SA	Goldman Sachs International	172.941	0,01
(18.500)	Rexnord Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(100)	RH	Morgan Stanley	0	0,00
(501)	Rheinmetall AG	Morgan Stanley	444	0,00
(49)	RHI Magnesita NV	Morgan Stanley	70	0,00
(21.630)	Rice Acquisition Corp Class A	Goldman Sachs International	5.497	0,00
600	RingCentral Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
237.520	RingCentral Inc Class A	Goldman Sachs International	4.698	0,00
(90)	Ringkjoebing Landbobank A/S	Morgan Stanley	24	0,00
(3.300)	Rinnai Corp	Morgan Stanley	3.953	0,00
(30.480)	Rio Tinto Plc	Morgan Stanley	74.049	0,00
11.200	RLI Corp	Morgan Stanley	0	0,00
13.400	RLJ Lodging Trust	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
4.000	Robert Half International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
121.277	Roblox Corp Class A	Goldman Sachs International	976	0,00
(14)	Roche Holding AG	Morgan Stanley	25	0,00
(55.559)	Rocket Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	2.709	0,00
6.704	ROCKWOOL International A/S	Morgan Stanley	140	0,00
(4.300)	Rogers Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(72.844.066)	Rohm Co Ltd	Goldman Sachs International	19.098	0,00
(96.433.706)	Rohm Co Ltd	Morgan Stanley	846	0,00
(4.600)	Roku Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(8.226.170)	Rolls-Royce Holdings Plc	Morgan Stanley	959.523	0,05
(9.116)	Roper Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
600	Ross Stores Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(392.296)	Rotork Plc	Morgan Stanley	33.890	0,00
7.974.185	Royal Caribbean Cruises Ltd	Goldman Sachs International	446.549	0,02
6.400	Royal Caribbean Cruises Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
48.259	Royal Dutch Shell Plc	Morgan Stanley	479	0,00
3.200	Royal Gold Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.000)	Royal Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	1.131	0,00
(26.992)	Royal Mail Plc	Morgan Stanley	976	0,00
104.152	RPC Inc	Morgan Stanley	0	0,00
11.400	RPM International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(39.300)	RPT Realty	Morgan Stanley	0	0,00
(814)	Rubis SCA	Morgan Stanley	846	0,00
130.014	RWE AG	Morgan Stanley	0	0,00
(1.901)	RWS Holdings Plc	Morgan Stanley	67	0,00
(176.589)	Ryanair Holdings Plc	Goldman Sachs International	6.208	0,00
2.000	Ryohin Keikaku Co Ltd	Morgan Stanley	4.305	0,00
4.700	S&P Global Inc	Morgan Stanley	0	0,00
10.900	S&T Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
207	S4 Capital Plc	Morgan Stanley	1	0,00
(51.800)	Sabra Health Care REIT Inc	Morgan Stanley	0	0,00
48.900	Sabre Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(4.390)	Safestore Holdings Plc	Morgan Stanley	601	0,00
6.600	Safety Insurance Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(17.838)	Sage Group Plc	Morgan Stanley	1.234	0,00
105.658	Sage Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	9.498	0,00
1.300	Saia Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(400)	SailPoint Technologies Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.200)	Sakata Seed Corp	Morgan Stanley	1.806	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
800	salesforce.com Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.425.296)	salesforce.com Inc	Goldman Sachs International	110.473	0,01
(2.517)	Salzgitter AG	Morgan Stanley	736	0,00
(52.735)	Samsung Electronics Co Ltd	Goldman Sachs International	496	0,00
(32.270)	Samsung Electronics Co Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(636.952)	Samsung Electronics Co Ltd - Preferred Shares	Morgan Stanley	139.858	0,01
(7.000)	Sanderson Farms Inc	Morgan Stanley	0	0,00
14.069.476	Sandvik AB	Goldman Sachs International	8.537	0,00
(5.600)	Sankyu Inc	Morgan Stanley	2.236	0,00
6.072.595	Sanlam Ltd	Goldman Sachs International	7.169	0,00
33.600	Sanmina Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.132.964)	Sanofi	Goldman Sachs International	282.435	0,01
(100)	Sansan Inc	Morgan Stanley	2	0,00
24.800	Santander Consumer USA Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
438.059	Santos Ltd	Morgan Stanley	3.890	0,00
(14.700)	Sanwa Holdings Corp	Morgan Stanley	1.253	0,00
(800)	Sanyo Denki Co Ltd	Morgan Stanley	49	0,00
1.701.578	SAP SE	Goldman Sachs International	4.210	0,00
(171)	SAP SE	Morgan Stanley	104	0,00
(4.800)	Saul Centers Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.287	Savills Plc	Morgan Stanley	514	0,00
(3.300)	SBA Communications Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(517.979)	SBA Communications Corp	Goldman Sachs International	12.263	0,00
836.372	Sberbank PJSC	Goldman Sachs International	12.802	0,00
(9.250)	SBM Offshore NV	Morgan Stanley	2.366	0,00
(900)	SBS Holdings Inc	Morgan Stanley	182	0,00
60.205	Schaeffler AG	Morgan Stanley	0	0,00
(1.401.277)	Schlumberger Ltd	Goldman Sachs International	151.859	0,01
(9.700)	Schlumberger NV	Morgan Stanley	0	0,00
70.400	Schneider National Inc Class B	Morgan Stanley	0	0,00
(5.200)	Science Applications International Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.164.835)	SCOR SE	Goldman Sachs International	16.555	0,00
(1.204)	SCOR SE	Morgan Stanley	10	0,00
576	Scout24 AG	Morgan Stanley	210	0,00
5.800	SCREEN Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	6.648	0,00
3.200	SCSK Corp	Morgan Stanley	2.195	0,00
28.600	Seacoast Banking Corp of Florida	Morgan Stanley	0	0,00
(19.200)	Seagate Technology Holdings Plc	Morgan Stanley	0	0,00
32.061	Sealed Air Corp	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(2.800)	SeaWorld Entertainment Inc	Morgan Stanley	0	0,00
14	Secunet Security Networks AG	Morgan Stanley	37	0,00
853	Secure Income REIT Plc	Morgan Stanley	5	0,00
1.917.524	Securitas AB Class B	Goldman Sachs International	2.716	0,00
(6.200)	SEI Investments Co	Morgan Stanley	0	0,00
(15.200)	Seino Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	5.561	0,00
32.636.214	Sekisui Chemical Co Ltd	Morgan Stanley	3.336	0,00
(34.700)	Select Medical Holdings Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(21.800)	Selective Insurance Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(13.600)	Sempra Energy	Morgan Stanley	0	0,00
(1.700)	Semtech Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(3.800)	Sensata Technologies Holding Plc	Morgan Stanley	0	0,00
1.075.173	Sensata Technologies Holding Plc	Goldman Sachs International	6.815	0,00
35.203	Sensient Technologies Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(79.300)	Service Properties Trust	Morgan Stanley	0	0,00
(2.597.750)	ServiceNow Inc	Goldman Sachs International	251.967	0,01
(500)	ServiceNow Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(27.800)	ServisFirst Bancshares Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(23.703.843)	Seven & i Holdings Co Ltd	Goldman Sachs International	1.155	0,00
(2.132)	Severn Trent Plc	Morgan Stanley	356	0,00
527.934	Severstal PAO	Goldman Sachs International	41.551	0,00
13.500	SFL Corp Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(2.800)	Shake Shack Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(66.895)	Shandong Sinocera Functional Material Co Ltd	Morgan Stanley	17.542	0,00
127.000	Shell Midstream Partners LP	Morgan Stanley	0	0,00
(6.700)	Shenandoah Telecommunications Co	Morgan Stanley	0	0,00
(4.877)	Sherwin-Williams Co	Morgan Stanley	0	0,00
(331.381)	Shift Technologies Inc	Goldman Sachs International	44.041	0,00
(536.735)	Shift Technologies Inc	Morgan Stanley	89.312	0,01
(959.584)	Shift4 Payments Inc Class A	Goldman Sachs International	72.390	0,00
(18.700)	Shikoku Electric Power Co Inc	Morgan Stanley	1.645	0,00
(1.800)	Shimadzu Corp	Morgan Stanley	1.374	0,00
2.800	Shimamura Co Ltd	Morgan Stanley	12.505	0,00
49.899.491	Shimizu Corp	Goldman Sachs International	27.114	0,00
(11.600)	Shimizu Corp	Morgan Stanley	990	0,00
(125.170.333)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Goldman Sachs International	43.992	0,00
(2.100)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Morgan Stanley	4.806	0,00
600	Shinko Electric Industries Co Ltd	Morgan Stanley	672	0,00
99.100	Shinsegae International	JPMorgan Chase Bank	19	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(36.071.358)	Shinsei Bank Ltd	Morgan Stanley	37.494	0,00
2.800	Shionogi & Co Ltd	Morgan Stanley	2.291	0,00
(1.400)	Ship Healthcare Holdings Inc	Morgan Stanley	58	0,00
(70.227.878)	Shiseido Co Ltd	Goldman Sachs International	22.391	0,00
(1.600)	Shiseido Co Ltd	Morgan Stanley	890	0,00
(72.800)	Shizuoka Bank Ltd	Morgan Stanley	21.706	0,00
(619.876)	Shoals Technologies Group Inc Class A	Goldman Sachs International	120.632	0,01
(1.549.368)	Shoals Technologies Group Inc Class A	Morgan Stanley	30.249	0,00
(800)	SHO-BOND Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	948	0,00
(1.200)	Shochiku Co Ltd	Morgan Stanley	3.020	0,00
(26)	Shop Apotheke Europe NV	Morgan Stanley	21	0,00
(1.100)	Shopify Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(87.403.059)	Showa Denko KK	JPMorgan Chase Bank	205.276	0,01
(60)	Shurgard Self Storage SA	Morgan Stanley	82	0,00
(35.584)	Siemens AG	Morgan Stanley	646	0,00
(70.075)	Siemens Energy AG	Morgan Stanley	0	0,00
(5.587)	Siemens Energy AG	Goldman Sachs International	36	0,00
193.122	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	Morgan Stanley	153	0,00
(1.573.475)	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	Goldman Sachs International	109.944	0,00
(2.248.429)	Siemens Healthineers AG	Morgan Stanley	336.976	0,02
(3.612.118)	Siemens Healthineers AG	Goldman Sachs International	336.145	0,02
(1.687.272)	Signify NV	Goldman Sachs International	311.731	0,02
(2.906)	Signify NV	Morgan Stanley	934	0,00
9.996.255	Sika AG	Goldman Sachs International	911.047	0,04
15.661	Sika AG	Morgan Stanley	62.342	0,00
(32.600)	Silgan Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(11.000)	Silicon Laboratories Inc	Morgan Stanley	0	0,00
512	Siltronic AG	Morgan Stanley	230	0,00
(663.079)	Silvergate Capital Corp Class A	Goldman Sachs International	7.134	0,00
(39.100)	Simmons First National Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
547.567	Simon Property Group Inc	Goldman Sachs International	9.448	0,00
(1.700)	Simpson Manufacturing Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(457.339)	Sims Metal Management Limited	Morgan Stanley	19.915	0,00
(2.051)	Sinclair Broadcast Group Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(2.509.789)	Sino Biopharmaceutical Ltd	Morgan Stanley	2.453	0,00
(938.353)	Sirius XM Holdings Inc	Goldman Sachs International	20.443	0,00
(2.073.321)	SiriusXM Holdings Inc	Goldman Sachs International	23.126	0,00
(806.425)	Sistema JSFC	Goldman Sachs International	22.726	0,00
10.700	SiteOne Landscape Supply Inc	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
884.277	Six Flags Entertainment Corp	Goldman Sachs International	55.715	0,00
(10.800)	Six Flags Entertainment Corp	Morgan Stanley	0	0,00
29.300	Sixth Street Specialty Lending Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.700)	SJW Group	Morgan Stanley	0	0,00
(1.619.873)	Sk Hynix Inc	Goldman Sachs International	37.581	0,00
(632.020)	SK Innovation Co Ltd	Morgan Stanley	74.279	0,00
(156.487)	Skanska AB	Morgan Stanley	0	0,00
(6.200)	Skechers USA Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
18.947.514	SKF AB	Goldman Sachs International	80.980	0,00
(406.379)	SKF AB	Morgan Stanley	0	0,00
1.850.359	SKF AB	JPMorgan Chase Bank	24.574	0,00
(651.813)	Skillz Inc	Goldman Sachs International	44.275	0,00
(3.500)	SKY Perfect JSAT Holdings Inc	Morgan Stanley	348	0,00
(7.200)	SkyWest Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.200)	Skyworks Solutions Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.092.138)	Skyworks Solutions Inc	Goldman Sachs International	102.720	0,01
(37.236)	SL Green Realty Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.200)	Slack Technologies Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(2.700)	Sleep Number Corp	Morgan Stanley	0	0,00
9.000	SLM Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(8.574)	SM Energy Co	Morgan Stanley	0	0,00
222	SMA Solar Technology AG	Morgan Stanley	391	0,00
(18.400)	Smartsheet Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(261)	Smith & Nephew Plc	Morgan Stanley	13	0,00
(1.519.848)	Snap Inc Class A	Goldman Sachs International	117.696	0,01
5.400	Snap Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
1.513.215	Snap-on Inc	Goldman Sachs International	116.355	0,01
8.225	Sociedad Química y Minera de Chile SA	Morgan Stanley	0	0,00
(2)	Societe BIC SA	Morgan Stanley	1	0,00
(8.654)	Societe Generale SA	Morgan Stanley	2.538	0,00
(20.505)	Sodexo SA	Morgan Stanley	63.882	0,00
49.700	SoftBank Corp	Morgan Stanley	8.862	0,00
155.215.304	SoftBank Group Corp	Goldman Sachs International	263.776	0,01
(1.169)	Software AG	Morgan Stanley	542	0,00
(4.500)	Sohgo Security Services Co Ltd	Morgan Stanley	3.329	0,00
(3.861)	SolarEdge Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(55.956)	Solaria Energía y Medio Ambiente SA	Morgan Stanley	25	0,00
49.400	SolarWinds Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(66.330)	Solvay SA	Morgan Stanley	687	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
422.152	Sonic Automotive Inc Class A	Goldman Sachs International	45.725	0,00
(16.700)	Sonic Automotive Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(27.000)	Sonoco Products Co	Morgan Stanley	0	0,00
1.941.502	Sonoco Products Co	Goldman Sachs International	17.485	0,00
13.500	Sonos Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(14)	Sonova Holding AG	Morgan Stanley	3	0,00
(134.864.014)	Sony Corp	Morgan Stanley	80.748	0,01
400	Sony Group Corp	Morgan Stanley	307	0,00
(10.800)	Sotetsu Holdings Inc	Morgan Stanley	2.191	0,00
(52.100)	South Jersey Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.600	South State Corp	Morgan Stanley	0	0,00
56.800	Southern Co	Morgan Stanley	0	0,00
4.200	Southside Bancshares Inc	Morgan Stanley	0	0,00
10.215.664	Southwest Airlines Co	Goldman Sachs International	29.308	0,00
69.358	Southwest Airlines Co	Morgan Stanley	0	0,00
22.500	Southwest Gas Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
241.000	Southwestern Energy Co	Morgan Stanley	0	0,00
4.155	Spartan Acquisition III Class A	Morgan Stanley	4.944	0,00
13.400	Spectrum Brands Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.290)	SPIE SA	Morgan Stanley	554	0,00
(600)	Spire Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(23.442)	Spirit AeroSystems Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(5.400)	Spirit Airlines Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.800)	Splunk Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.900	Spotify Technology SA	Morgan Stanley	0	0,00
20.000.000	Spotify USA Inc	Morgan Stanley	772.000	0,04
503.243	Sprouts Farmers Market Inc	Goldman Sachs International	9.595	0,00
(16.700)	Sprouts Farmers Market Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.300	SPS Commerce Inc	Morgan Stanley	0	0,00
14.100	SPX FLOW Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.400	Square Enix Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	758	0,00
(1.914.956)	Square Inc Class A	Goldman Sachs International	96.156	0,00
1.800	Square Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
38.100	SS&C Technologies Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(14.315)	SSP Group Plc	Morgan Stanley	1.793	0,00
1.212.947	St James'S Place Plc	Goldman Sachs International	23.193	0,00
(8.816)	St Modwen Properties Plc	Morgan Stanley	111	0,00
1.257.804	Stadler Rail AG	JPMorgan Chase Bank	26.086	0,00
(99.688)	Stadler Rail AG	Goldman Sachs International	244.661	0,01

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
7.495.712	Standard Bank Group Ltd	Goldman Sachs International	15.129	0,00
745.398	Standard Bank Group Ltd	Morgan Stanley	2.592	0,00
(26.388)	Standard Chartered Plc	Morgan Stanley	1.080	0,00
1.111.464	Standard Life Aberdeen Plc	Goldman Sachs International	100.421	0,01
500	Standard Motor Products Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.800	Standex International Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(9.500)	Stanley Electric Co Ltd	Morgan Stanley	7.720	0,00
(44.300)	Star Bulk Carriers Corp	Morgan Stanley	0	0,00
9.495	Star Peak Corp	Morgan Stanley	16.807	0,00
900.247	State Street Corp	Goldman Sachs International	44.125	0,00
300	State Street Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(26.300)	Steel Dynamics Inc	Morgan Stanley	0	0,00
15.100	Steelcase Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
14	Steico SE	Morgan Stanley	19	0,00
(9.205.731)	Stellantis NV	Goldman Sachs International	706.198	0,04
3.100	Stepan Co	Morgan Stanley	0	0,00
(47.800)	Sterling Bancorp	Morgan Stanley	0	0,00
(30.200)	Steven Madden Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
55.450	Stifel Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(57.980)	STMicroelectronics NV	Morgan Stanley	68.760	0,00
(200)	Stock Yards Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
12.400	Stoneridge Inc	Morgan Stanley	0	0,00
5.700	STORE Capital Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(7.158.645)	STOXX 600 Food And Beverage Index	Morgan Stanley	0	0,00
16.763.901	STOXX Europe 50 Index	Morgan Stanley	0	0,00
(7.194.993)	STOXX Europe 600 Media Index	Morgan Stanley	0	0,00
(7.160.152)	STOXX Europe 600 Telecommunications	Morgan Stanley	0	0,00
(13.400)	Stratasys Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
50	STRATEC SE	Morgan Stanley	39	0,00
(5.000)	Strategic Education Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(231.982)	Straumann Holding AG	JPMorgan Chase Bank	80.716	0,01
(3.244.828)	Straumann Holding AG	Goldman Sachs International	452.277	0,03
(1.357.753)	Straumann Holding AG	Morgan Stanley	275.656	0,01
(700)	Stryker Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(500)	Sugi Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	3.387	0,00
13.898	Sulzer AG	Goldman Sachs International	92.868	0,01
(42.702.280)	SUMCO Corp	Morgan Stanley	26.440	0,00
(38.289.602)	Sumitomo Bakelite Co Ltd	Goldman Sachs International	5	0,00
(73.344.561)	Sumitomo Chemical Co Ltd	Morgan Stanley	22.062	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(68.633.964)	Sumitomo Chemical Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	53.908	0,00
19.400	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	Morgan Stanley	6.742	0,00
(8.400)	Sumitomo Electric Industries Ltd	Morgan Stanley	1.795	0,00
69.205.006	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Morgan Stanley	82.002	0,01
(19.500)	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Morgan Stanley	13.741	0,00
(15.700)	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Morgan Stanley	10.395	0,00
(5.600)	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	Morgan Stanley	7.959	0,00
(107.517.009)	Sumitomo Rubber Industries Ltd	Goldman Sachs International	8.547	0,00
55.920	Sunac China Holdings Ltd	Goldman Sachs International	595	0,00
1.833.354	Sunac China Holdings Ltd	Morgan Stanley	51.115	0,00
(15)	Sunac Services Holdings Ltd	Morgan Stanley	1	0,00
(4.034.967)	Sunac Services Holdings Ltd	Goldman Sachs International	144.589	0,01
(102.203)	Sungrow Power Supply Co Ltd	Goldman Sachs International	28.906	0,00
(1.317.968)	Sungrow Power Supply Co Ltd	Morgan Stanley	617.112	0,03
(3.261.219)	Sunnova Energy International Inc	Goldman Sachs International	829.011	0,04
(217.424)	Sunnova Energy International Inc	Morgan Stanley	120.381	0,01
(7.260.668)	Sunrun Inc	Goldman Sachs International	1.168.988	0,07
(32.075)	Sunrun Inc	Morgan Stanley	12.540	0,00
35.600	Sunstone Hotel Investors Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(45.969.468)	Suntory Beverage & Food Ltd	Morgan Stanley	8.175	0,00
(111.316.920)	Suntory Beverage & Food Ltd	Goldman Sachs International	6.129	0,00
3.972	Sustainable Development AC	Morgan Stanley	3.773	0,00
7.000	Suzuki Motor Corp	Morgan Stanley	4.192	0,00
(300)	SVB Financial Group	Morgan Stanley	0	0,00
(145.060)	Svenska Cellulosa AB SCA Class B	Morgan Stanley	133	0,00
(660)	Swatch Group AG	Morgan Stanley	2.198	0,00
25.112.754	Swedish Match AB	Morgan Stanley	36.068	0,00
(415)	Swiss Life Holding AG	Morgan Stanley	4.209	0,00
(959)	Swiss Prime Site AG	Morgan Stanley	559	0,00
5.791.964	Swiss Re AG	Société Générale	400.520	0,02
(1.315)	Swiss Re AG	Morgan Stanley	1.522	0,00
4.860.426	Swiss Re AG	Goldman Sachs International	154.417	0,01
630.668	Swisscom AG	Goldman Sachs International	148	0,00
(216)	Swisscom AG	Morgan Stanley	414	0,00
(57.100)	Switch Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
11.841	Switchback II Corp	Morgan Stanley	16.104	0,00
410.725	Sykes Enterprises Inc	Goldman Sachs International	139	0,00
2.800	Sykes Enterprises Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(11.500)	Synaptics Inc	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(22.500)	Synchrony Financial	Morgan Stanley	0	0,00
(6.900)	SYNNEX Corp	Morgan Stanley	0	0,00
700	Synopsys Inc	Morgan Stanley	0	0,00
27.400	Synovus Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
10.000	Sysco Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(10.000)	T Rowe Price Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.542)	TAG Immobilien AG	Morgan Stanley	966	0,00
201.459.482	Taiheiyo Cement Corp	Goldman Sachs International	206.331	0,01
8.600	Taisei Corp	Morgan Stanley	1.017	0,00
(2.400)	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	6.663	0,00
2.617.090	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Morgan Stanley	190.158	0,01
(1.500)	Taiyo Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	539	0,00
3.800	Taiyo Yuden Co Ltd	Morgan Stanley	2.012	0,00
800	Takara Holdings Inc	Morgan Stanley	6	0,00
(1.800)	Takuma Co Ltd	Morgan Stanley	523	0,00
(79.000)	Talos Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(100)	Tandem Diabetes Care Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.000	Tapestry Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.047.999)	Tapestry Inc	Goldman Sachs International	13.958	0,00
(33.800)	Targa Resources Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(6.200)	Target Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(47)	Tarkett SA	Morgan Stanley	5	0,00
(9.877)	Tate & Lyle Plc	Morgan Stanley	1.932	0,00
7.800	Taylor Morrison Home Corp	Morgan Stanley	0	0,00
40.748	Taylor Wimpey Plc	Goldman Sachs International	8.381	0,00
(11.900)	TBS Holdings Inc	Morgan Stanley	11.500	0,00
(622.927)	TCS Group Holding PLC	Goldman Sachs International	157.513	0,01
(1.824.074)	TE Connectivity Ltd	Goldman Sachs International	18.495	0,00
(3.600)	TE Connectivity Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(132.162)	TechnipFMC Plc	Morgan Stanley	74	0,00
30.000	TEGNA Inc	Morgan Stanley	0	0,00
70.760.719	Teijin Ltd	JPMorgan Chase Bank	33.855	0,00
83.977.261	Teijin Ltd	Goldman Sachs International	40.123	0,00
620	Teledyne Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.100	Teleflex Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(51.410)	Telefonica Deutschland Holding AG	Morgan Stanley	663	0,00
847	Telenet Group Holding NV	Morgan Stanley	152	0,00
(1.213.635)	Teleperformance	Goldman Sachs International	100.411	0,01
30.800	Telephone and Data Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(2.725)	Television Francaise 1	Morgan Stanley	61	0,00
(3.775.721)	Temenos AG	Goldman Sachs International	423.668	0,02
(713)	Temenos AG	Morgan Stanley	1.701	0,00
(3.393.817)	Temple & Webster Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	196.876	0,01
(43.000)	Tempur Sealy International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.400	Tenable Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.044.106	Tenaris SA	Goldman Sachs International	67.115	0,00
(1.466.545)	Tencent Holdings Ltd	Morgan Stanley	315	0,00
61.823.400	Tencent Holdings Ltd	Société Générale	438.690	0,02
(17.200)	Tenet Healthcare Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.300	Teradata Corp	Morgan Stanley	0	0,00
5.200	Teradyne Inc	Morgan Stanley	0	0,00
53.200	Terex Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(57.808)	Tesco Plc	Morgan Stanley	821	0,00
(115)	Tesla Inc	Morgan Stanley	0	0,00
6.600	Texas Capital Bancshares Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.500	Texas Instruments Inc	Morgan Stanley	0	0,00
633.382	Texas Roadhouse Inc	Goldman Sachs International	36.383	0,00
5.300	Texas Roadhouse Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(249.217)	The Foschini Group Ltd	Morgan Stanley	5.347	0,00
(3.345.033)	The Foschini Group Ltd	Goldman Sachs International	71.149	0,00
(2.300)	Thermo Fisher Scientific Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(11.749)	thyssenkrupp AG	Morgan Stanley	540	0,00
(1.228.358)	Times Neighborhood Holdings Ltd	Morgan Stanley	3.481	0,00
(420.528)	Times Neighborhood Holdings Ltd	Goldman Sachs International	7.217	0,00
(75.903)	Timken Co	Morgan Stanley	0	0,00
(13.300)	TJX Cos Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.598.298)	T-Mobile US Inc	Goldman Sachs International	118.889	0,01
(17.900)	Tobu Railway Co Ltd	Morgan Stanley	7.179	0,00
(3.600)	Toda Corp	Morgan Stanley	299	0,00
(9.800)	Toho Co Ltd	Morgan Stanley	3.234	0,00
(6.500)	Toho Gas Co Ltd	Morgan Stanley	13.190	0,00
(7.300)	Tohoku Electric Power Co Inc	Morgan Stanley	415	0,00
(141.631.773)	Tokai Carbon Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	132.294	0,01
(15.900)	Tokai Tokyo Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	395	0,00
(1.000)	Token Corp	Morgan Stanley	379	0,00
76.483.797	Tokuyama Corp	JPMorgan Chase Bank	94.266	0,01
4.361.528	Tokuyama Corp	Goldman Sachs International	591	0,00
(36.300)	Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	Morgan Stanley	832	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(58.060.013)	Tokyo Electron Ltd	Goldman Sachs International	2.548	0,00
(2.900)	Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd	Morgan Stanley	1.385	0,00
1.500	Tokyo Tatemono Co Ltd	Morgan Stanley	136	0,00
(22.700)	Tokyu Corp	Morgan Stanley	6.780	0,00
3.000	Toll Brothers Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(264.821)	Topaz Energy Corp	Goldman Sachs International	5.901	0,00
2.600	TopBuild Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(10.000)	TOPPAN Inc	Morgan Stanley	2.591	0,00
(4.414.314)	Topsports International Holdings Ltd	Goldman Sachs International	120.963	0,01
(1.000)	Toridoll Holdings Corp	Morgan Stanley	91	0,00
(23.837)	Toro Co	Morgan Stanley	0	0,00
(14.700)	Tosoh Corp	Morgan Stanley	2.941	0,00
2.990.402	TOTAL SE	Goldman Sachs International	177.973	0,01
(5.200.000)	TotalEnergies SE	Goldman Sachs International	125.138	0,01
(5.300)	TOTO Ltd	Morgan Stanley	13.332	0,00
(1.947.172)	Tourmaline Oil Corp	Goldman Sachs International	593.773	0,03
3.500	Towne Bank	Morgan Stanley	0	0,00
(8.900)	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	5.851	0,00
(120.798.801)	Toyo Tire Corp	Goldman Sachs International	85.230	0,01
10.500	Toyo Tire Corp	Morgan Stanley	778	0,00
(15.500)	Toyobo Co Ltd	Morgan Stanley	4.358	0,00
10.900	Toyota Boshoku Corp	Morgan Stanley	736	0,00
(84.849.516)	Toyota Motor Corp	Morgan Stanley	87.865	0,00
(44.309)	TPI Composites Inc	Morgan Stanley	0	0,00
329.743	TPI Composites Inc	Goldman Sachs International	12.598	0,00
(10.483)	Trane Technologies Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(7)	TransDigm Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(65.200)	Transocean Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(350.522)	Transunion	Goldman Sachs International	14.644	0,00
(979.894)	Travel Leisure Co	Goldman Sachs International	56.775	0,00
6.200	Travelers Cos Inc	Morgan Stanley	0	0,00
53.381	Travis Perkins Plc	Morgan Stanley	4.960	0,00
366.638	Travis Perkins Plc	Goldman Sachs International	17.545	0,00
16.600	TreeHouse Foods Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.400	Trend Micro Inc	Morgan Stanley	1.895	0,00
(31.700)	Trex Co Inc	Morgan Stanley	0	0,00
10.600	TRI Pointe Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.500	Trimble Inc	Morgan Stanley	0	0,00
25.900	TriNet Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
122.241	Trinity Industries Inc	JPMorgan Chase Bank	7.082	0,00
10.600	Trinity Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
424.312	Trinity Industries Inc	Goldman Sachs International	10.616	0,00
(17.596)	Tritax Big Box REIT Plc	Morgan Stanley	330	0,00
(66.500)	Triumph Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.600)	Trusco Nakayama Corp	Morgan Stanley	519	0,00
7.500	Trustmark Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.203.585)	Truworths International Ltd	Goldman Sachs International	2.800	0,00
(5.551)	Tryg A/S	Morgan Stanley	1.507	0,00
800	Tsugami Corp	Morgan Stanley	208	0,00
(6.600)	Tsumura & Co	Morgan Stanley	10.147	0,00
(44.200)	TTM Technologies Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.215.655)	Turning Point Therapeutics I	Goldman Sachs International	5.573	0,00
(700)	Twilio Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(976.391)	Twilio Inc Class A	Goldman Sachs International	208.987	0,01
(4.918.542)	Twitter Inc	Goldman Sachs International	896.302	0,04
(5.500)	Twitter Inc	Morgan Stanley	0	0,00
3.600	Tyson Foods Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(43.570.189)	UACJ Corp	Morgan Stanley	10.992	0,00
(4.800)	Ube Industries Ltd	Morgan Stanley	1.431	0,00
4.649.270	Ube Industries Ltd	Goldman Sachs International	1.381	0,00
(7.088.524)	Uber Technologies Inc	Goldman Sachs International	195.528	0,01
(2.192.307)	Uber Technologies Inc	JPMorgan Chase Bank	0	0,00
(17.497.900)	Uber Technologies Inc	Morgan Stanley	650.500	0,03
700	Ubiquiti Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(7.737)	UBS Group AG	Morgan Stanley	977	0,00
(788.689)	UCB SA	Goldman Sachs International	7.364	0,00
25	UCB SA	Morgan Stanley	4	0,00
(23.500)	UDR Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.300	UFP Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(84.900)	UGI Corp	Morgan Stanley	0	0,00
339.836	Ultra Electronics Holdings Plc	Goldman Sachs International	638.704	0,03
5.600	UMB Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
25.600	UMH Properties Inc	Morgan Stanley	0	0,00
17.881	Umicore SA	Morgan Stanley	1.307	0,00
27.100	Umpqua Holdings Corp	Morgan Stanley	0	0,00
80.600	Under Armour Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
1.326.061	Unibail-Rodamco-Westfield	Goldman Sachs International	144.628	0,01
6.000	Unicharm Corp	Morgan Stanley	2.469	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(70.028)	Unilever Plc	Morgan Stanley	530	0,00
(42.404)	Union Pacific Corp	Morgan Stanley	0	0,00
6.205.901	United Airlines Holdings Inc	Goldman Sachs International	11.556	0,00
(29.800)	United Airlines Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
17.700	United Bankshares Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(13.400)	United Community Banks Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.221)	United Internet AG	Morgan Stanley	201	0,00
(19.064)	United Parcel Service Inc Class B	Morgan Stanley	0	0,00
9.409	United Rentals Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(6.900)	United States Cellular Corp	Morgan Stanley	0	0,00
25.500	United States Steel Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(10.404)	United Utilities Group Plc	Morgan Stanley	1.531	0,00
700	UnitedHealth Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.700)	Universal Display Corp	Morgan Stanley	0	0,00
500	Universal Health Realty Income Trust	Morgan Stanley	0	0,00
7.200	Universal Health Services Inc Class B	Morgan Stanley	0	0,00
(455.902)	Unum Group	Goldman Sachs International	6.501	0,00
5.700	Unum Group	Morgan Stanley	0	0,00
24.400	Upland Software Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(35.000)	Urban Edge Properties	Morgan Stanley	0	0,00
(11.400)	Urban Outfitters Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(14.100)	US Bancorp	Morgan Stanley	0	0,00
(8.600)	US Concrete Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(33.400)	US Foods Holding Corp	Morgan Stanley	0	0,00
900	US Physical Therapy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(2.500)	USANA Health Sciences Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(100)	USS Co Ltd	Goldman Sachs International	5	0,00
1.349.057	Valeo SA	Goldman Sachs International	164.162	0,01
(1.454.580)	Valero Energy Corp	Goldman Sachs International	3.851	0,00
3.700	Valero Energy Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(18.100)	Valley National Bancorp	Morgan Stanley	0	0,00
4.900	Valmont Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(14.600)	Varonis Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.000)	Veeva Systems Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
1.129.583	Veeva Systems Inc Class A	Goldman Sachs International	25.541	0,00
(2.500)	Ventas Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.200)	Veoneer Inc	Morgan Stanley	0	0,00
31.200	Verint Systems Inc	Morgan Stanley	0	0,00
7.000	VeriSign Inc	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(24.900)	Veritex Holdings Inc	Morgan Stanley	0	0,00
2.005.105	Verizon Communications Inc	Goldman Sachs International	32.995	0,00
392.982	Verizon Communications Inc	Morgan Stanley	1.244	0,00
(2.363.480)	Vertiv Holdings Co	JPMorgan Chase Bank	904.690	0,04
(965.405)	Vertiv Holdings Co	Goldman Sachs International	157.211	0,01
(49.542)	Verve Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	32.460	0,00
(177.382)	Vestas Wind Systems A/S	Morgan Stanley	436	0,00
(2.700)	VF Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(2.163.855)	ViacomCBS Inc Class B	Goldman Sachs International	227.851	0,01
8.900	ViaSat Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(6.900)	Viavi Solutions Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(9.300)	Vicor Corp	Morgan Stanley	0	0,00
3.431	Victrex Plc	Morgan Stanley	86	0,00
375.627	Vifor Pharma AG	Goldman Sachs International	20.578	0,00
(1.604.786)	Vimeo Inc	Goldman Sachs International	45.236	0,00
11.000	Viper Energy Partners LP	Morgan Stanley	0	0,00
4	Virbac SA	Morgan Stanley	4	0,00
(11.994)	Virgin Money UK Plc	Morgan Stanley	457	0,00
(100)	Virtus Investment Partners Inc	Morgan Stanley	1.103	0,00
50.761	Visa Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(2.601.821)	Visa Inc Class A	Goldman Sachs International	18.424	0,00
107.900	Vishay Intertechnology Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(4.800)	Visteon Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(450)	Vistry Group Plc	Morgan Stanley	194	0,00
219.509	Viva Energy Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	6.463	0,00
(728)	Vivendi SE	Morgan Stanley	103	0,00
3.700	VMware Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(8.000)	Vocera Communications Inc	Morgan Stanley	0	0,00
4.533.775	Vodacom Group Ltd	Goldman Sachs International	339	0,00
(151.258)	Vodafone Group Plc	Morgan Stanley	1.532	0,00
245	Volitalia SA	Morgan Stanley	122	0,00
52.124.361	Volvo AB	Goldman Sachs International	351.100	0,01
(20)	Vontier Corp	Morgan Stanley	0	0,00
27.700	Vornado Realty Trust	Morgan Stanley	0	0,00
17.100	Voya Financial Inc	Morgan Stanley	0	0,00
36.517	Vulcan Materials Co	Morgan Stanley	0	0,00
19.900	W R Berkley Corp	Morgan Stanley	0	0,00
3.359	W R Grace & Co	Morgan Stanley	0	0,00
34.200	Wabash National Corp	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
9	Wacker Neuson SE	Morgan Stanley	1	0,00
(1.000)	Wacoal Holdings Corp	Morgan Stanley	126	0,00
(700)	Wacom Co Ltd	Morgan Stanley	3	0,00
7.700	Walgreens Boots Alliance Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(600)	Walker & Dunlop Inc	Morgan Stanley	0	0,00
29.500	Walmart Inc	Morgan Stanley	0	0,00
1.062.275	Walmart Inc	Goldman Sachs International	7.784	0,00
12.301.987	Walt Disney Co	Goldman Sachs International	80.170	0,00
(955.821)	Warner Music Group Corp Class A	Goldman Sachs International	13.385	0,00
(1.319.355)	Warner Music Group Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	51.410	0,00
(8.100)	Washington Trust Bancorp Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(33.500)	Waste Management Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.100)	Waters Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(12.900)	Watts Water Technologies Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
1.934.513	Wayfair Inc Class A	Goldman Sachs International	9.432	0,00
(27.500)	Webster Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
30.000	WEC Energy Group Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.071.874)	Weibo Corp	Goldman Sachs International	100.468	0,01
2.980.902	Weichai Power Co Ltd	Goldman Sachs International	19.529	0,00
(27.800)	Welbilt Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.451.062)	Wells Fargo & Co	Goldman Sachs International	27.781	0,00
(33.400)	Wells Fargo & Co	Morgan Stanley	0	0,00
(57.500)	Welltower Inc	Morgan Stanley	0	0,00
10.200	Wendy's Co	Morgan Stanley	0	0,00
60.320	Werner Enterprises Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.700)	WESCO International Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(35.238)	West Fraser Timber Co Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(5.800)	West Japan Railway Co	Morgan Stanley	8.614	0,00
(1.400)	West Pharmaceutical Services Inc	Morgan Stanley	0	0,00
8.500	Westamerica Bancorp	Morgan Stanley	0	0,00
24.400	Western Alliance Bancorp	Morgan Stanley	0	0,00
(5.544.614)	Western Digital Corp	Goldman Sachs International	28.848	0,00
4.900	Western Digital Corp	Morgan Stanley	0	0,00
52.500	Western Midstream Partners LP	Morgan Stanley	0	0,00
(18.900)	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Morgan Stanley	0	0,00
46.258	Westlake Chemical Corp	Morgan Stanley	0	0,00
1.998.751	Westlake Chemical Corp	Goldman Sachs International	15.607	0,00
267.695	Westpac Banking Corp	Goldman Sachs International	6.925	0,00
176.577	Westrock Co	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(31)	Westwing Group AG	Morgan Stanley	16	0,00
1.935.256	WEX Inc	Goldman Sachs International	26.318	0,00
(84.961)	Weyerhaeuser Co	Morgan Stanley	0	0,00
2.280.253	Weyerhaeuser Co	Goldman Sachs International	150.798	0,01
(118)	WH Smith Plc	Morgan Stanley	72	0,00
273.514	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	Goldman Sachs International	1.109	0,00
6.900	Whirlpool Corp	Morgan Stanley	0	0,00
10.944.764	WIG 20 Index	Morgan Stanley	39.408	0,00
6.900	Williams-Sonoma Inc	Morgan Stanley	0	0,00
532.921	Williams-Sonoma Inc	Goldman Sachs International	38.250	0,00
19.300	Willis Towers Watson Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(18.125)	Winbond Electronics Corp	Goldman Sachs International	80.935	0,01
(128.633)	Winbond Electronics Corp	Morgan Stanley	177.826	0,01
(1.800)	Wingstop Inc	Morgan Stanley	0	0,00
128.200	WisdomTree Investments Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.000)	Wix.com Ltd	Morgan Stanley	6.124	0,00
56.000	Wolverine World Wide Inc	Morgan Stanley	0	0,00
108.651	Workday Inc Class A	Morgan Stanley	6.823	0,00
272.020	Workday Inc Class A	Goldman Sachs International	9.318	0,00
(15.600)	Workiva Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(84.791.244)	Workman Co Ltd	Goldman Sachs International	7.007	0,00
(1.100)	World Acceptance Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(3.084.635)	Worldline SA	Goldman Sachs International	191.323	0,01
31.300	Worthington Industries Inc	Morgan Stanley	0	0,00
276.023	WPP Plc	Goldman Sachs International	1.767	0,00
(4.644)	WPP Plc	Morgan Stanley	866	0,00
(2.900)	Wright Medical Group NV	Morgan Stanley	0	0,00
5.355.927	W-Scope Corp	Goldman Sachs International	770	0,00
73.722.198	W-Scope Corp	Morgan Stanley	129.860	0,01
3.400	WSFS Financial Corp	Morgan Stanley	0	0,00
(316.281)	Wuliangye Yibin Co Ltd Class A	Goldman Sachs International	22.021	0,00
(365.581)	Wuliangye Yibin Co Ltd Class A	Morgan Stanley	40.381	0,00
(400)	WW Grainger Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(871.655)	Wyndham Hotels & Resorts Inc	Goldman Sachs International	86.054	0,01
2.000	Wyndham Hotels & Resorts Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(3.500)	Wynn Resorts Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
(860.298)	X5 Retail Group NV	Goldman Sachs International	62.074	0,00
26.100	Xcel Energy Inc	Morgan Stanley	0	0,00
13.500	Xenia Hotels & Resorts Inc	Morgan Stanley	0	0,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(138.834)	Xenon Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	2.584	0,00
293	X-Fab Silicon Foundries SE	Morgan Stanley	35	0,00
(4.100)	Xilinx Inc	Morgan Stanley	0	0,00
184.820	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd	Goldman Sachs International	1.995	0,00
2.799.031	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd	Morgan Stanley	40.251	0,00
(611.852)	Xinte Energy Co Ltd	Goldman Sachs International	6.931	0,00
859.678	Xli Deconstruction	Morgan Stanley	21.421	0,00
(17.300)	Xylem Inc	Morgan Stanley	0	0,00
0	Yageo Corporation	Morgan Stanley	0	0,00
(210.532.254)	Yakult Honsha Co Ltd	Goldman Sachs International	114.670	0,01
(4.200)	Yakult Honsha Co Ltd	Morgan Stanley	5.807	0,00
(1.200)	Yamaha Corp	Morgan Stanley	1.855	0,00
(93.048.636)	Yamaha Motor Co Ltd	Goldman Sachs International	15.749	0,00
(100.306.553)	Yamaha Motor Co Ltd	Morgan Stanley	46.464	0,00
45.872.951	Yamato Kogyo Co Ltd	Goldman Sachs International	12.772	0,00
(5.800)	Yamato Kogyo Co Ltd	Morgan Stanley	4.559	0,00
20.000.000	Yandex NV	Morgan Stanley	949.500	0,04
(904.835)	Yandex NV Class A	Goldman Sachs International	15.307	0,00
(100)	Yaoko Co Ltd	Morgan Stanley	49	0,00
(76.410)	Yara International ASA	Morgan Stanley	1.459	0,00
600	Yaskawa Electric Corp	Morgan Stanley	485	0,00
12.100	Yext Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(107.448.737)	Yokohama Rubber Co Ltd	Goldman Sachs International	83.891	0,01
13.100	Yum! Brands Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(280.163)	Yunnan Energy New Material Co Ltd	Goldman Sachs International	188.399	0,01
137.900	Z Holdings Corp	Morgan Stanley	15.845	0,00
(110.332.121)	Z Holdings Corp	Goldman Sachs International	6.958	0,00
(500)	Zebra Technologies Corp Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(2.206.187)	Zendesk Inc	Goldman Sachs International	39.091	0,00
(6.900)	Zenkoku Hoshu Co Ltd	Morgan Stanley	4.669	0,00
(900)	Zeon Corp	Morgan Stanley	70	0,00
4.610.678	Zeon Corp	Goldman Sachs International	2.792	0,00
(1.375.288)	Zhongsheng Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	19.458	0,00
(3.392.915)	Zhongsheng Group Holdings Ltd	Goldman Sachs International	13.532	0,00
(4.300)	Zions Bancorp NA	Morgan Stanley	0	0,00
(218.631)	Zions Bancorp NA	Goldman Sachs International	373	0,00
(16.200)	Zoetis Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(1.100)	Zoom Video Communications Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(1.577.517)	Zoom Video Communications Inc Class A	Goldman Sachs International	286.236	0,01

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias 4,15% (31 de diciembre de 2020: 4,14%) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
9.533.093	ZOZO Inc	Goldman Sachs International	883	0,00
(5.800)	Zscaler Inc	Morgan Stanley	0	0,00
29.200	Zuora Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(182)	Zurich Insurance Group AG	Morgan Stanley	911	0,00
(46.600)	Zynga Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(395.505)	Zynga Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	19.741	0,00
(2.273.227)	Zynga Inc Class A	Goldman Sachs International	17.537	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos por diferencias [∞]			91.194.838	4,15

Swaptions adquiridos 0,04% (31 de diciembre de 2020: 0,07%)

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Descripción	Contraparte	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Swaptions de compra					
175.000.000	19/08/2021	Opción CMS sobre diferencial entre 30 y 2 años de tipos CMS en EUR, ejercicio 0,90%	Goldman Sachs International	155.900	0,01
150.000.000	10/11/2021	Opción CMS sobre diferencial entre 30 y 5 años de tipos CMS en USD, ejercicio 1,00%	Goldman Sachs International	29.649	0,00
Swaptions de venta					
50.000.000	21/07/2021	Swaption PUT en USD, en caso de que se ejerza la opción, el Fondo formalizará un swap con un valor nominal de 50.000.000 USD en el que abonará un tipo del 1% y recibirá CDX.NA.IG.36, ejercicio 0,75%	Goldman Sachs International	3.077	0,00
200.000.000	03/07/2023	Opción CMS sobre diferencial entre 10 y 2 años de tipos CMS en USD, ejercicio 0,50%	Goldman Sachs International	637.862	0,03
Total valor razonable en swaptions adquiridos [∞]			826.488	0,04	

Contratos de credit default swap 0,02% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)

Importe nominal	Fecha de extinción	Contraparte	Obligación de referencia	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
12.700.000 USD	20/06/2025	Goldman Sachs International	Compra de protección contra impagos sobre Meituan, 2,13%, 28/10/2025	430.448	0,02
Total valor razonable en contratos de credit default swap [∞]			430.448	0,02	

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de swap de rentabilidad total 0,06% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)

Importe notional	Fecha de extinción	Tipo variable	Entidad de referencia	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
54.376.723 USD	24/04/2023	0,00 ¹	Goldman Sachs US Dispersion Series 1B Excess Return Strategy Index ⁵	798.441	0,04
2.999.647 USD	22/04/2022	0,00 ¹	Goldman Sachs Basket GSVICQ1E ⁵	24	0,00
339.279 USD	27/06/2022	(0,31) ²	JPMorgan Basket JPAYBPHA ⁶	2.252	0,00
5.937.209 USD	22/04/2022	0,00 ¹	Goldman Sachs Basket GSVIRVU2 ⁵	4.122	0,00
3.900.717 EUR	17/03/2022	1,10 ¹	Morgan Stanley Basket MSABBTE1 ⁷	126.306	0,01
20.551.649 HKD	12/01/2023	(0,37) ³	Morgan Stanley Basket MSABHSCC ⁷	104.569	0,01
3.150.622 USD	23/11/2022	(1,20) ⁴	Morgan Stanley Basket MSACHDGE ⁷	237	0,00
1.083.541 USD	23/02/2023	(0,80) ¹	Morgan Stanley Basket MSCBSBTU ⁷	2.640	0,00
290.759 USD	21/10/2022	(0,20) ⁴	Morgan Stanley Basket MSNBUXLU ⁷	7.996	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de swap de rentabilidad total [∞]				1.046.587	0,06

¹ Tipo fijo.

² El LIBOR a 1 meses es la referencia para este contrato de swap de rentabilidad total.

³ El HIBOR a 1 meses es la referencia para este contrato de swap de rentabilidad total.

⁴ El FEDEF a 1 día es la referencia para este contrato de swap de rentabilidad total.

⁵ La contraparte en este contrato de swap de rentabilidad total es Goldman Sachs International.

⁶ La contraparte en este contrato de swap de rentabilidad total es JPMorgan Chase Bank.

⁷ La contraparte en este contrato de swap de rentabilidad total es Morgan Stanley.

Contratos de swap de varianza 0,01% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)

Vega Importe notional	Fecha de extinción	Contraparte	Entidad de referencia	Tipo de ejercicio de varianza	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
150.000 USD/ (150.000)	16/12/2022	BNP	S&P 500 Index frente al Euro Stoxx 50 Index	19,25% 18,50%	148.063	0,01
200.000 USD/ (200.000)	16/12/2022	Goldman Sachs International	Euro Stoxx 50 frente al S&P 500 Sync Index	22,15% 20,00%	56.172	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de swaps de varianza [∞]					204.235	0,01

Contratos de swap sobre volatilidad 0,05% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)

Importe notional	Fecha de extinción	Contraparte	Obligación de referencia ¹	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
250.000 EUR	16/12/2022	BNP	BNP 19 Names RV EU Basket	292.552	0,01
300.000 EUR	16/12/2022	BNP	BNP 20 Names EU Basket	120.100	0,01
882.682 USD	16/12/2022	Goldman Sachs International	GS 19.1 Pairwise Theta Flat CoVol	112.634	0,01
250.000 USD	17/06/2022	Goldman Sachs International	GS 10 Names US Geo Basket	9.615	0,00
250.000 EUR	16/12/2022	BNP	BNP 22 Names EU Basket	116.862	0,01
500.000 USD	20/01/2023	BNP	BNP 32 Names Global Basket	101.238	0,01
420.000 EUR	16/12/2022	BNP	BNP 20 Names Global Basket	97.937	0,00
250.000 EUR	17/06/2022	BNP	BNP 15 Names EU Basket	53.476	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de swaps de volatilidad [∞]				904.414	0,05

¹ Los precios de ejercicio están denominados en varias divisas extranjeras basadas en las divisas locales de las posiciones del swap.

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de cross currency swap 0,00% (31 de diciembre de 2020: (0,00%))

Contraparte	El Fondo paga en función del importe teórico	Tipos abonados por el fondo	El Fondo percibe en función del importe teórico	Tipos recibidos por el fondo	Fecha de vencimiento	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Goldman Sachs International	498.506.800 USD	Floating rate based on USD 3M LIBOR	356.000.000 GBP	Floating rate based on GBP 3M LIBOR + 0.021%	15/12/2021	77.228	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de cross currency swap [∞]						77.228	0,00

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	1.287.055.333	58,70

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (1,62%) (31 de diciembre de 2020: (0,83%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
18.240.000 AUD	14.129.658 USD	15/09/2021	BNP Paribas	3	(431.553)	(0,02)
5.180.000 AUD	437.459.973 ¥	15/09/2021	BNP Paribas	4	(53.889)	(0,00)
300.000 AUD	231.281 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(5.983)	(0,00)
5.360.000 AUD	451.602.521 ¥	15/09/2021	Citibank NA	7	(46.217)	(0,00)
74.890.000 AUD	6.347.639.697 ¥	15/09/2021	Deutsche Bank AG	5	(986.911)	(0,05)
10.700.000 AUD	8.289.309 USD	15/09/2021	Deutsche Bank AG	6	(253.686)	(0,01)
12.970.000 AUD	1.100.103.340 ¥	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(177.886)	(0,02)
57.900.000 AUD	43.832.175 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(356.623)	(0,02)
34.000.000 AUD	2.853.071.960 ¥	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(183.205)	(0,02)
2.292.081 AUD	1.250.000 £	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(5.908)	(0,00)
6.104.971 AUD	3.875.000 €	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(14.507)	(0,00)
2.180.000 AUD	1.688.216 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	5	(51.050)	(0,00)
5.220.000 AUD	440.361.435 ¥	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	5	(50.008)	(0,00)
1.200.000 AUD	101.175.833 ¥	15/09/2021	UBS AG	2	(10.985)	(0,00)
2.090.000 AUD	1.604.325 USD	15/09/2021	UBS AG	5	(34.751)	(0,00)
2.180.000 BRL	437.302 USD	15/09/2021	Citibank NA	3	(6.826)	(0,00)
1.730.000 BRL	348.145 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(6.528)	(0,00)
2.590.000 BRL	516.468 USD	15/09/2021	UBS AG	2	(5.029)	(0,00)
90.030.000 CAD	74.468.134 USD	15/09/2021	Barclays Bank Plc	2	(1.765.263)	(0,09)
10.000.000 CAD	901.686.540 ¥	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(50.833)	(0,00)
960.000 CAD	785.176 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(9.937)	(0,00)
4.036.820 CAD	2.750.000 €	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(3.572)	(0,00)
13.538.069 CAD	10.996.700 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	4	(64.055)	(0,00)
2.830.000 CAD	2.298.063 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	8	(12.722)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (1,62%) (31 de diciembre de 2020: (0,83%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
270.000 CAD	219.264 USD	15/09/2021	UBS AG	1	(1.228)	(0,00)
1.030.000 CHF	1.152.480 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(35.904)	(0,00)
950.000 CHF	1.055.337 USD	15/09/2021	Deutsche Bank AG	3	(25.486)	(0,00)
2.390.138 CHF	1.875.000 £	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(2.387)	(0,00)
1.070.000 CHF	1.199.060 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(39.122)	(0,00)
11.000.000 CHF	11.987.513 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(76.590)	(0,00)
5.600.000 CHF	6.244.263 USD	16/09/2021	Morgan Stanley	1	(173.381)	(0,01)
590.000 CHF	660.293 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(20.701)	(0,00)
43.760.000 CHF	48.835.505 USD	15/09/2021	UBS AG	3	(1.397.287)	(0,06)
2.371.230.000 CLP	3.313.307 USD	15/09/2021	BNP Paribas	1	(63.255)	(0,01)
143.842.807 CLP	200.000 USD	15/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(2.515)	(0,00)
216.149.542 CLP	300.000 USD	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(3.136)	(0,00)
72.195.703 CLP	100.000 USD	07/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(858)	(0,00)
144.099.407 CLP	200.000 USD	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(2.112)	(0,00)
71.601.703 CLP	100.000 USD	09/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(1.679)	(0,00)
71.849.703 CLP	100.000 USD	08/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(1.336)	(0,00)
288.241.390 CLP	400.000 USD	12/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(4.233)	(0,00)
72.852.703 CLP	100.000 USD	29/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(21)	(0,00)
72.588.703 CLP	100.000 USD	02/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(394)	(0,00)
217.742.542 CLP	300.000 USD	14/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(1.048)	(0,00)
207.410.000 CLP	288.249 USD	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	1	(3.969)	(0,00)
664.860.000 CLP	911.716 USD	15/09/2021	UBS AG	1	(446)	(0,00)
12.000.000 CNY	1.867.559 USD	16/09/2021	Morgan Stanley	1	(20.619)	(0,00)
16.800.000 €	185.220.706 TRY	15/09/2021	Barclays Bank Plc	2	(555.046)	(0,03)
4.560.000 €	49.483.680 TRY	15/09/2021	BNP Paribas	4	(63.120)	(0,00)
2.890.454 €	13.140.000 PLN	15/09/2021	BNP Paribas	2	(19.130)	(0,00)
7.490.000 €	81.701.755 TRY	15/09/2021	Citibank NA	8	(150.480)	(0,00)
726.409 €	3.290.000 PLN	15/09/2021	Citibank NA	1	(1.587)	(0,00)
1.062.808 €	4.830.000 PLN	15/09/2021	Deutsche Bank AG	1	(6.634)	(0,00)
1.510.000 €	1.846.845 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(53.304)	(0,00)
12.875.000 €	15.377.075 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	4	(97.969)	(0,00)
875.000 €	1.288.952 CAD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(2.506)	(0,00)
1.375.000 €	2.181.699 AUD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(6.430)	(0,00)
37.500.000 €	4.966.951.080 ¥	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(261.662)	(0,01)
27.200.000 €	23.377.937 £	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(19.433)	(0,00)
750.000 €	7.630.987 SEK	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(2.527)	(0,00)
2.250.000 €	23.054.339 NOK	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(9.437)	(0,00)
1.030.000 €	11.205.865 TRY	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(17.428)	(0,00)
200.000 €	70.328.780 HUF	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(159)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (1,62%) (31 de diciembre de 2020: (0,83%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
600.000 €	2.721.490 PLN	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(2.942)	(0,00)
1.540.000 €	1.870.119 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	3	(40.946)	(0,00)
53.840.000 €	65.657.719 USD	15/09/2021	UBS AG	2	(1.707.890)	(0,08)
5.645.802 €	25.640.000 PLN	15/09/2021	UBS AG	8	(30.587)	(0,00)
65.440.000 £	92.489.624 USD	15/09/2021	BNP Paribas	2	(2.072.161)	(0,10)
690.000 £	973.533 USD	15/09/2021	Citibank NA	3	(20.170)	(0,00)
220.000 £	306.296 USD	15/09/2021	Deutsche Bank AG	1	(2.325)	(0,00)
30.959.938 £	36.100.000 €	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(67.322)	(0,00)
360.000 £	508.166 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(10.760)	(0,00)
2.125.000 £	3.928.606 AUD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(14.035)	(0,00)
15.750.000 £	22.004.658 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(244.835)	(0,02)
6.625.000 £	1.025.613.200 ¥	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(90.245)	(0,00)
3.100.000 £	4.376.371 USD	16/09/2021	Morgan Stanley	1	(93.136)	(0,01)
410.000 £	575.380 USD	15/09/2021	Société Générale	2	(8.889)	(0,00)
460.000 £	644.767 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	3	(9.192)	(0,00)
9.087.880.000 HUF	31.793.213 USD	15/09/2021	Citibank NA	2	(1.130.898)	(0,05)
58.926.600 HUF	200.000 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(1.001)	(0,00)
117.210.000 HUF	402.126 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(6.662)	(0,00)
152.640.000 HUF	521.735 USD	15/09/2021	UBS AG	1	(6.731)	(0,00)
5.460.000 ILS	1.680.512 USD	17/09/2021	Barclays Bank Plc	2	(3.351)	(0,00)
770.000 ILS	236.889 USD	17/09/2021	BNP Paribas	1	(366)	(0,00)
6.440.000 ILS	1.982.166 USD	17/09/2021	Citibank NA	2	(3.975)	(0,00)
133.540.000 ILS	41.166.925 USD	17/09/2021	Deutsche Bank AG	3	(147.112)	(0,02)
1.299.894 ILS	400.000 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(959)	(0,00)
1.230.000 ILS	379.197 USD	17/09/2021	UBS AG	1	(1.375)	(0,00)
4.604.240.000 INR	62.539.467 USD	15/09/2021	Citibank NA	2	(1.175.374)	(0,05)
204.607.692 INR	2.800.000 USD	12/07/2021	JPMorgan Chase Bank	4	(50.732)	(0,00)
7.307.984 INR	100.000 USD	01/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(1.682)	(0,00)
175.501.123 INR	2.400.000 USD	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(40.072)	(0,00)
7.312.171 INR	100.000 USD	07/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(1.687)	(0,00)
7.303.171 INR	100.000 USD	09/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(1.833)	(0,00)
21.870.314 INR	300.000 USD	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(5.767)	(0,00)
205.986.335 INR	2.800.000 USD	19/07/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(34.599)	(0,00)
7.351.354 INR	100.000 USD	15/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(1.258)	(0,00)
14.885.243 INR	200.000 USD	29/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(410)	(0,00)
7.451.871 INR	100.000 USD	26/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(44)	(0,00)
267.799.558 INR	3.600.000 USD	22/07/2021	JPMorgan Chase Bank	7	(6.077)	(0,00)
7.442.071 INR	100.000 USD	23/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(138)	(0,00)
260.501.800 INR	3.500.000 USD	28/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(6.600)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (1,62%) (31 de diciembre de 2020: (0,83%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
7.451.471 INR	100.000 USD	02/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(135)	(0,00)
29.410.000 ¥	266.346 USD	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	(1.193)	(0,00)
26.410.000 ¥	241.431 USD	15/09/2021	BNP Paribas	1	(3.325)	(0,00)
125.680.000 ¥	1.137.441 USD	15/09/2021	Citibank NA	2	(4.341)	(0,00)
385.981.889 ¥	4.660.000 AUD	15/09/2021	Citibank NA	7	(19.710)	(0,00)
10.710.000 ¥	96.927 USD	15/09/2021	Deutsche Bank AG	1	(368)	(0,00)
764.162.500 ¥	5.000.000 £	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(20.980)	(0,00)
9.312.500.000 ¥	84.208.238 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	4	(280.709)	(0,02)
434.829.504 ¥	5.260.000 AUD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(29.906)	(0,00)
3.483.599.900 ¥	26.500.000 €	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(52.829)	(0,01)
537.296.400 ¥	6.000.000 CAD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(2.986)	(0,00)
649.110.000 ¥	5.906.891 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	13	(54.676)	(0,00)
2.619.113.220 ¥	31.600.000 AUD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(123.218)	(0,01)
847.881.000 ¥	11.000.000 NZD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(44.376)	(0,00)
298.437.329 ¥	3.600.000 AUD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	6	(12.936)	(0,00)
251.990.000 ¥	2.294.874 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	8	(22.994)	(0,00)
768.173.703 ¥	9.250.000 AUD	15/09/2021	UBS AG	4	(21.018)	(0,00)
87.660.000 ¥	799.193 USD	15/09/2021	UBS AG	3	(8.872)	(0,00)
40.411.740.000 KRW	36.254.102 USD	15/09/2021	Citibank NA	5	(499.647)	(0,03)
334.252.923 KRW	300.000 USD	14/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(4.202)	(0,00)
557.822.509 KRW	500.000 USD	12/07/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(6.349)	(0,00)
1.554.298.346 KRW	1.400.000 USD	15/07/2021	JPMorgan Chase Bank	4	(24.529)	(0,00)
777.527.901 KRW	700.000 USD	07/07/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(11.242)	(0,00)
781.368.276 KRW	700.000 USD	01/07/2021	JPMorgan Chase Bank	6	(6.160)	(0,00)
111.791.728 KRW	100.000 USD	19/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(1.072)	(0,00)
2.330.870.306 KRW	2.100.000 USD	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	10	(34.246)	(0,00)
111.133.028 KRW	100.000 USD	09/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(1.650)	(0,00)
111.040.739 KRW	100.000 USD	08/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(1.685)	(0,00)
333.483.384 KRW	300.000 USD	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(3.874)	(0,00)
1.692.816.915 KRW	1.500.000 USD	29/07/2021	JPMorgan Chase Bank	6	(2.044)	(0,00)
113.006.739 KRW	100.000 USD	30/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(2)	(0,00)
451.808.674 KRW	400.000 USD	02/08/2021	JPMorgan Chase Bank	5	(206)	(0,00)
2.095.310.000 KRW	1.878.355 USD	15/09/2021	UBS AG	2	(24.520)	(0,00)
157.700.000 MXN	7.904.959 USD	17/09/2021	Barclays Bank Plc	2	(62.738)	(0,00)
834.100.000 MXN	41.647.054 USD	17/09/2021	Citibank NA	3	(168.321)	(0,01)
154.700.000 MXN	7.730.435 USD	17/09/2021	Deutsche Bank AG	2	(37.401)	(0,00)
373.000.000 MXN	18.720.802 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	4	(64.156)	(0,00)
62.850.000 MXN	3.152.547 USD	17/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	3	(27.098)	(0,00)
15.690.000 MXN	781.457 USD	17/09/2021	UBS AG	1	(1.214)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (1,62%) (31 de diciembre de 2020: (0,83%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
304.320.000 NOK	36.817.837 USD	15/09/2021	Citibank NA	3	(1.442.354)	(0,07)
9.386.661 NOK	1.100.000 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	4	(9.002)	(0,00)
12.500.000 NOK	12.446.158 SEK	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(2.930)	(0,00)
24.123.450 NOK	2.375.000 €	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(14.642)	(0,00)
6.820.000 NOK	817.095 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	3	(24.308)	(0,00)
5.890.000 NOK	700.552 USD	15/09/2021	UBS AG	2	(15.872)	(0,00)
390.000 NZD	276.551 USD	15/09/2021	BNP Paribas	1	(4.101)	(0,00)
16.980.000 NZD	12.242.478 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(380.422)	(0,02)
11.600.000 NZD	905.893.160 ¥	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	4	(59.227)	(0,00)
5.000.000 NZD	3.533.909 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	4	(40.373)	(0,00)
1.638.680.000 PHP	34.144.851 USD	15/09/2021	Citibank NA	2	(787.327)	(0,04)
116.660.000 PLN	31.819.172 USD	15/09/2021	Citibank NA	2	(1.168.480)	(0,06)
116.610.000 PLN	26.085.789 €	15/09/2021	Citibank NA	2	(346.503)	(0,03)
451.104 PLN	100.000 €	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(160)	(0,00)
16.460.000 PLN	3.646.583 €	15/09/2021	UBS AG	6	(6.700)	(0,00)
123.592.261 RUB	1.700.000 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(15.907)	(0,00)
300.310.000 SEK	36.306.934 USD	15/09/2021	Barclays Bank Plc	2	(1.166.785)	(0,06)
5.460.670 SEK	5.500.000 NOK	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(540)	(0,00)
2.930.000 SEK	346.041 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(3.193)	(0,00)
5.091.837 SEK	600.000 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	5	(4.424)	(0,00)
12.642.082 SEK	1.250.000 €	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(4.706)	(0,00)
2.850.000 SEK	344.625 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(11.138)	(0,00)
25.250.000 SEK	3.057.678 USD	15/09/2021	UBS AG	3	(103.102)	(0,01)
116.080.000 SGD	87.689.015 USD	15/09/2021	Barclays Bank Plc	2	(1.349.197)	(0,06)
403.142 SGD	300.000 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(112)	(0,00)
6.230.000 THB	194.469 USD	15/09/2021	BNP Paribas	1	(145)	(0,00)
99.030.000 THB	3.177.125 USD	15/09/2021	Citibank NA	3	(88.229)	(0,01)
45.960.000 TRY	5.234.690 USD	15/09/2021	Barclays Bank Plc	4	(145.494)	(0,00)
4.340.000 TRY	484.098 USD	15/09/2021	BNP Paribas	1	(3.525)	(0,00)
9.314.845 TRY	880.000 €	15/09/2021	BNP Paribas	2	(13.801)	(0,00)
72.660.000 TRY	8.225.456 USD	15/09/2021	Citibank NA	11	(179.742)	(0,00)
46.799.138 TRY	4.400.000 €	15/09/2021	Citibank NA	5	(44.095)	(0,02)
17.570.000 TRY	2.013.565 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(68.021)	(0,00)
61.458.527 TRY	7.000.000 USD	18/08/2021	JPMorgan Chase Bank	13	(98.217)	(0,00)
8.170.000 TRY	909.952 USD	15/09/2021	UBS AG	1	(5.280)	(0,00)
5.506.786 TWD	200.000 USD	09/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(2.631)	(0,00)
4.952.769 TWD	178.627 USD	23/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(902)	(0,00)
2.757.988 TWD	100.000 USD	15/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(1.100)	(0,00)
5.521.135 TWD	200.000 USD	08/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(2.078)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (1,62%) (31 de diciembre de 2020: (0,83%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
90.894.274 TWD	3.300.000 USD	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(40.329)	(0,00)
2.755.593 TWD	100.000 USD	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(1.100)	(0,00)
2.784.188 TWD	100.000 USD	02/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(5)	(0,00)
2.761.688 TWD	100.000 USD	01/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(882)	(0,00)
2.752.193 TWD	100.000 USD	12/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(1.333)	(0,00)
5.561.875 TWD	200.000 USD	29/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(315)	(0,00)
987.596 USD	1.320.000 AUD	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	(3.714)	(0,00)
3.519.924 USD	4.740.000 SGD	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	(5.668)	(0,00)
416.272 USD	471.220.000 KRW	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	(642)	(0,00)
397.102 USD	570.000 NZD	15/09/2021	Barclays Bank Plc	1	(1.094)	(0,00)
20.228.176 USD	182.950.000 TRY	15/09/2021	Barclays Bank Plc	2	(30.059)	(0,00)
7.487.813 USD	156.840.000 MXN	17/09/2021	BNP Paribas	4	(311.641)	(0,02)
17.161.679 USD	55.990.000 ILS	17/09/2021	BNP Paribas	10	(36.908)	(0,00)
18.710.725 USD	21.216.520.000 KRW	15/09/2021	BNP Paribas	11	(60.678)	(0,00)
1.479.538 USD	12.780.000 NOK	15/09/2021	BNP Paribas	2	(6.065)	(0,00)
1.275.768 USD	964.450.000 CLP	15/09/2021	BNP Paribas	1	(46.125)	(0,00)
3.892.389 USD	35.410.000 TRY	15/09/2021	BNP Paribas	6	(28.596)	(0,00)
6.527.224 USD	133.100.000 MXN	17/09/2021	Citibank NA	2	(91.671)	(0,00)
5.164.677 USD	47.060.000 TRY	15/09/2021	Citibank NA	9	(46.323)	(0,00)
994.722 USD	3.800.000 PLN	15/09/2021	Citibank NA	1	(3.672)	(0,00)
7.420.318 USD	8.393.570.000 KRW	15/09/2021	Citibank NA	4	(5.930)	(0,00)
1.541.264 USD	2.210.000 NZD	15/09/2021	Citibank NA	5	(2.619)	(0,00)
2.693.127 USD	23.130.000 SEK	15/09/2021	Citibank NA	3	(13.382)	(0,00)
2.527.233 USD	8.240.000 ILS	17/09/2021	Citibank NA	3	(3.868)	(0,00)
2.245.014 USD	168.630.000 INR	15/09/2021	Citibank NA	2	(2.442)	(0,00)
428.304 USD	310.000 £	15/09/2021	Citibank NA	1	(18)	(0,00)
675.379 USD	900.000 AUD	15/09/2021	Citibank NA	2	(514)	(0,00)
9.720.463 USD	13.080.000 SGD	15/09/2021	Citibank NA	4	(8.387)	(0,00)
9.462.647 USD	2.819.620.000 HUF	15/09/2021	Citibank NA	11	(50.690)	(0,00)
1.370.566 USD	1.009.680.000 CLP	15/09/2021	Citibank NA	2	(13.320)	(0,00)
862.737 USD	1.070.000 CAD	15/09/2021	Citibank NA	1	(1.331)	(0,00)
7.185.426 USD	62.130.000 NOK	15/09/2021	Deutsche Bank AG	6	(36.836)	(0,00)
9.471.011 USD	81.260.000 SEK	15/09/2021	Deutsche Bank AG	5	(37.459)	(0,00)
3.241.911 USD	10.570.000 ILS	17/09/2021	Deutsche Bank AG	2	(4.903)	(0,00)
3.093.586 USD	3.850.000 CAD	15/09/2021	Deutsche Bank AG	2	(15.445)	(0,00)
412.813 USD	550.000 AUD	15/09/2021	Deutsche Bank AG	1	(233)	(0,00)
248.120 USD	1.270.000 BRL	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(2.663)	(0,00)
2.887.867 USD	59.710.000 MXN	17/09/2021	Goldman Sachs International	2	(81.435)	(0,00)
1.454 USD	1.068.751 CLP	01/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(14)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (1,62%) (31 de diciembre de 2020: (0,83%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
1.407 USD	1.590.025 KRW	01/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(5)	(0,00)
1.800.000 USD	15.495.221 NOK	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(987)	(0,00)
2.160.266 USD	3.100.000 NZD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(5.726)	(0,00)
179 USD	4.981 TWD	01/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(0)	(0,00)
1.187.067 USD	4.530.000 PLN	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(3.125)	(0,00)
4.200.000 USD	37.635.243 TRY	18/08/2021	JPMorgan Chase Bank	6	(26.432)	(0,00)
200.000 USD	5.573.214 TWD	29/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(93)	(0,00)
200.000 USD	5.579.919 TWD	28/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(316)	(0,00)
100.000 USD	7.458.516 INR	22/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(95)	(0,00)
3.700.000 USD	103.108.157 TWD	02/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(3.145)	(0,00)
4.240.599 USD	38.790.000 TRY	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	5	(54.656)	(0,00)
185 USD	5.150 TWD	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(0)	(0,00)
100.000 USD	7.464.429 INR	26/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(125)	(0,00)
200.000 USD	149.880.593 CLP	22/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(5.731)	(0,00)
600.000 USD	442.029.880 CLP	21/07/2021	JPMorgan Chase Bank	4	(6.762)	(0,00)
100.000 USD	134.630 SGD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(148)	(0,00)
36.746.325 USD	49.000.000 AUD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(46.456)	(0,00)
786.614 USD	87.290.000 ¥	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(372)	(0,00)
2.800.000 USD	208.807.080 INR	19/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(3.270)	(0,00)
4.000.000 USD	111.931.494 TWD	26/07/2021	JPMorgan Chase Bank	5	(17.591)	(0,00)
937.063 USD	1.250.000 AUD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(1.678)	(0,00)
4.139.239 USD	5.570.000 SGD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(3.704)	(0,00)
400.000 USD	455.043.588 KRW	23/07/2021	JPMorgan Chase Bank	4	(2.676)	(0,00)
200.000 USD	147.050.593 CLP	02/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(1.781)	(0,00)
7.975.249 USD	5.780.000 £	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(10.890)	(0,00)
11.265.705 USD	233.000.000 MXN	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(388.446)	(0,02)
1.900.000 USD	2.154.764.571 KRW	26/07/2021	JPMorgan Chase Bank	11	(6.755)	(0,00)
100.000 USD	73.376.297 CLP	30/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(695)	(0,00)
300.000 USD	978.104 ILS	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(258)	(0,00)
100.000 USD	73.583.153 CLP	29/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(981)	(0,00)
326.082 USD	368.541.647 KRW	21/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(49)	(0,00)
600.000 USD	679.689.188 KRW	22/07/2021	JPMorgan Chase Bank	5	(1.469)	(0,00)
1.107.891 USD	23.060.000 MXN	17/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(38.853)	(0,00)
100.000 USD	7.459.766 INR	23/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(99)	(0,00)
2.666.117 USD	23.070.000 NOK	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(15.641)	(0,00)
1.200.000 USD	903.472.975 CLP	26/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(39.987)	(0,00)
1.127.821 USD	1.400.000 CAD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(2.736)	(0,00)
3.902.351 USD	4.838.069 CAD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(4.623)	(0,00)
400.000 USD	454.501.588 KRW	28/07/2021	JPMorgan Chase Bank	4	(2.187)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (1,62%) (31 de diciembre de 2020: (0,83%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
500.000 USD	7.181.127 ZAR	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(801)	(0,00)
1.500.000 USD	1.695.828.915 KRW	29/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(621)	(0,00)
100.000 USD	113.054.472 KRW	30/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(40)	(0,00)
300.000 USD	339.120.783 KRW	02/08/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(80)	(0,00)
1.082.307 USD	9.260.000 SEK	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(1.233)	(0,00)
800.000 USD	906.601.088 KRW	15/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	(2.294)	(0,00)
1.500.000 USD	446.520.600 HUF	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(7.934)	(0,00)
59.500.000 USD	385.854.717 CNY	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	4	(76.372)	(0,00)
3.966.008 USD	5.340.000 SGD	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	1	(5.861)	(0,00)
215.741 USD	1.960.000 TRY	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	1	(1.292)	(0,00)
5.637.419 USD	18.380.000 ILS	17/09/2021	Royal Bank of Scotland	3	(8.412)	(0,00)
13.057.892 USD	270.470.000 MXN	17/09/2021	Royal Bank of Scotland	9	(392.236)	(0,02)
1.260.711 USD	946.020.000 CLP	15/09/2021	Royal Bank of Scotland	1	(35.921)	(0,00)
264.446 USD	5.430.000 MXN	17/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(5.581)	(0,00)
4.128.586 USD	1.229.950.000 HUF	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	4	(21.240)	(0,00)
2.998.967 USD	3.398.280.000 KRW	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(7.675)	(0,00)
365.805 USD	5.290.000 ZAR	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(1.062)	(0,00)
7.997.787 USD	10.760.000 SGD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	4	(5.456)	(0,00)
608.089 USD	810.000 AUD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(215)	(0,00)
193.282 USD	240.000 CAD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(527)	(0,00)
2.164.027 USD	3.110.000 NZD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	4	(8.587)	(0,00)
2.701.044 USD	23.190.000 SEK	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	4	(12.485)	(0,00)
3.982.756 USD	5.360.000 SGD	15/09/2021	UBS AG	2	(3.991)	(0,00)
627.405 USD	9.060.000 ZAR	15/09/2021	UBS AG	1	(914)	(0,00)
868.318 USD	7.510.000 NOK	15/09/2021	UBS AG	2	(4.677)	(0,00)
221.925 USD	163.470.000 CLP	15/09/2021	UBS AG	1	(2.130)	(0,00)
3.348.595 USD	3.797.570.000 KRW	15/09/2021	UBS AG	4	(11.321)	(0,00)
2.309.599 USD	8.810.000 PLN	15/09/2021	UBS AG	3	(5.099)	(0,00)
12.299.679 USD	3.667.940.000 HUF	15/09/2021	UBS AG	7	(75.872)	(0,00)
925.256 USD	8.390.000 TRY	15/09/2021	UBS AG	3	(3.777)	(0,00)
4.273.590 USD	87.870.000 MXN	17/09/2021	UBS AG	3	(96.073)	(0,00)
492.887 USD	2.510.000 BRL	15/09/2021	UBS AG	3	(2.753)	(0,00)
572.766 USD	4.920.000 SEK	15/09/2021	UBS AG	1	(2.938)	(0,00)
607.998 USD	810.000 AUD	15/09/2021	UBS AG	2	(306)	(0,00)
456.180.000 ZAR	33.148.267 USD	15/09/2021	BNP Paribas	2	(1.511.762)	(0,07)
8.330.000 ZAR	583.977 USD	15/09/2021	Citibank NA	2	(6.283)	(0,00)
27.270.000 ZAR	1.952.065 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	5	(60.866)	(0,00)
4.272.936 ZAR	300.000 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(2.012)	(0,00)
10.900.000 ZAR	761.482 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(5.557)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (1,62%) (31 de diciembre de 2020: (0,83%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases CHF con cobertura						
1.897.249 CHF	2.062.265 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(8.794)	(0,00)
1.904.191 CHF	2.070.150 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(9.165)	(0,00)
2.082.057 CHF	2.268.298 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	7	(14.801)	(0,00)
Clases EUR con cobertura						
92.706.404 €	111.151.153 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	4	(1.171.056)	(0,05)
89.161.580 €	106.849.900 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(1.075.122)	(0,05)
182.643.711 €	220.400.605 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	77	(3.725.463)	(0,17)
Clases GBP con cobertura						
12.510.113 £	17.401.300 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(118.343)	(0,01)
96.702.360 £	135.015.653 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	64	(1.419.519)	(0,07)
546.545 USD	397.924 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	6	(3.196)	(0,00)
Clases SGD con cobertura						
24.327 SGD	18.196 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(98)	(0,00)
24.824 SGD	18.564 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(97)	(0,00)
23.964 SGD	17.914 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(87)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(35.713.166)	(1,62)

Contratos de futuros (0,54%) (31 de diciembre de 2020: (1,06%))

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(3)	10-Year Mini Japanese Government Bond Future September 2021	(207)	(0,00)
706	30 Day Federal Funds Future July 2021	(22.273)	(0,00)
251	30 Day Federal Funds Future August 2021	(630)	(0,00)
(32)	3-Month Euro Euribor Future September 2022	(623)	(0,00)
33	3-Month Euro Euribor Future September 2022	(4.876)	(0,00)
(1.158)	3-Month Euro Euribor Future December 2022	(8.242)	(0,00)
(508)	3-Month Euro Euribor Future December 2023	(12.467)	(0,00)
1.657	3-Month Euro Euribor Future September 2021	(13.274)	(0,00)
407	3-Month Euro Euribor Future June 2022	(30.166)	(0,00)
1.000	3-Month Euro Euribor 2yr Mid-Curve Future September 2021	(8.628)	(0,00)
(322)	90-Day Bank Bill Future September 2021	(5)	(0,00)
(53)	90-Day Bank Bill Future December 2021	(1.185)	(0,00)
(53)	90-Day Bank Bill Future June 2022	(1.888)	(0,00)
(52)	90-Day Bank Bill Future December 2022	(2.104)	(0,00)
(232)	90-Day Bank Bill Future March 2022	(2.431)	(0,00)
(96)	90-Day Bank Bill Future September 2022	(2.436)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de futuros (0,54%) (31 de diciembre de 2020: (1,06%)) (cont.)

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
785	90-Day Bank Bill Future September 2021	(14.184)	(0,00)
322	90-Day Bank Bill Future June 2022	(41.680)	(0,00)
(4)	90-Day Eurodollar Future September 2022	(104)	(0,00)
(11)	90-Day Eurodollar Future December 2024	(1.387)	(0,00)
22	90-Day Eurodollar Future March 2023	(8.110)	(0,00)
(876)	90-Day Eurodollar Future March 2022	(23.163)	(0,00)
(1.400)	90-Day Eurodollar Future June 2024	(110.574)	(0,01)
(1.400)	90-Day Eurodollar Future June 2025	(291.970)	(0,01)
(24)	90-Day Eurodollar Future June 2022	(600)	(0,00)
(2.787)	90-Day Eurodollar Future December 2022	(70.923)	(0,00)
374	90-Day Eurodollar Future June 2022	(74.800)	(0,00)
(2.071)	90-Day Eurodollar Future December 2021	(143.573)	(0,01)
2.751	90-Day Eurodollar Future September 2021	(151.753)	(0,01)
994	90-Day Sterling Future September 2021	(30.138)	(0,00)
529	90-Day Sterling Future June 2022	(45.666)	(0,00)
(1.757)	90-Day Sterling Future March 2023	(77.214)	(0,00)
(1.322)	90-Day Sterling Future September 2023	(141.158)	(0,01)
(3.323)	90-Day Sterling Future December 2021	(11.386)	(0,00)
1.524	Australian Dollar Currency Future September 2021	(728.444)	(0,03)
(1.808)	Australian Government Bond 10-Year Future September 2021	(273.515)	(0,01)
(435)	Australian Government Bond 3-Year Future September 2021	(20.741)	(0,00)
629	Australian Government Bond 3-Year Future September 2021	(169.589)	(0,01)
63	Brazil Real Currency Future July 2021	(10.360)	(0,00)
1	British Pound Currency Future September 2021	(187)	(0,00)
365	CAC40 Index Future July 2021	(315.058)	(0,02)
(1.794)	Canadian 10-Year Bond Future September 2021	(685.819)	(0,03)
455	Canadian Dollar Currency Future September 2021	(1.975)	(0,00)
(51)	DAX Index Future September 2021	(13.430)	(0,00)
(142)	DJIA Mini E-CBOT Future September 2021	(159.970)	(0,01)
(53)	E-mini Russell 2000 Index Future September 2021	(1.115)	(0,00)
313	Euro Stoxx 50 Future September 2021	(61.928)	(0,00)
1	Euro Stoxx 50 Index Dividend Future December 2022	(107)	(0,00)
715	Euro Stoxx 50 Index Dividend Future December 2023	(47.080)	(0,00)
3	Euro/Japanese Yen Future September 2021	(1.971)	(0,00)
(3)	Euro/Pound Sterling Currency Future September 2021	(1.476)	(0,00)
(2.946)	Euro-BOBL Future September 2021	(351.548)	(0,02)
(94)	Euro-BTP Future September 2021	(57.575)	(0,00)
(108)	Euro-Bund Future September 2021	(122.954)	(0,01)
142	Euro-Bund Future August 2021	(7.761)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de futuros (0,54%) (31 de diciembre de 2020: (1,06%)) (cont.)

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
142	Euro-Bund Future August 2021	(45.659)	(0,00)
70	Euro-Bund Future September 2021	(1.726)	(0,00)
(70)	Euro-Bund Future September 2021	(3.386)	(0,00)
(70)	Euro-Bund Future September 2021	(66)	(0,00)
140	Euro-Bund Future September 2021	(1.791)	(0,00)
(140)	Euro-Bund Future September 2021	(961)	(0,00)
(30)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2021	(71.367)	(0,00)
(308)	Euro-OAT Future September 2021	(197.085)	(0,01)
(7.755)	Euro-Schatz Future September 2021	(1.115)	(0,00)
2.123	Euro-Schatz Future August 2021	(19.054)	(0,00)
(4.246)	Euro-Schatz Future August 2021	(25.875)	(0,02)
4.200	Euro-Schatz Future September 2021	(53.743)	(0,00)
2.100	Euro-Schatz Future September 2021	(14.419)	(0,00)
2.660	Euro Stoxx Bank Future September 2021	(678.216)	(0,03)
2.118	FTSE 100 Index Future September 2021	(992.865)	(0,05)
233	FTSE China A50 Index Future July 2021	(268)	(0,00)
(15)	FTSE/JSE Top 40 Index Future September 2021	(3.329)	(0,00)
120	Hang Seng China Enterprises Index Future July 2021	(148.702)	(0,01)
178	Hang Seng Index Future July 2021	(272.250)	(0,01)
487	Japan Government 10-Year Bond (OSE) Future September 2021	(45.229)	(0,00)
(4)	Long Swiss Confederation Bond Future September 2021	(2.348)	(0,00)
52	Mexican Peso Currency Future September 2021	(2.955)	(0,00)
5	Mini- TOPIX Index Future September 2021	(237)	(0,00)
(38)	Mini-DAX Future September 2021	(2.585)	(0,00)
11	Mini-Hang Seng Index Future July 2021	(8.021)	(0,00)
(3)	MSCI EAFE Index Future September 2021	(100)	(0,00)
(19)	MSCI Emerging Markets Index Future September 2021	(6.060)	(0,00)
(212)	Nasdaq 100 E-mini Future September 2021	(89.819)	(0,00)
1.245	New Zealand Dollar Currency Future September 2021	(422.296)	(0,02)
(1)	Nikkei 225 (CME) Future September 2021	(275)	(0,00)
3	Nikkei 225 (OSE) Future September 2021	(3.424)	(0,00)
114	Nikkei 225 (SGX) Future September 2021	(10.431)	(0,00)
129	Nikkei 225 Mini Future September 2021	(6.834)	(0,00)
(15)	OMXS30 Index Future July 2021	(2.111)	(0,00)
450	OMXS30 Index Future July 2021	(43.119)	(0,00)
(443)	S&P 500 E-mini Future September 2021	(11.981)	(0,00)
443	S&P 500 E-mini Future June 2022	(23.963)	(0,00)
(1.678)	S&P 500 E-mini Future September 2021	(2.302.757)	(0,11)
(27)	SGX FTSE Taiwan Future July 2021	(13.610)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de futuros (0,54%) (31 de diciembre de 2020: (1,06%)) (cont.)

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
245	SGX Nifty 50 Future July 2021	(65.980)	(0,00)
167	SPI 200 Index Future September 2021	(121.435)	(0,01)
53	TOPIX Index Future September 2021	(119.335)	(0,01)
(130)	United Kingdom Long Gilt Future September 2021	(85.733)	(0,00)
(2.674)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2021	(973.574)	(0,05)
(2.997)	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future September 2021	(152.330)	(0,01)
(1.480)	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2021	(199.299)	(0,01)
(32)	US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2021	(22.906)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de futuros *		(11.653.045)	(0,54)

Contratos de opciones sobre índices suscritos (0,39%) (31 de diciembre de 2020: (1,68%))

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de compra					
(350)	21/07/2021	CBOE VIX Index, Strike Price \$16 ⁺	24.815	(20.125)	(0,00)
(125.000)	17/12/2021	Euro STOXX 50 Index, Strike Price EUR4,000 ^{oo}	295.718	(811.562)	(0,04)
(7.000)	20/08/2021	Euro Stoxx Bank, Strike Price EUR105 ⁺	499.836	(207.533)	(0,01)
(122)	16/07/2021	DAX Index, Strike Price EUR15,700 ⁺	180.063	(76.970)	(0,00)
(9)	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW425 ⁺	18.139	(29.770)	(0,00)
(144)	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW433 ⁺	186.586	(238.157)	(0,01)
(351)	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW435 ⁺	376.289	(432.458)	(0,02)
(327)	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW438 ⁺	303.378	(283.111)	(0,01)
(102)	12/08/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW438 ⁺	192.304	(200.848)	(0,01)
(2)	01/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW440 ⁺	698	(266)	(0,00)
(153)	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW440 ⁺	100.810	(87.630)	(0,01)
(71)	12/08/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW440 ⁺	116.597	(111.908)	(0,01)
(1)	01/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW443 ⁺	129	(24)	(0,00)
(7)	12/08/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW443 ⁺	8.555	(9.339)	(0,00)
(8)	12/08/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW445 ⁺	8.113	(8.880)	(0,00)
(17)	12/08/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW448 ⁺	14.264	(15.511)	(0,00)
(17)	09/07/2021	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY28,750 ⁺	43.036	(41.355)	(0,00)
(69)	13/08/2021	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY28,750 ⁺	389.479	(376.115)	(0,02)
(31)	13/08/2021	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY29,000 ⁺	137.311	(131.273)	(0,01)
(32)	13/08/2021	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY29,500 ⁺	82.456	(77.845)	(0,00)
(42)	16/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,225 ⁺	118.088	(173.250)	(0,01)
(112)	16/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,230 ⁺	403.404	(438.200)	(0,02)
(16)	17/09/2021	S&P 500 Index, Strike Price \$4,265 ⁺	177.574	(200.960)	(0,01)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de opciones sobre índices suscritos (0,39%) (31 de diciembre de 2020: (1,68%)) (cont.)

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de compra (cont.)					
(71)	15/07/2021	S&P ASX 200 Index, Strike Price AUD7,300 [±]	58.916	(43.815)	(0,00)
(59)	19/08/2021	S&P ASX 200 Index, Strike Price AUD7,300 [±]	59.527	(58.823)	(0,00)
(7)	15/07/2021	S&P ASX 200 Index, Strike Price AUD7,325 [±]	5.710	(3.568)	(0,00)
(15)	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,600 [±]	20.593	(31.225)	(0,00)
(11)	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,700 [±]	13.511	(20.924)	(0,00)
(54)	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,800 [±]	57.368	(93.997)	(0,01)
(168)	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,900 [±]	158.201	(266.810)	(0,01)
(18)	18/08/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,900 [±]	17.935	(25.841)	(0,00)
(444)	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,000 [±]	350.537	(629.448)	(0,03)
(25)	18/08/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,000 [±]	23.277	(32.750)	(0,00)
(363)	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,100 [±]	245.024	(462.503)	(0,02)
(203)	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,200 [±]	130.105	(225.859)	(0,01)
Opciones de venta					
(137)	16/07/2021	DAX Index, Strike Price EUR15,700 [±]	212.952	(216.570)	(0,01)
(124)	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW428 [±]	171.808	(14.865)	(0,00)
(237)	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW430 [±]	325.418	(43.143)	(0,00)
(8)	12/08/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW430 [±]	9.406	(8.152)	(0,00)
(44)	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW433 [±]	31.761	(12.112)	(0,00)
(24)	12/08/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW433 [±]	32.946	(28.771)	(0,00)
(51)	12/08/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW435 [±]	80.472	(70.987)	(0,00)
(10)	01/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW438 [±]	3.010	(1.243)	(0,00)
(108)	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW438 [±]	83.741	(64.254)	(0,00)
(60)	12/08/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW438 [±]	105.320	(97.101)	(0,01)
(26)	08/07/2021	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW440 [±]	24.915	(22.279)	(0,00)
(54)	16/07/2021	NASD 100 E-mini, Strike Price \$13,700 [±]	(256.000)	(33.210)	(0,00)
(2)	16/07/2021	NASD 100 E-mini, Strike Price \$14,100 [±]	(618.210)	(2.510)	(0,00)
(25)	09/07/2021	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY28,750 [±]	57.924	(50.680)	(0,00)
(82)	13/08/2021	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY28,750 [±]	434.961	(413.731)	(0,02)
(34)	13/08/2021	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY29,000 [±]	216.764	(206.775)	(0,01)
(69)	16/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,070 [±]	285.438	(23.288)	(0,00)
(500)	16/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,220 [±]	668.255	(456.250)	(0,02)
(84)	16/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,225 [±]	115.427	(79.800)	(0,01)
(113)	16/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,240 [±]	163.277	(121.475)	(0,01)
(4)	23/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,280 [±]	8.853	(8.150)	(0,00)
(2)	23/07/2021	S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,290 [±]	4.685	(4.425)	(0,00)
(30)	16/07/2021	S&P 500 Index, Strike Price \$4,200 [±]	64.104	(41.250)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de opciones sobre índices suscritos (0,39%) (31 de diciembre de 2020: (1,68%)) (cont.)

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de venta (cont.)					
(1)	15/07/2021	S&P ASX 200 Index, Strike Price AUD7,275 [±]	764	(423)	(0,00)
(60)	19/08/2021	S&P ASX 200 Index, Strike Price AUD7,300 [±]	69.619	(65.540)	(0,00)
(38)	15/07/2021	S&P ASX 200 Index, Strike Price AUD7,350 [±]	27.306	(25.562)	(0,00)
(3)	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,000 [±]	1.949	(132)	(0,00)
(6)	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,400 [±]	1.578	(388)	(0,00)
(276)	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,500 [±]	112.541	(20.059)	(0,00)
(12)	18/08/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,500 [±]	7.477	(3.036)	(0,00)
(335)	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,600 [±]	138.292	(27.954)	(0,00)
(6)	18/08/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,600 [±]	4.175	(1.701)	(0,00)
(487)	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,700 [±]	228.781	(45.445)	(0,00)
(741)	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,800 [±]	390.513	(79.785)	(0,01)
(19)	18/08/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,800 [±]	15.570	(6.649)	(0,00)
(937)	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,900 [±]	538.887	(112.659)	(0,01)
(23)	18/08/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD16,900 [±]	19.541	(8.874)	(0,00)
(1.136)	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,000 [±]	618.251	(161.048)	(0,01)
(35)	18/08/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,000 [±]	25.149	(15.388)	(0,00)
(293)	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,100 [±]	146.330	(47.847)	(0,00)
(23)	18/08/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,100 [±]	17.623	(11.227)	(0,00)
(10)	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,400 [±]	3.005	(2.728)	(0,00)
(35)	21/07/2021	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,500 [±]	12.648	(11.682)	(0,00)
Total valor razonable en contratos de opciones sobre índices suscritos				(8.537.801)	(0,39)

Contratos de opciones sobre divisas suscritos (0,00)% (31 de diciembre de 2020: (0,23%))

Nocional nocional	Fecha de vencimiento	Tipo ¹	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de venta					
(35.000.000) USD	09/12/2021	United States Dollar/Mexican Peso Currency Option, Strike Price MXN19	104.685	(63.595)	(0,00)
Total valor razonable en contratos de opciones sobre divisas suscritos [∞]				(63.595)	(0,00)

¹ La contraparte en todos los contratos de opciones de divisas es Goldman Sachs International.

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de opciones sobre renta variable suscritos (0,01%) (31 de diciembre de 2020: (1,13%))

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de compra					
(117)	17/09/2021	Digimarc Corp, Strike Price \$65	24.305	(585)	(0,00)
(20)	16/07/2021	Etsy Inc, Strike Price \$210	1.906	(11.250)	(0,00)
(42)	17/09/2021	Facebook Inc, Strike Price \$350	39.666	(77.910)	(0,00)
Opciones de venta					
(120)	21/01/2022	Alibaba Group Holding, Strike Price \$190	110.159	(105.000)	(0,01)
(51)	17/09/2021	Facebook Inc, Strike Price \$225	60.233	(2.678)	(0,00)
(203)	17/09/2021	Digimarc Corp, Strike Price \$25	48.705	(19.793)	(0,00)
Total valor razonable en contratos de opciones sobre renta variable suscritos *				(217.216)	(0,01)

Contratos de opciones sobre renta fija suscritos (0,00%) (31 de diciembre de 2020: (0,00%))

Número de contratos	Fecha de vencimiento	Tipo	Prima USD	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Opciones de venta					
(140)	23/07/2021	US Treasury 10-Year Note Futures, Strike Price \$129	4.200	(2.188)	(0,00)
Total valor razonable en contratos de opciones sobre renta fija suscritos *				(2.188)	(0,00)

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%))

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
12.701	3i Group Plc	Morgan Stanley	(2.367)	(0,00)
765	888 Holdings Plc	Morgan Stanley	(26)	(0,00)
1.192	Aalberts NV	Morgan Stanley	(211)	(0,00)
486.440	ABB Ltd	Morgan Stanley	(66.114)	(0,00)
(763.380)	AbbVie Inc	Goldman Sachs International	(19.857)	(0,00)
(142)	Accell Group NV	Morgan Stanley	(176)	(0,00)
1.802.582	Accenture Plc Class A	Goldman Sachs International	(32.137)	(0,00)
700	Acciona SA	Morgan Stanley	(246)	(0,00)
1.289	Accor SA	Morgan Stanley	(202)	(0,00)
(8.301)	Acerinox SA	Morgan Stanley	(332)	(0,00)
535	Ackermans & van Haaren NV	Morgan Stanley	(615)	(0,00)
1.033.316	Activision Blizzard Inc	Goldman Sachs International	(17.801)	(0,00)
498.368	Acushnet Holdings Corp	Goldman Sachs International	(51.795)	(0,00)
3.700.366	Adecco Group AG	Goldman Sachs International	(163.190)	(0,01)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
1.586.791	Adecco Group AG	Morgan Stanley	(127.934)	(0,01)
(10.300)	ADEKA Corp	Morgan Stanley	(8.730)	(0,00)
126	adidas AG	Morgan Stanley	(7)	(0,00)
2.367	Admiral Group Plc	Morgan Stanley	(1.891)	(0,00)
393.444	Adobe Inc	Goldman Sachs International	(74.853)	(0,01)
4.000	Advantest Corp	Morgan Stanley	(1.756)	(0,00)
3	Adyen NV	Morgan Stanley	(42)	(0,00)
(365.370)	Aea-Bridges Impact Corp Class A	Goldman Sachs International	(22.168)	(0,00)
(173.365)	Aea-Bridges Impact Corp Class A	Morgan Stanley	(7.768)	(0,00)
(98.595)	Aemetis Inc	Goldman Sachs International	(54.437)	(0,00)
(5.678.065)	Aemetis Inc	Morgan Stanley	(2.013.906)	(0,09)
5.804	Aena SME SA	Morgan Stanley	(5.114)	(0,00)
10.900	AEON Financial Service Co Ltd	Morgan Stanley	(1.075)	(0,00)
20.200	Aeon Mall Co Ltd	Morgan Stanley	(17.445)	(0,00)
836	Aeroports de Paris	Morgan Stanley	(6.364)	(0,00)
(690.417)	Aes Corp	Goldman Sachs International	(20.747)	(0,00)
215.083	Aflac Inc	Goldman Sachs International	(3.140)	(0,00)
(148.292.800)	AGC Inc	Goldman Sachs International	(72.591)	(0,00)
1.636.237	Agora Inc	Goldman Sachs International	(16.294)	(0,00)
(4.325.789)	Agricultural Bank of China Ltd	Goldman Sachs International	(109.362)	(0,01)
5.520.507	AIA Group Ltd	Goldman Sachs International	(9.760)	(0,00)
206.512	AIA Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	(462)	(0,00)
11.356	Air Liquide SA	Morgan Stanley	(1.168)	(0,00)
759.708	Airbnb Inc Class A	Goldman Sachs International	(5.556)	(0,00)
7.000.000	Airbnb Inc	UBS AG	(8.400)	(0,00)
132.772	Airbus SE	Morgan Stanley	(352.480)	(0,02)
8.700	Aisin Corp	Morgan Stanley	(5.146)	(0,00)
(92)	AJ Bell Plc	Morgan Stanley	(10)	(0,00)
32.710	Akzo Nobel NV	Morgan Stanley	(1.588)	(0,00)
13	Albioma SA	Morgan Stanley	(5)	(0,00)
(384)	ALD SA	Morgan Stanley	(35)	(0,00)
275.988	Alfa Laval AB	Morgan Stanley	(4)	(0,00)
26	Alfen Beheer BV	Morgan Stanley	(2)	(0,00)
4.100	Alfresa Holdings Corp	Morgan Stanley	(1.586)	(0,00)
(1.763.269)	Alibaba Group Holding Ltd	Morgan Stanley	(32.472)	(0,00)
(6.440.474)	Allegion Plc	Goldman Sachs International	(12.981)	(0,00)
(1.957.475)	Alliance Data Systems Corp	Goldman Sachs International	(5.017)	(0,00)
634.233	Allianz SE	Morgan Stanley	(31.628)	(0,00)
3.105	Almirall SA	Morgan Stanley	(952)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patri- monio neto
500	Alpen Co Ltd	Morgan Stanley	(129)	(0,00)
(6.580.673)	Alphabet Inc Class A	Goldman Sachs International	(303)	(0,00)
70.500	Alps Alpine Co Ltd	Morgan Stanley	(14.100)	(0,00)
(4.251)	Alstom SA	Goldman Sachs International	(356)	(0,00)
18	Altarea SCA	Morgan Stanley	(37)	(0,00)
652	Alten SA	Morgan Stanley	(2.810)	(0,00)
(1.540.442)	Altice USA Inc Class A	Goldman Sachs International	(65.049)	(0,00)
108.519	ALX Oncology Holdings Inc	Goldman Sachs International	(290)	(0,00)
28.500	Amada Co Ltd	Morgan Stanley	(6.881)	(0,00)
2.194.687	Amadeus IT Group SA	Goldman Sachs International	(19.103)	(0,00)
872	Amadeus IT Group SA	Morgan Stanley	(2.069)	(0,00)
967.386	Amazon.com Inc	Goldman Sachs International	(2.457)	(0,00)
601.249	AMC Networks Inc Class A	Goldman Sachs International	(27.733)	(0,00)
2.468.803	Amcorg Plc	JPMorgan Chase Bank	(22.905)	(0,00)
92.256	Amdocs Ltd	Morgan Stanley	(8.386)	(0,00)
551.594	Amdocs Ltd	Goldman Sachs International	(1.558)	(0,00)
1.280.322	American Airlines Group Inc	Goldman Sachs International	(1.821)	(0,00)
785.489	American Express Co	Goldman Sachs International	(44.858)	(0,00)
443.889	American Tower Corp	Goldman Sachs International	(48.906)	(0,00)
(8.290.610)	AMETEK Inc	Goldman Sachs International	(29.500)	(0,00)
2.015.179	Amgen Inc	JPMorgan Chase Bank	(56.290)	(0,00)
1.463.774	Amgen Inc	Goldman Sachs International	(9.962)	(0,00)
(1.837.858)	ams AG	Goldman Sachs International	(148.703)	(0,01)
2.437	Amundi SA	Morgan Stanley	(3.271)	(0,00)
(577.902)	Anaplan Inc	Goldman Sachs International	(20.907)	(0,00)
400	AnGes Inc	Morgan Stanley	(131)	(0,00)
(432.026)	Angi Inc	Goldman Sachs International	(13.983)	(0,00)
(1.399.710)	Anglo American Plc	Goldman Sachs International	(184.664)	(0,01)
1.879	Anheuser-Busch InBev SA	Morgan Stanley	(3.148)	(0,00)
1.685.215	ANSYS Inc	Goldman Sachs International	(35.741)	(0,00)
3.595.608	Anta Sports Products Ltd	Goldman Sachs International	(122.252)	(0,01)
1.032.672	Anta Sports Products Ltd	Morgan Stanley	(54.305)	(0,00)
975.168	Antero Midstream Corp	Goldman Sachs International	(195.812)	(0,01)
4.647	Antofagasta Plc	Morgan Stanley	(676)	(0,00)
252.179	AO Smith Corp	Goldman Sachs International	(7.616)	(0,00)
2.645.624	AP Moller - Maersk A/S Class B	Morgan Stanley	(109.849)	(0,01)
2.865.156	AP Moller - Maersk A/S Class B	Goldman Sachs International	(46.096)	(0,00)
1.462	APERAM SA	Morgan Stanley	(489)	(0,00)
(275.553)	Apollo Strategic Growth Class A	Morgan Stanley	(8.369)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(1.692.190)	Apollo Strategic Growth Class A	Goldman Sachs International	(125.136)	(0,01)
606.185	Appian Corp	Goldman Sachs International	(50.352)	(0,00)
(86.638.241)	Appier Group Inc	Goldman Sachs International	(27.068)	(0,00)
2.240.773	Apple Inc	Goldman Sachs International	(164.495)	(0,02)
241.482	Applied Materials Inc	Morgan Stanley	(106.220)	(0,01)
770.824	Applied Materials Inc	Goldman Sachs International	(23.137)	(0,00)
617.130	AppLovin Corp Class A	Goldman Sachs International	(43.280)	(0,00)
533.343	ArcelorMittal SA	Goldman Sachs International	(29.956)	(0,00)
(587.292)	Ares Acquisition Corp	Morgan Stanley	(15.042)	(0,00)
22	ARGAN SA	Morgan Stanley	(55)	(0,00)
15	Argenx SE	Morgan Stanley	(142)	(0,00)
14.543	Arkema SA	Goldman Sachs International	(88.180)	(0,01)
1.140	Aroundtown SA	Morgan Stanley	(133)	(0,00)
(496.922)	Arrow Electronics Inc	Goldman Sachs International	(28.678)	(0,00)
(200)	As One Corp	Morgan Stanley	(560)	(0,00)
2.200	Asahi Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	(4.602)	(0,00)
68.051.310	Asahi Kasei Corp	Morgan Stanley	(9.860)	(0,00)
(254.022.513)	Asahi Kasei Corp	Goldman Sachs International	(90.103)	(0,01)
(55.481)	Ascendis Pharma A/S	Goldman Sachs International	(1.695)	(0,00)
27.975	Ashmore Group Plc	Morgan Stanley	(1.762)	(0,00)
(55.817)	Ashtead Group Plc	Morgan Stanley	(42.239)	(0,00)
(6.300)	Asics Corp	Morgan Stanley	(10.967)	(0,00)
(1.848.521)	ASML Holding NV	Goldman Sachs International	(17.788)	(0,00)
370	ASML Holding NV	Morgan Stanley	(3.112)	(0,00)
131.169	Asos Plc	Morgan Stanley	(9.335)	(0,00)
(2.759.040)	ASR Nederland NV	Goldman Sachs International	(273.215)	(0,01)
11.848.442	Assa Abloy AB Class B	Goldman Sachs International	(95.524)	(0,01)
3.848.973	Assicurazioni Generali	Goldman Sachs International	(4.647)	(0,00)
4.185	Associated British Foods Plc	Morgan Stanley	(1.397)	(0,00)
(62.427.355)	Astellas Pharma Inc	Morgan Stanley	(8.836)	(0,00)
(11.300)	Atom Corp	Morgan Stanley	(553)	(0,00)
(215.082)	AU Optronics Corp	Goldman Sachs International	(76.269)	(0,01)
(526.041)	Auto Trader Group Plc	Morgan Stanley	(270.262)	(0,01)
(73.742)	AUTO1 Group SE	Goldman Sachs International	(8.274)	(0,00)
334.222	Autoliv Inc	JPMorgan Chase Bank	(9.180)	(0,00)
(164.532)	Avanti Acquisition Corp Class A	Morgan Stanley	(7.028)	(0,00)
(1.242.247)	Avanti Acquisition Corp Class A	Goldman Sachs International	(95.760)	(0,01)
4.499	AVEVA Group Plc	Morgan Stanley	(1.528)	(0,00)
(1.892.031)	Avis Budget Group Inc	Goldman Sachs International	(131.749)	(0,01)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(491.099)	Avnet Inc	Goldman Sachs International	(38.748)	(0,00)
(28.466)	B&M European Value Retail SA	Morgan Stanley	(954)	(0,00)
18	Bachem Holding AG	Morgan Stanley	(17)	(0,00)
(2.703.989)	Baidu Inc	Goldman Sachs International	(130.000)	(0,01)
(988.474)	Banco Santander SA	Goldman Sachs International	(6.212)	(0,00)
1.500	Bandai Namco Holdings Inc	Morgan Stanley	(793)	(0,00)
2.854.186	Bank of Communications Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	(113.383)	(0,01)
1.052.071	Bank of Communications Co Ltd	Goldman Sachs International	(27.547)	(0,00)
238.669	Bank of Communications Co Ltd - H Shares	Morgan Stanley	(8.392)	(0,00)
1.751.362	Bank of New York Mellon Corp	Goldman Sachs International	(91.325)	(0,01)
(1.069.430)	Barclays Plc	Goldman Sachs International	(133.281)	(0,01)
1.489	Barco NV	Morgan Stanley	(218)	(0,00)
(41.845)	Barratt Developments Plc	Goldman Sachs International	(6.113)	(0,00)
500	BASE Inc	Morgan Stanley	(50)	(0,00)
7.000.000	Basic-Fit NV	Morgan Stanley	(184.834)	(0,01)
(72)	Bavarian Nordic A/S	Morgan Stanley	(17)	(0,00)
421.159	Bayerische Motoren Werke AG	JPMorgan Chase Bank	(50.364)	(0,00)
2.073.826	Bayerische Motoren Werke AG	Goldman Sachs International	(113.369)	(0,00)
548.565	Bayerische Motoren Werke AG	Morgan Stanley	(149.256)	(0,01)
(521)	Beazley Plc	Morgan Stanley	(1)	(0,00)
(4)	Befesa SA	Morgan Stanley	(14)	(0,00)
1.072	Beiersdorf AG	Morgan Stanley	(936)	(0,00)
163.705	Beigene Ltd	Goldman Sachs International	(37.845)	(0,00)
967	Bekaert SA	Morgan Stanley	(162)	(0,00)
253	Belimo Holding AG	Morgan Stanley	(123)	(0,00)
2.953	Bellway Plc	Morgan Stanley	(1.368)	(0,00)
(5.800)	Benesse Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.324)	(0,00)
(1.312.511)	Berry Global Group Inc	Goldman Sachs International	(56.689)	(0,00)
6.360.797	Best Buy Co Inc	Goldman Sachs International	(287.771)	(0,01)
352.535	BHP Group Ltd	Morgan Stanley	(9.005)	(0,00)
(4.700)	Bic Camera Inc	Morgan Stanley	(290)	(0,00)
(1.244.091)	Bidvest Group Ltd	Goldman Sachs International	(33)	(0,00)
844	Big Yellow Group Plc	Morgan Stanley	(22)	(0,00)
(488.415)	Biogen Inc	Goldman Sachs International	(37.837)	(0,00)
(1.107.850)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs International	(1.011)	(0,00)
(10)	BioMerieux	Morgan Stanley	(3)	(0,00)
287.470	BioMerieux	Goldman Sachs International	(6.717)	(0,00)
218.562	Blackbaud Inc	Goldman Sachs International	(22.657)	(0,00)
803.469	BlackRock Inc	Goldman Sachs International	(11.071)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
360.989	Blackstone Group Inc Class A	Goldman Sachs International	(67.027)	(0,00)
2.011.034	Blackstone Mortgage Trust Inc Class A	Goldman Sachs International	(17.419)	(0,00)
(504.166)	Bluescape Opportunities Acquisition Class A	Morgan Stanley	(33.148)	(0,00)
(283.209)	Bluescape Opportunities Acquisition Class A	Goldman Sachs International	(45.718)	(0,00)
(1.059.860)	BNP Paribas SA	Morgan Stanley	(22.637)	(0,00)
(2.997.142)	BNP Paribas SA	Goldman Sachs International	(94.102)	(0,01)
9.021	Bodycote Plc	Morgan Stanley	(186)	(0,00)
3.058	Bollore SA	Morgan Stanley	(227)	(0,00)
7.661	boohoo Group Plc	Morgan Stanley	(452)	(0,00)
(7.536.785)	Booking Holdings Inc	Goldman Sachs International	(205.660)	(0,01)
5.000.000	Booking Holdings Inc	Morgan Stanley	(441.000)	(0,02)
10	Boskalis Westminster	Morgan Stanley	(4)	(0,00)
186.466	Box Inc Class A	Goldman Sachs International	(27.904)	(0,00)
582.545	BP Plc	Goldman Sachs International	(75.897)	(0,00)
198.929	Breville Group Ltd	Goldman Sachs International	(21.379)	(0,00)
66.782.093	Bridgestone Corp	Morgan Stanley	(5.225)	(0,00)
4.381	Britvic Plc	Morgan Stanley	(310)	(0,00)
1.811.746	Broadridge Financial Solutions Inc	Goldman Sachs International	(26.483)	(0,00)
11.900	Brother Industries Ltd	Morgan Stanley	(10.514)	(0,00)
(1.774.458)	Builders FirstSource Inc	Goldman Sachs International	(62.232)	(0,00)
1.762.363	Bunzl Plc	Goldman Sachs International	(75.774)	(0,00)
1.013.912	Bunzl Plc	Morgan Stanley	(54.000)	(0,00)
927	Bureau Veritas SA	Morgan Stanley	(451)	(0,00)
7.962	Burford Capital Ltd	Morgan Stanley	(1.110)	(0,00)
278.938	Buzzi Unicem SpA	Goldman Sachs International	(585.215)	(0,03)
380.627	Cable One Inc	Morgan Stanley	(9.383)	(0,00)
1.665.151	Cable One Inc	Goldman Sachs International	(118.568)	(0,01)
429.697	Cabot Oil & Gas Corp	Goldman Sachs International	(28.302)	(0,00)
17.600	Calbee Inc	Morgan Stanley	(6.052)	(0,00)
(6.283.198)	Cameco Corp	Goldman Sachs International	(193.880)	(0,02)
19.100	Canon Inc	Morgan Stanley	(18.184)	(0,00)
4.000	Canon Marketing Japan Inc	Morgan Stanley	(40)	(0,00)
1.920	Carl Zeiss Meditec AG	Morgan Stanley	(4.832)	(0,00)
(6.503.046)	Carnival Corp	Goldman Sachs International	(646.838)	(0,04)
(2.403.932)	Carrier Global Corp	Goldman Sachs International	(4.797)	(0,00)
(6.361)	Casino Guichard Perrachon SA	Morgan Stanley	(1.302)	(0,00)
300	Casio Computer Co Ltd	Morgan Stanley	(153)	(0,00)
(1.402)	CECONOMY AG	Morgan Stanley	(82)	(0,00)
29.933.312	Cellnex Telecom SA	Goldman Sachs International	(3.781.133)	(0,17)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
222	Cembra Money Bank AG	Morgan Stanley	(231)	(0,00)
68	Ceres Power Holdings Plc	Morgan Stanley	(24)	(0,00)
332.868	Cerner Corp	Goldman Sachs International	(6.173)	(0,00)
(23.190)	CF Acquisition Corp V	Morgan Stanley	(467)	(0,00)
2.819.318	Charter Communications Inc Class A	Goldman Sachs International	(261.326)	(0,00)
158.610	Charter Communications Inc Class A	Morgan Stanley	(25.825)	(0,00)
77.086	Check Point Software Tech	Goldman Sachs International	(1.433)	(0,00)
908.341	Chemours Co	Goldman Sachs International	(22.612)	(0,00)
736.627	Chemours Co	JPMorgan Chase Bank	(220.420)	(0,01)
(1.010.276)	Chewy Inc Class A	Goldman Sachs International	(17.900)	(0,00)
(5.824.484)	China Gas Holdings Ltd	Goldman Sachs International	(37.956)	(0,00)
(893.417)	China Life Insurance Co	Goldman Sachs International	(3.788)	(0,00)
(4.111.344)	China Life Insurance Co	Morgan Stanley	(67.699)	(0,00)
(84.320)	China MeiDong Auto Holdings Ltd	Goldman Sachs International	(209)	(0,00)
2.900.398	China Merchants Bank Co Ltd Class H	Morgan Stanley	(129.191)	(0,01)
(3.093.635)	China National Building Material Co Ltd	Morgan Stanley	(7.308)	(0,00)
949.474	China Oilfield Services Ltd	Morgan Stanley	(2.066)	(0,00)
1.975.378	China Overseas Property Holdings Ltd	Goldman Sachs International	(27.637)	(0,00)
(139.216)	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	Goldman Sachs International	(485)	(0,00)
(2.000)	Chiyoda Corp	Morgan Stanley	(314)	(0,00)
2	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	Morgan Stanley	(2)	(0,00)
1.004.651	Choice Hotels Intl Inc	Goldman Sachs International	(87.440)	(0,01)
2.854.321	Chr Hansen Holding A/S	JPMorgan Chase Bank	(13.705)	(0,00)
3.189.921	Chr Hansen Holding A/S	Goldman Sachs International	(10.012)	(0,00)
189	Christian Dior SE	Morgan Stanley	(3.029)	(0,00)
1.400	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	(54)	(0,00)
13.100	Chugoku Electric Power Co Inc	Morgan Stanley	(2.036)	(0,00)
(634.384)	Churchill Capital Corp V Class A	Morgan Stanley	(12.681)	(0,00)
1.816	CIE Automotive SA	Morgan Stanley	(1.116)	(0,00)
106.196	Cie de Saint-Gobain	Goldman Sachs International	(147.335)	(0,01)
9	Cie d'Entreprises CFE	Morgan Stanley	(15)	(0,00)
4.679	Cie Plastic Omnium SA	Morgan Stanley	(3.357)	(0,00)
1.400	Ciena Corp	Morgan Stanley	(702)	(0,00)
(2.014.193)	Ciena Corp	Goldman Sachs International	(9.475)	(0,00)
1.708.511	Cisco Systems Inc	Goldman Sachs International	(1.197)	(0,00)
(2.157.071)	Citic Securities Co Ltd	Goldman Sachs International	(11.243)	(0,00)
1.593.274	Citigroup Inc	Goldman Sachs International	(153.406)	(0,01)
(217.852)	Citizens Financial Group Inc	Goldman Sachs International	(905)	(0,00)
1.671.159	Citrix Systems Inc	Goldman Sachs International	(30.943)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
500	CKD Corp	Morgan Stanley	(135)	(0,00)
47.992	Clariant AG	Goldman Sachs International	(88.208)	(0,01)
5.574	Close Brothers Group Plc	Morgan Stanley	(857)	(0,00)
3.783.235	CLP Holdings Ltd	Morgan Stanley	(20.392)	(0,00)
700	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Morgan Stanley	(125)	(0,00)
4.670	Coca-Cola HBC AG	Morgan Stanley	(2.674)	(0,00)
(2.532.285)	Cognizant Technology Solutions Corp Class A	Goldman Sachs International	(44.890)	(0,00)
13.991	Coherus Biosciences Inc	Goldman Sachs International	(686)	(0,00)
2.373.541	Coloplast Class B	Goldman Sachs International	(21.822)	(0,00)
(218.212)	Comerica Inc	Goldman Sachs International	(18)	(0,00)
71.536	Commvault Systems Inc	Morgan Stanley	(16.129)	(0,00)
315.083	CommVault Systems Inc	Goldman Sachs International	(44.066)	(0,00)
49.106	Compass Group Plc	Morgan Stanley	(75.741)	(0,01)
5.500	COMSYS Holdings Corp	Morgan Stanley	(1.417)	(0,00)
(57.256)	Continental AG	Morgan Stanley	(31)	(0,00)
119.599	Continental AG	JPMorgan Chase Bank	(16.990)	(0,00)
2.289.230	Continental AG	Goldman Sachs International	(197.521)	(0,01)
3.600	Cosmos Pharmaceutical Corp	Morgan Stanley	(19.854)	(0,00)
(1.861.204)	Country Garden Holdings Co Ltd	Goldman Sachs International	(27.480)	(0,00)
(1.162.605)	Country Garden Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(17.835)	(0,00)
16.195	Countryside Properties Plc	Morgan Stanley	(2.013)	(0,00)
(460.538)	Coupang Inc	Goldman Sachs International	(10.048)	(0,00)
111.052	Covestro AG	Morgan Stanley	(384)	(0,00)
1.375	Covivio	Morgan Stanley	(2.281)	(0,00)
577	Cranswick Plc	Morgan Stanley	(155)	(0,00)
(5.200)	Create Restaurants Holdings Inc	Morgan Stanley	(577)	(0,00)
(1.100)	Create SD Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(80)	(0,00)
(720.750)	Credit Agricole SA	Goldman Sachs International	(11.975)	(0,00)
1.166.334	Credit Suisse Group AG	Goldman Sachs International	(412.933)	(0,02)
99.895	CRH Plc	Goldman Sachs International	(153.719)	(0,01)
109.304	Crispr Therapeutics AG	Goldman Sachs International	(42.737)	(0,00)
1.018.779	Crown Castle International Corp	Goldman Sachs International	(61.388)	(0,00)
1.133.070	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	Goldman Sachs International	(14.964)	(0,00)
1.335.821	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	Morgan Stanley	(33.688)	(0,00)
2.972	CTS Eventim AG & Co KGaA	Morgan Stanley	(7.578)	(0,00)
(84)	CVS Group Plc	Morgan Stanley	(16)	(0,00)
214.445	CyberArk Software Ltd	Goldman Sachs International	(19.792)	(0,00)
(200)	Cybozu Inc	Morgan Stanley	(20)	(0,00)
(1.040.545)	Cytokinetics Inc	JPMorgan Chase Bank	(40.804)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(505.893)	Cytokinetics Inc	Goldman Sachs International	(58.842)	(0,00)
(1.150.410)	Dada Nexus Ltd	Goldman Sachs International	(110.371)	(0,01)
182	Daetwyler Holding AG	Morgan Stanley	(269)	(0,00)
1.700	Dai Nippon Printing Co Ltd	Morgan Stanley	(146)	(0,00)
48.893.702	Daicel Corp	Morgan Stanley	(11.905)	(0,00)
(43.705.835)	Daido Steel Co Ltd	Goldman Sachs International	(8.033)	(0,00)
(3.500)	Daifuku Co Ltd	Morgan Stanley	(4.697)	(0,00)
15.600	Daichi Sankyo Co Ltd	Morgan Stanley	(10.839)	(0,00)
400	Daikin Industries Ltd	Morgan Stanley	(780)	(0,00)
(4.440.749)	Daimler AG	Goldman Sachs International	(117.966)	(0,01)
(300)	Daio Paper Corp	Morgan Stanley	(31)	(0,00)
(2.300)	Daiwa House Industry Co Ltd	Morgan Stanley	(479)	(0,00)
19.800	Daiwa Securities Group Inc	Morgan Stanley	(1.888)	(0,00)
(1.100)	Daiwabo Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(715)	(0,00)
4.009.411	Danaher Corp	Goldman Sachs International	(142.423)	(0,01)
2.067.754	Danone SA	Morgan Stanley	(15.994)	(0,00)
(1.136.865)	Darling Ingredients Inc	Goldman Sachs International	(26.648)	(0,00)
(3.278)	Dassault Aviation SA	Morgan Stanley	(198.631)	(0,01)
492.909	Dassault Systemes SA	Goldman Sachs International	(52.572)	(0,00)
507	Dassault Systemes SE	Morgan Stanley	(976)	(0,00)
521.807	Dcp Midstream LP	Goldman Sachs International	(215.455)	(0,01)
(498.063)	Decarbonization Plus Acquisition Corp	Goldman Sachs International	(48.650)	(0,00)
(445.771)	Decarbonization Plus Acquisition Corp	JPMorgan Chase Bank	(41.909)	(0,00)
(919)	Dechra Pharmaceuticals Plc	Morgan Stanley	(32)	(0,00)
689	Demant A/S	Morgan Stanley	(348)	(0,00)
22.280.326	Denka Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	(8.937)	(0,00)
(700)	Denka Co Ltd	Morgan Stanley	(8)	(0,00)
(418.784)	Denny's Corp	Goldman Sachs International	(6.781)	(0,00)
400	Denso Corp	Morgan Stanley	(653)	(0,00)
(500)	Dentsu Group Inc	Morgan Stanley	(42)	(0,00)
(340)	Derichebourg SA	Morgan Stanley	(20)	(0,00)
78	Dermapharm Holding SE	Morgan Stanley	(76)	(0,00)
3.193	Derwent London Plc	Morgan Stanley	(1.878)	(0,00)
(500)	Descente Ltd	Morgan Stanley	(1.484)	(0,00)
105	Deutsche Boerse AG	Morgan Stanley	(279)	(0,00)
1.616.653	Deutsche Post AG	Goldman Sachs International	(830.688)	(0,04)
322	Deutsche Post AG	Morgan Stanley	(333)	(0,00)
18.828.885	Deutsche Wohnen SE	Goldman Sachs International	(666.800)	(0,03)
(3.470.414)	Devon Energy Corp	Goldman Sachs International	(165.391)	(0,01)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(700)	Dexerials Corp	Morgan Stanley	(413)	(0,00)
4.275	Diageo Plc	Morgan Stanley	(1.800)	(0,00)
350.199	Diamondback Energy Inc	Goldman Sachs International	(29.721)	(0,00)
(184.851)	Diamondhead Holdings Corp Class A	Morgan Stanley	(5.956)	(0,00)
856.377	Diasorin SpA	Goldman Sachs International	(91.537)	(0,01)
458	DIC Asset AG	Morgan Stanley	(25)	(0,00)
(69.596.009)	DIC Corp	Goldman Sachs International	(10.617)	(0,00)
(383.059)	Digimarc Corp	Morgan Stanley	(106.874)	(0,01)
(300)	Digital Garage Inc	Morgan Stanley	(234)	(0,00)
(438.132)	Digital Realty Trust Inc	Goldman Sachs International	(513)	(0,00)
(768.576)	Dine Brands Global Inc	Goldman Sachs International	(27.982)	(0,00)
3.881	Diploma Plc	Morgan Stanley	(2.011)	(0,00)
(3.405.581)	Disco Corp	Goldman Sachs International	(96)	(0,00)
1.073.691	Discovery Communications Inc	Morgan Stanley	(52.339)	(0,00)
(6.209)	Dixons Carphone Plc	Morgan Stanley	(268)	(0,00)
5.400	DMG Mori Co Ltd	Morgan Stanley	(601)	(0,00)
2.778	DNB ASA	Morgan Stanley	(1.895)	(0,00)
22.240.787	DNB ASA	Goldman Sachs International	(88.047)	(0,01)
(3.035)	Domino's Pizza Group Plc	Morgan Stanley	(1)	(0,00)
98.705	Domino's Pizza Inc	Goldman Sachs International	(20.925)	(0,00)
166.413	Domino's Pizza Inc	Morgan Stanley	(35.144)	(0,00)
1.704.405	Doordash Inc Class A	Morgan Stanley	(502.526)	(0,03)
1.513	dormakaba Holding AG	Goldman Sachs International	(9.346)	(0,00)
(556.100)	Douzone Bizon Co Ltd	Goldman Sachs International	(15.630)	(0,00)
(4.432.802)	Dover Corp	Goldman Sachs International	(3.744)	(0,00)
(98.017.786)	Dowa Holdings Co Ltd	Goldman Sachs International	(16.126)	(0,00)
(244.162)	Drax Group Plc	Goldman Sachs International	(19.778)	(0,00)
217.541	Dropbox Inc-Class A	Goldman Sachs International	(8.615)	(0,00)
166.642	DS Smith Plc	Goldman Sachs International	(24.993)	(0,00)
4.000.000	Dufry One BV	Morgan Stanley	(250.832)	(0,01)
624	DWS Group GmbH & Co KGaA	Morgan Stanley	(251)	(0,00)
(851.766)	Dycom Industries Inc	Goldman Sachs International	(115.436)	(0,01)
1.151.473	Dynatrace Inc	Goldman Sachs International	(72.951)	(0,00)
(145.366)	easyJet Plc	Goldman Sachs International	(20.935)	(0,00)
5.632.907	eBay Inc	Goldman Sachs International	(767.566)	(0,04)
(2.456.745)	ECP Environmental Growth Opportunities Corp	Goldman Sachs International	(292.583)	(0,01)
(3.200)	EDION Corp	Morgan Stanley	(734)	(0,00)
615.653	Edison International	Goldman Sachs International	(16.697)	(0,00)
36.342	Editas Medicine Inc	Goldman Sachs International	(24.306)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(2.700)	Eiken Chemical Co Ltd	Morgan Stanley	(24)	(0,00)
(56.156.211)	Eisai Co Ltd	Morgan Stanley	(41.011)	(0,00)
(3.000)	Elecom Co Ltd	Morgan Stanley	(1.117)	(0,00)
(16.000)	Electric Power Development Co Ltd	Morgan Stanley	(520)	(0,00)
6.019	Electricité de France SA	Morgan Stanley	(711)	(0,00)
1.424	Electrocomponents Plc	Morgan Stanley	(109)	(0,00)
5.412.592	Electrolux AB	Goldman Sachs International	(4.957)	(0,00)
902.620	Electronic Arts Inc	Goldman Sachs International	(30.917)	(0,00)
421.143	Electronic Arts Inc	JPMorgan Chase Bank	(25.058)	(0,00)
668.608	Electronic Arts Inc	Morgan Stanley	(48.827)	(0,00)
1.111	Elia Group SA	Morgan Stanley	(494)	(0,00)
(6.616)	Elior Group SA	Morgan Stanley	(61)	(0,00)
15.000.000	ELM BV for Swiss Re Ltd	Morgan Stanley	(153.954)	(0,01)
53.851	E-Mart Inc	Goldman Sachs International	(1.169)	(0,00)
(8.416.253)	Emerson Electric Co	Goldman Sachs International	(68.753)	(0,00)
80	Emmi AG	Morgan Stanley	(167)	(0,00)
348	EMS-Chemie Holding AG	Morgan Stanley	(1.265)	(0,00)
3.563.938	Enagas Sa	Goldman Sachs International	(159.266)	(0,01)
1.848.726	Enbridge Inc	Goldman Sachs International	(43.271)	(0,00)
(1.473.711)	Endeavor Group Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	(124.001)	(0,01)
(1.130.230)	Endesa SA	Goldman Sachs International	(175.821)	(0,01)
4.092	Endesa SA	Morgan Stanley	(4.499)	(0,00)
102.500	ENEOS Holdings Inc	Morgan Stanley	(5.981)	(0,00)
21	Energean Plc	Morgan Stanley	(6)	(0,00)
(650.844)	Energy Transfer LP	Goldman Sachs International	(7.752)	(0,00)
3.587.936	Enn Energy Holdings Ltd	Morgan Stanley	(186.368)	(0,01)
1.720.865	Enterprise Products Partners LP	Goldman Sachs International	(29.706)	(0,00)
1.080.860	Eog Resources Inc	Goldman Sachs International	(109.821)	(0,01)
574.606	EQT Corp	Goldman Sachs International	(16.954)	(0,00)
290.878	Equitrans Midstream Corp	Goldman Sachs International	(117)	(0,00)
(1.333)	Eramet SA	Morgan Stanley	(428)	(0,00)
(12.742)	Erste Group Bank AG	Goldman Sachs International	(1.405)	(0,00)
(101.255)	Essa Pharma Inc	Goldman Sachs International	(4.650)	(0,00)
983	EssilorLuxottica SA	Morgan Stanley	(1.047)	(0,00)
16.513.354	Essity Aktiebolag Class B	Goldman Sachs International	(35.404)	(0,00)
1.359.297	Etsy Inc	Morgan Stanley	(153.036)	(0,01)
1.667.706	Etsy Inc	Goldman Sachs International	(199.001)	(0,02)
(400)	euglena Co Ltd	Morgan Stanley	(76)	(0,00)
927	Eurazeo SE	Morgan Stanley	(199)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(18.209)	Euronav NV	Morgan Stanley	(681)	(0,00)
1.242	Euskaltel SA	Morgan Stanley	(69)	(0,00)
355	Evolution AB	Morgan Stanley	(774)	(0,00)
2.694	Evotec SE	Morgan Stanley	(1.063)	(0,00)
13.767	Evraz Plc	Morgan Stanley	(1.867)	(0,00)
(138.932)	Evraz Plc	Goldman Sachs International	(25.904)	(0,00)
(2.514.379)	Expedia Group Inc	Goldman Sachs International	(352.127)	(0,01)
2.757	Experian Plc	Morgan Stanley	(1.107)	(0,00)
(812.626)	Exxon Mobil Corp	Morgan Stanley	(2.172)	(0,00)
1.867.160	Facebook Inc Class A	Goldman Sachs International	(79.616)	(0,01)
1.875	Fagron	Morgan Stanley	(835)	(0,00)
24.180.946	Fast Retailing Co Ltd	Goldman Sachs International	(8.179)	(0,00)
4.997.245	Fastenal Co	Goldman Sachs International	(43.136)	(0,00)
(1.536.445)	Faurecia SE	Goldman Sachs International	(303.599)	(0,01)
(1.019.961)	Faurecia SE	JPMorgan Chase Bank	(162.921)	(0,01)
(2.300)	FCC Co Ltd	Morgan Stanley	(186)	(0,00)
307.453	Ferrari NV	JPMorgan Chase Bank	(29.444)	(0,00)
1.050.467	Ferrari NV	Goldman Sachs International	(10.656)	(0,00)
10.127	Ferrexpo Plc	Morgan Stanley	(1.161)	(0,00)
1.476	Ferrovial SA	Morgan Stanley	(964)	(0,00)
4.603	Fevertree Drinks Plc	Morgan Stanley	(2.981)	(0,00)
(13.732.601)	Fidelity National Information Services Inc	Goldman Sachs International	(393.188)	(0,01)
(43)	Fielmann AG	Morgan Stanley	(68)	(0,00)
179.671	Fila Holdings Corp	JPMorgan Chase Bank	(11.394)	(0,00)
238.224	First Republic Bank	Morgan Stanley	(4.728)	(0,00)
6.105.228	FirstRand Ltd	Goldman Sachs International	(11.056)	(0,00)
892.324	Flowserve Corp	JPMorgan Chase Bank	(49.548)	(0,00)
18.598	FLSmidth & Co A/S	Morgan Stanley	(4.547)	(0,00)
177	Flughafen Zurich AG	Morgan Stanley	(678)	(0,00)
(277)	Fnac Darty SA	Morgan Stanley	(39)	(0,00)
(75.391.127)	Food & Life Cos Ltd	Goldman Sachs International	(22.726)	(0,00)
1.806.338	Fortinet Inc	Goldman Sachs International	(89.522)	(0,00)
8.571	Fortinet Inc	Morgan Stanley	(4.949)	(0,00)
(540.021)	Fortistar Sustainable Solu Class A	Morgan Stanley	(21.957)	(0,00)
1.171	Fortum Oyj	Morgan Stanley	(399)	(0,00)
1.000	FP Corp	Morgan Stanley	(183)	(0,00)
(100)	Freee KK	Morgan Stanley	(215)	(0,00)
(157.632)	Freeport-McMoRan Inc	Goldman Sachs International	(16.948)	(0,00)
8.400	Fuji Oil Holdings Inc	Morgan Stanley	(6.955)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(1.300)	Fujikura Ltd	Morgan Stanley	(303)	(0,00)
(8.400)	Fukuoka Financial Group Inc	Morgan Stanley	(452)	(0,00)
(134.435.166)	Furukawa Electric Co Ltd	Goldman Sachs International	(49.911)	(0,00)
446	Galapagos NV	Morgan Stanley	(527)	(0,00)
(3.783.018)	Galaxy Entertainment Group Ltd	Goldman Sachs International	(46.179)	(0,00)
4.651.694	Galaxy Entertainment Group Ltd	Morgan Stanley	(38.818)	(0,00)
(72)	Galenica AG	Morgan Stanley	(25)	(0,00)
34	Games Workshop Group Plc	Morgan Stanley	(43)	(0,00)
1.792.520	Gartner Inc	Goldman Sachs International	(57.966)	(0,00)
1.333	Gaztransport Et Technigaz SA	Morgan Stanley	(1.325)	(0,00)
38	GB Group Plc	Morgan Stanley	(5)	(0,00)
(4.591.714)	GCL-Poly Energy Holdings Ltd	Morgan Stanley	(509.351)	(0,02)
674.870	Geberit AG	Goldman Sachs International	(27.860)	(0,00)
(13.540)	Geberit AG	Morgan Stanley	(321.293)	(0,02)
542	Gecina SA	Morgan Stanley	(1.318)	(0,00)
(14.210.982)	General Electric Co	Goldman Sachs International	(518.738)	(0,03)
288	Genmab A/S	Morgan Stanley	(1.543)	(0,00)
2.060	Getlink SE	Morgan Stanley	(814)	(0,00)
590.884	Gibson Energy Inc	Goldman Sachs International	(13.578)	(0,00)
377.979	Gildan Activewear Inc	Goldman Sachs International	(22.493)	(0,00)
261	Gimv NV	Morgan Stanley	(168)	(0,00)
(1.541)	Givaudan SA	Morgan Stanley	(173.988)	(0,01)
809.935	GlaxoSmithKline Plc	JPMorgan Chase Bank	(83.814)	(0,01)
177.978	GlaxoSmithKline Plc	Goldman Sachs International	(16.945)	(0,00)
(164.718)	Glencore Plc	Goldman Sachs International	(8.042)	(0,00)
(11.615.442)	Global Payments Inc	Goldman Sachs International	(509.223)	(0,03)
600	GMO internet Inc	Morgan Stanley	(268)	(0,00)
1.944.417	GN Store Nord AS	Goldman Sachs International	(32.091)	(0,00)
(1.104.078)	GoDaddy Inc Class A	Goldman Sachs International	(15.050)	(0,00)
(58.584.930)	Goldwin Inc	Goldman Sachs International	(10.179)	(0,00)
(3.256.173)	Goodyear Tire & Rubber Co	Goldman Sachs International	(380.181)	(0,02)
(31.018)	Goodyear Tire & Rubber Co	Morgan Stanley	(5.496)	(0,00)
(577)	GrandVision NV	Morgan Stanley	(973)	(0,00)
(5.894.105)	Graphic Packaging Holding Co	Goldman Sachs International	(171.059)	(0,01)
7.025	Great Portland Estates Plc	Morgan Stanley	(607)	(0,00)
(867.152)	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai	Goldman Sachs International	(114.135)	(0,01)
1.775	Green Plains Inc	Goldman Sachs International	(1.487)	(0,00)
26.471	Greentown Service Group Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	(9)	(0,00)
(126)	Greggs Plc	Morgan Stanley	(12)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(2.820.850)	Grifols SA	Goldman Sachs International	(65.988)	(0,00)
1.079	Groupe Bruxelles Lambert SA	Morgan Stanley	(1.223)	(0,00)
1.212.894	Guidewire Software Inc	Goldman Sachs International	(38.370)	(0,00)
(5.367)	H Lundbeck A/S	Morgan Stanley	(707)	(0,00)
8.600	H.U. Group Holdings Inc	Morgan Stanley	(2.528)	(0,00)
1.096	Halma Plc	Morgan Stanley	(383)	(0,00)
574.909	Hannon Armstrong Sustainable	Goldman Sachs International	(14.314)	(0,00)
1.340	Hannover Rueckversicheru SE	Morgan Stanley	(3.515)	(0,00)
153.119	Hargreaves Lansdown Plc	Goldman Sachs International	(940)	(0,00)
9.722	Hargreaves Lansdown Plc	Morgan Stanley	(1.744)	(0,00)
685.918	Harley-Davidson Inc	Goldman Sachs International	(62.038)	(0,00)
(6.900)	Haseko Corp	Morgan Stanley	(1.857)	(0,00)
180.172	Hays Plc	Goldman Sachs International	(54.880)	(0,00)
26.400	Healthcare Trust of America Inc Class A	Morgan Stanley	(79)	(0,00)
(216.930)	Healthpeak Properties Inc	Goldman Sachs International	(3.525)	(0,00)
1.194	Heineken Holding NV	Morgan Stanley	(1.126)	(0,00)
1.150	Heineken NV	Morgan Stanley	(1.528)	(0,00)
(4.000)	Heiwa Corp	Morgan Stanley	(661)	(0,00)
1.678	Hella GmbH & Co KGaA	Morgan Stanley	(581)	(0,00)
2.902.604	HelloFresh SE	Morgan Stanley	(59.433)	(0,00)
92	Helvetia Holding AG	Morgan Stanley	(20)	(0,00)
(1.254.401)	Henkel AG & Co KGaA	Goldman Sachs International	(113.708)	(0,01)
(1.686.256)	Hennessy Capital LLC	Morgan Stanley	(3.694)	(0,00)
289	Hermes International	Morgan Stanley	(1.231)	(0,00)
7.017.474	Hexagon AK	Goldman Sachs International	(60.034)	(0,00)
950.091	Hexcel Corp	Goldman Sachs International	(104.516)	(0,01)
1.017.705	Hexcel Corp	JPMorgan Chase Bank	(219.383)	(0,01)
1.400	Hikari Tsushin Inc	Morgan Stanley	(2.026)	(0,00)
141	Hikma Pharmaceuticals Plc	Morgan Stanley	(2)	(0,00)
(800)	Hirose Electric Co Ltd	Morgan Stanley	(259)	(0,00)
9.600	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	Morgan Stanley	(454)	(0,00)
(200)	Hitachi Transport System Ltd	Morgan Stanley	(278)	(0,00)
(800)	Hitachi Zosen Corp	Morgan Stanley	(4)	(0,00)
(46)	HOCHTIEF AG	Morgan Stanley	(3)	(0,00)
101.309	Holcim Ltd	Goldman Sachs International	(139.211)	(0,01)
64.277.357	Honda Motor Co Ltd	Morgan Stanley	(49.145)	(0,00)
77.592.292	Honda Motor Co Ltd	Goldman Sachs International	(7.574)	(0,00)
(8.757.797)	Honeywell International Inc	Goldman Sachs International	(336.255)	(0,02)
(6.900)	House Foods Group Inc	Morgan Stanley	(3.233)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(283.718)	Howden Joinery Group Plc	Goldman Sachs International	(5.338)	(0,00)
(313.152)	Howden Joinery Group Plc	Morgan Stanley	(7.910)	(0,00)
647.772	HP Inc	Goldman Sachs International	(21.554)	(0,00)
(384.131)	HSBC Holdings Plc	Morgan Stanley	(15.784)	(0,00)
(4.360.167)	HSBC Holdings Plc	Goldman Sachs International	(396.323)	(0,02)
(323.894)	Huatai Securities Co Ltd	Morgan Stanley	(192)	(0,00)
(1.327.763)	Huatai Securities Co Ltd	Goldman Sachs International	(2.236)	(0,00)
779.653	Huntington Bancshares Inc	Goldman Sachs International	(32.670)	(0,00)
(344.488)	Hybe Co Ltd	Goldman Sachs International	(371)	(0,00)
4	Hypoport SE	Morgan Stanley	(16)	(0,00)
662.348	Hyundai Mobis Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	(27.546)	(0,00)
(319.698)	Hyundai Motor Co Ltd	Morgan Stanley	(15.013)	(0,00)
(623.919)	Hyundai Mtr Co New Prf	Morgan Stanley	(4.066)	(0,00)
(3.186.522)	IAC Interactivecorp	Goldman Sachs International	(72.323)	(0,00)
5.967	Iberdrola SA	Morgan Stanley	(660)	(0,00)
1.481	ICADE	Morgan Stanley	(2.603)	(0,00)
(17)	ID Logistics Group	Morgan Stanley	(4)	(0,00)
40.094.928	Idemitsu Kosan Co Ltd	Goldman Sachs International	(13.299)	(0,00)
177	Idorsia Ltd	Morgan Stanley	(19)	(0,00)
7.018	IG Group Holdings Plc	Morgan Stanley	(499)	(0,00)
7.200	IHI Corp	Morgan Stanley	(2.809)	(0,00)
12.300	Iida Group Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(9.349)	(0,00)
2.322.775	Illinois Tool Works Inc	JPMorgan Chase Bank	(226.873)	(0,01)
1.765	Imerys SA	Morgan Stanley	(1.498)	(0,00)
125.915	IMI Plc	Goldman Sachs International	(33.947)	(0,00)
(4.779.938)	Impala Platinum Holdings Ltd	Goldman Sachs International	(13.029)	(0,00)
100.247	Incyte Corp	Goldman Sachs International	(1.670)	(0,00)
(4.200)	Independent Bank Corp	Morgan Stanley	(9.510)	(0,00)
6.570	Industria de Diseno Textil SA	Morgan Stanley	(3.849)	(0,00)
(2.630.486)	Industrial & Commercial Bank of China Ltd - H Shares	Morgan Stanley	(22.417)	(0,00)
(254.636)	Industrial & Commercial Bank of China Ltd - H Shares	Goldman Sachs International	(4.367)	(0,00)
49.063	Infineon Technologies AG	Morgan Stanley	(26)	(0,00)
(300)	Infocom Corp	Morgan Stanley	(213)	(0,00)
(400)	Information Services International-Dentsu Ltd	Morgan Stanley	(1.456)	(0,00)
3.194.209	ING Groep NV	Goldman Sachs International	(111.679)	(0,01)
2.448	Inmobiliaria Colonial Socimi SA	Morgan Stanley	(447)	(0,00)
(245.905)	Innolux Corp	Goldman Sachs International	(76.660)	(0,01)
(35.023)	Innolux Corp	Morgan Stanley	(1.838)	(0,00)
34.100	Inpex Corp	Morgan Stanley	(2.879)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(700)	Insource Co Ltd	Morgan Stanley	(791)	(0,00)
52.687	Instil Bio Inc	Goldman Sachs International	(2.767)	(0,00)
256	IntegraFin Holdings Plc	Morgan Stanley	(12)	(0,00)
1.224.050	Intel Corp	Goldman Sachs International	(6.620)	(0,00)
1.773	InterContinental Hotels Group Plc	Morgan Stanley	(1.006)	(0,00)
5.878	Intermediate Capital Group Plc	Morgan Stanley	(3.187)	(0,00)
2.290.164	International Business Machines Corp	Goldman Sachs International	(46.119)	(0,00)
1.996.031	International Consolidated Airlines Group SA	Goldman Sachs International	(738.209)	(0,03)
1.033.079	International Paper Co	JPMorgan Chase Bank	(201.708)	(0,01)
5.361.616	International Paper Co	Goldman Sachs International	(30.038)	(0,00)
(100)	Internet Initiative Japan Inc	Morgan Stanley	(166)	(0,00)
64	Interparfums SA	Morgan Stanley	(10)	(0,00)
(3.448.675)	Interpublic Group of Cos Inc	Goldman Sachs International	(156.049)	(0,01)
2	Interroll Holding AG	Morgan Stanley	(12)	(0,00)
989	Intertek Group Plc	Morgan Stanley	(527)	(0,00)
367.265	Intl Business Machines Corp	Morgan Stanley	(63.681)	(0,00)
2.824	IP Group Plc	Morgan Stanley	(52)	(0,00)
447	Ipsen SA	Morgan Stanley	(12)	(0,00)
(1.300)	Iriso Electronics Co Ltd	Morgan Stanley	(1.624)	(0,00)
(866.824)	Iron Mountain Inc	Goldman Sachs International	(13.814)	(0,00)
(38.334)	iSignthis Ltd	Morgan Stanley	(29.326)	(0,00)
(40.048)	ISS A/S	Morgan Stanley	(3.159)	(0,00)
332.460	ISS A/S	Goldman Sachs International	(6.108)	(0,00)
15.300	Isuzu Motors Ltd	Morgan Stanley	(5.422)	(0,00)
16.300	ITOCHU Corp	Morgan Stanley	(13.476)	(0,00)
(1.900)	Iwatani Corp	Morgan Stanley	(1.840)	(0,00)
100	Izumi Co Ltd	Morgan Stanley	(8)	(0,00)
25.000	J Front Retailing Co Ltd	Morgan Stanley	(24.554)	(0,00)
(74.167)	J Sainsbury Plc	Morgan Stanley	(115)	(0,00)
6.722.818	J2 Global Inc	Goldman Sachs International	(1.137.820)	(0,05)
(4.100)	Jaccs Co Ltd	Morgan Stanley	(157)	(0,00)
(500)	Japan Elevator Service Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(208)	(0,00)
(2.000)	Japan Petroleum Exploration Co Ltd	Morgan Stanley	(44)	(0,00)
(51.500)	Japan Post Bank Co Ltd	Morgan Stanley	(238)	(0,00)
39.500	Japan Post Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(2.199)	(0,00)
(28.002.700)	Japan Post Insurance Co Ltd	Goldman Sachs International	(15.536)	(0,00)
(46.623.751)	Japan Post Insurance Co Ltd	Morgan Stanley	(46.429)	(0,00)
(448.632)	Jaws Mustang Acquisition Corp	Morgan Stanley	(11.964)	(0,00)
1.944	JCDecaux SA	Morgan Stanley	(527)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(300)	JCR Pharmaceuticals Co Ltd	Morgan Stanley	(611)	(0,00)
2.954.936	JD Health International Inc	Goldman Sachs International	(17.186)	(0,00)
1.541.918	JD Health International Inc	JPMorgan Chase Bank	(17.338)	(0,00)
6.718	JD Sports Fashion Plc	Morgan Stanley	(1.181)	(0,00)
(100)	Jeol Ltd	Morgan Stanley	(104)	(0,00)
(829.552)	Jeronimo Martins SGPS SA	Goldman Sachs International	(50)	(0,00)
12.000	JFE Holdings Inc	Morgan Stanley	(914)	(0,00)
11.700	JGC Holdings Corp	Morgan Stanley	(2.189)	(0,00)
(400)	JINS Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.132)	(0,00)
1.156.495	JM Smucker Co	Goldman Sachs International	(64.406)	(0,00)
(38.720)	John Wood Group Plc	Morgan Stanley	(1.360)	(0,00)
45.609	Johnson Matthey Plc	Goldman Sachs International	(108.047)	(0,01)
(1.700)	Joyful Honda Co Ltd	Morgan Stanley	(71)	(0,00)
6.700.000	JPMorgan Chase Bank NA	Morgan Stanley	(498.815)	(0,02)
(10.000)	JSR Corp	Morgan Stanley	(5.071)	(0,00)
66.639.889	JSR Corp	JPMorgan Chase Bank	(32.104)	(0,00)
68.444.165	JSR Corp	Goldman Sachs International	(27.953)	(0,00)
41.000	JTEKT Corp	Morgan Stanley	(16.612)	(0,00)
457	Julius Baer Group Ltd	Morgan Stanley	(327)	(0,00)
(1.186.671)	Juniper Networks Inc	Goldman Sachs International	(22.027)	(0,00)
12.623.890	Just Eat Takeaway.com NV	Goldman Sachs International	(369.343)	(0,02)
(900)	Justsystems Corp	Morgan Stanley	(1.352)	(0,00)
(11.729)	K+S AG	Morgan Stanley	(836)	(0,00)
94	Kainos Group Plc	Morgan Stanley	(6)	(0,00)
3.700	Kajima Corp	Morgan Stanley	(960)	(0,00)
(2.500)	Kakaku.com Inc	Morgan Stanley	(2.619)	(0,00)
(10.100)	Kamigumi Co Ltd	Morgan Stanley	(4.959)	(0,00)
(2.000)	Kaneka Corp	Morgan Stanley	(1.060)	(0,00)
60.043.171	Kaneka Corp	JPMorgan Chase Bank	(228.942)	(0,01)
15.632.493	Kansai Paint Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	(1.942)	(0,00)
8.700	Kawasaki Heavy Industries Ltd	Morgan Stanley	(2.679)	(0,00)
984	KBC Ancora	Morgan Stanley	(635)	(0,00)
(838.310)	KE Holdings Inc	Goldman Sachs International	(14.734)	(0,00)
335	Kering SA	Morgan Stanley	(6.002)	(0,00)
(1.700)	Kewpie Corp	Morgan Stanley	(94)	(0,00)
65.349.517	Kikkoman Corp	Goldman Sachs International	(71.542)	(0,00)
514.513	Kingfisher Plc	Goldman Sachs International	(38.340)	(0,00)
35.279	Kingspan Group Plc	Goldman Sachs International	(17.598)	(0,00)
393	KION Group AG	Morgan Stanley	(939)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
6.600	Kirin Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(5.499)	(0,00)
229.047	KLA Corp	Morgan Stanley	(56.025)	(0,00)
18.612	KLA Corp	Goldman Sachs International	(457)	(0,00)
(5.643)	Knorr-Bremse AG	Morgan Stanley	(305)	(0,00)
44.863.565	Kobe Steel Ltd	JPMorgan Chase Bank	(130.798)	(0,01)
17.100	Kobe Steel Ltd	Morgan Stanley	(144)	(0,00)
97.220	Kodiak Sciences Inc	Goldman Sachs International	(10.512)	(0,00)
200	Koito Manufacturing Co Ltd	Morgan Stanley	(43)	(0,00)
(100.619.310)	Komatsu Ltd	Morgan Stanley	(154.300)	(0,01)
1.400	Konami Holdings Corp	Morgan Stanley	(3.949)	(0,00)
3.593.610	Kone Oyj Class B	Goldman Sachs International	(113.684)	(0,00)
109.000	Konica Minolta Inc	Morgan Stanley	(19.755)	(0,00)
(10.620)	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Morgan Stanley	(1.265)	(0,00)
23.142	Koninklijke DSM NV	Morgan Stanley	(721)	(0,00)
(55.851)	Koninklijke KPN NV	Morgan Stanley	(354)	(0,00)
(79.729)	Koninklijke KPN NV	Goldman Sachs International	(14.374)	(0,00)
246.079	Koninklijke Vopak NV	JPMorgan Chase Bank	(3.349)	(0,00)
(1.257)	Korian SA	Morgan Stanley	(617)	(0,00)
602.558.340	KOSDAQ 150 Index	Morgan Stanley	(15.489)	(0,00)
1.513.751.035	KOSPI 200 Index	Morgan Stanley	(20.437)	(0,00)
1.949.774.607	KOSPI 200 Index	Morgan Stanley	(22.245)	(0,00)
890.720	Kroger Co	Goldman Sachs International	(60.835)	(0,00)
29.800	K's Holdings Corp	Morgan Stanley	(2.290)	(0,00)
2.100	Kubota Corp	Morgan Stanley	(1.014)	(0,00)
1.331.155	Kuehne + Nagel International AG	Goldman Sachs International	(193.640)	(0,01)
345	Kuehne + Nagel International AG	Morgan Stanley	(708)	(0,00)
(1.400)	Kumagai Gumi Co Ltd	Morgan Stanley	(12)	(0,00)
(700)	Kureha Corp	Morgan Stanley	(920)	(0,00)
(8.800)	Kurita Water Industries Ltd	Morgan Stanley	(2.796)	(0,00)
(2.422.872)	KWG Group Holdings Ltd	Goldman Sachs International	(42.065)	(0,00)
3.900	Kyocera Corp	Morgan Stanley	(2.108)	(0,00)
(8.000)	Kyowa Kirin Co Ltd	Morgan Stanley	(5.757)	(0,00)
(4.700)	Kyudenko Corp	Morgan Stanley	(3.167)	(0,00)
37.876	L3Harris Technologies Inc	Morgan Stanley	(486)	(0,00)
2.091	Lagardere SCA	Morgan Stanley	(635)	(0,00)
3.261.188	Lam Research Corp	Goldman Sachs International	(107.507)	(0,00)
1.130.130	Lamar Advertising Co Class A	Goldman Sachs International	(20.935)	(0,00)
9.174	Lancashire Holdings Ltd	Morgan Stanley	(1.299)	(0,00)
896	LANXESS AG	Morgan Stanley	(387)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
210.456	Largan Precision Co Ltd	Morgan Stanley	(10.066)	(0,00)
432.000	Largan Precision Co Ltd	Goldman Sachs International	(9.043)	(0,00)
277	Learning Technologies Group Plc	Morgan Stanley	(5)	(0,00)
259	LEG Immobilien SE	Morgan Stanley	(420)	(0,00)
1.687.878	Leggett & Platt Inc	JPMorgan Chase Bank	(348.891)	(0,02)
(98.718)	Legrand SA	Morgan Stanley	(92.813)	(0,01)
6.277.275	Lennar Corp Class A	Goldman Sachs International	(71.414)	(0,00)
1.565.296	Lennox International Inc	Goldman Sachs International	(56.027)	(0,00)
563.409	Lennox International Inc	JPMorgan Chase Bank	(151.232)	(0,01)
(1.996.375)	LG Chem Ltd	Morgan Stanley	(52.366)	(0,00)
955.836	Li Ning Co Ltd	Morgan Stanley	(130.567)	(0,01)
451.342	Li Ning Co Ltd	Goldman Sachs International	(20.392)	(0,00)
(769.010)	Liberty Global Plc Class A	Goldman Sachs International	(3.830)	(0,00)
(828.776)	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM Class A	Goldman Sachs International	(86)	(0,00)
300	Life Corp	Morgan Stanley	(268)	(0,00)
1.900	Lion Corp	Morgan Stanley	(637)	(0,00)
(1.034.801)	Lithia Motors Inc Class A	Goldman Sachs International	(34.292)	(0,00)
6.000	Lixil Corp	Morgan Stanley	(3.826)	(0,00)
4.167.524	Longfor Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	(2.605)	(0,00)
21	Lonza Group AG	Morgan Stanley	(111)	(0,00)
2.816	L'Oreal SA	Morgan Stanley	(21.413)	(0,00)
75.838	Lotte Shopping Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	(333)	(0,00)
4.075.793	Lowe's Cos Inc	Goldman Sachs International	(39.292)	(0,00)
300.777	Lululemon Athletica Inc	Goldman Sachs International	(44.267)	(0,00)
439	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	Morgan Stanley	(5.922)	(0,00)
22.260	Lyell Immunopharma Inc	JPMorgan Chase Bank	(16.918)	(0,00)
(400)	M&A Capital Partners Co Ltd	Morgan Stanley	(2.080)	(0,00)
668.841	M&G Plc	Goldman Sachs International	(157.110)	(0,01)
(220.308)	M&T Bank Corp	Goldman Sachs International	(1.823)	(0,00)
(500)	Macnica Fuji Electronics Holdings Inc	Morgan Stanley	(209)	(0,00)
(2.271.007)	Madison Square Garden Sports Corp Class A	Goldman Sachs International	(68.048)	(0,00)
30.300	Maeda Corp	Morgan Stanley	(5.069)	(0,00)
746.181	Magellan Midstream Partners LP	Goldman Sachs International	(74.948)	(0,00)
(1.228.408)	Magnit Cls Rub	Goldman Sachs International	(59.365)	(0,00)
(416.445)	Magnit PJSC	Goldman Sachs International	(26.286)	(0,00)
(66.895)	Magnitogorsk Iron & Steel Works PJSC	Morgan Stanley	(1.841)	(0,00)
(800)	Makino Milling Machine Co Ltd	Morgan Stanley	(590)	(0,00)
1.298.122	Manhattan Associates Inc	Goldman Sachs International	(45.919)	(0,00)
(4.600)	Marathon Petroleum Corp	Morgan Stanley	(71)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
216.992	Marsh & McLennan Cos Inc	Goldman Sachs International	(10.128)	(0,00)
(5.099.813)	Martin Marietta Materials Inc	Goldman Sachs International	(104.630)	(0,00)
43.100	Marubeni Corp	Morgan Stanley	(8.579)	(0,00)
1.800	Marui Group Co Ltd	Morgan Stanley	(1.177)	(0,00)
(400)	Maruwa Co Ltd	Morgan Stanley	(811)	(0,00)
217.296	Marvell Technology Inc	Goldman Sachs International	(16.324)	(0,00)
1.703.733	Masco Corp	JPMorgan Chase Bank	(105.665)	(0,01)
(187.978)	Match Group Inc	Goldman Sachs International	(5.774)	(0,00)
4.900	Mazda Motor Corp	Morgan Stanley	(972)	(0,00)
7.436	Mediclinic International Plc	Morgan Stanley	(229)	(0,00)
1.737.285	Mediobanca SpA	Goldman Sachs International	(115.202)	(0,01)
(5.141.330)	Meituan Class B	Goldman Sachs International	(3.983)	(0,00)
74.403.320	Meituan Class B	Société Générale	(1.034.506)	(0,05)
1.067	Melexis NV	Morgan Stanley	(995)	(0,00)
1.873.868	Melrose Industries Plc	Goldman Sachs International	(468.373)	(0,02)
(542.281)	Melrose Industries Plc	JPMorgan Chase Bank	(194.080)	(0,01)
(700)	Menicon Co Ltd	Morgan Stanley	(1.621)	(0,00)
(100)	Mercari Inc	Morgan Stanley	(516)	(0,00)
1.511.163	Merck & Co Inc	Goldman Sachs International	(83.160)	(0,00)
2.588.661	Merck & Co Inc	JPMorgan Chase Bank	(72.252)	(0,00)
445.675	Merck KGaA	Goldman Sachs International	(45.483)	(0,00)
2.187	Merlin Properties Socimi SA	Morgan Stanley	(389)	(0,00)
(1.159)	METRO AG	Morgan Stanley	(3)	(0,00)
(15.145)	Micro Focus International Plc	Morgan Stanley	(763)	(0,00)
356.522	Micron Technology Inc	Goldman Sachs International	(6.271)	(0,00)
796.136	Microsoft Corp	Goldman Sachs International	(52.198)	(0,00)
(217.157)	Midea Group Co Ltd Class A	Goldman Sachs International	(16.227)	(0,00)
(500)	Milbon Co Ltd	Morgan Stanley	(652)	(0,00)
215.225	Mimecast Ltd	Goldman Sachs International	(24.049)	(0,00)
(4.700)	MINEBEA MITSUMI Inc	Morgan Stanley	(2.768)	(0,00)
(800)	Mirait Holdings Corp	Morgan Stanley	(292)	(0,00)
68	Mithra Pharmaceuticals SA	Morgan Stanley	(21)	(0,00)
77.013.538	Mitsubishi Estate Co Ltd	Morgan Stanley	(34.093)	(0,00)
(57.246.581)	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Morgan Stanley	(51.146)	(0,00)
26.004.291	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	JPMorgan Chase Bank	(33.054)	(0,00)
98.280.867	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	Goldman Sachs International	(2.982)	(0,00)
(297.610)	Mobile TeleSystems PJSC	Goldman Sachs International	(4.521)	(0,00)
96.426.570	MOL Hungarian Oil & Gas Plc	Goldman Sachs International	(24.583)	(0,00)
31.749.691	MOL Hungarian Oil & Gas Plc	Morgan Stanley	(8.676)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(63.548.484)	Monex Group Inc	Goldman Sachs International	(54.325)	(0,00)
981.006	Monster Beverage Corp	Goldman Sachs International	(6.971)	(0,00)
37	Montea NV	Morgan Stanley	(19)	(0,00)
(6.500)	Morinaga & Co Ltd	Morgan Stanley	(5.805)	(0,00)
500	Morinaga Milk Industry Co Ltd	Morgan Stanley	(556)	(0,00)
(101.439.838)	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Goldman Sachs International	(6.668)	(0,00)
2.762.037	Msacret	Morgan Stanley	(2.416)	(0,00)
4.006.701	Msnbuqqq Eq Custom Bskt	Morgan Stanley	(252.573)	(0,01)
1.013.992	Msnbuxle Equity Custom Basket	Morgan Stanley	(38.446)	(0,00)
(5.006.934)	MTR Corp	Goldman Sachs International	(8.201)	(0,00)
158	MTU Aero Engines AG	Morgan Stanley	(321)	(0,00)
(3.824.256)	Muenchener Rueckver AG	Goldman Sachs International	(311.916)	(0,02)
29	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG	Morgan Stanley	(165)	(0,00)
67.361.654	Murata Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs International	(12.023)	(0,00)
(200)	Musashi Seimitsu Industry Co Ltd	Morgan Stanley	(197)	(0,00)
153.324	MYT Netherlands Parent BV	Goldman Sachs International	(21.049)	(0,00)
3.800	Nabtesco Corp	Morgan Stanley	(354)	(0,00)
600	Nagoya Railroad Co Ltd	Morgan Stanley	(304)	(0,00)
(277.559)	National Australia Bank	Goldman Sachs International	(4.478)	(0,00)
823.806	National Fuel Gas Co	Goldman Sachs International	(31.813)	(0,00)
439.074	National Vision Holdings Inc	Goldman Sachs International	(36.460)	(0,00)
93	Naturgy Energy Group SA	Morgan Stanley	(26)	(0,00)
(764.669)	Natwest Group Plc	Goldman Sachs International	(23.253)	(0,00)
222.600	Nayuki Holdings Ltd	Morgan Stanley	(82.697)	(0,01)
(614.401)	Ncino Inc	Goldman Sachs International	(45.352)	(0,00)
86.066	Nemetschek Se	Goldman Sachs International	(10.474)	(0,00)
2.759	Nemetschek SE	Morgan Stanley	(3.215)	(0,00)
336	Neste Oyj	Morgan Stanley	(320)	(0,00)
(728.331)	Nestle SA	Morgan Stanley	(6.125)	(0,00)
2.838.305	Netflix Inc	Goldman Sachs International	(138.322)	(0,01)
621.750	Neurocrine Biosciences Inc	JPMorgan Chase Bank	(8.761)	(0,00)
765.795	Neurocrine Biosciences Inc	Goldman Sachs International	(20.273)	(0,00)
10.000.000	Neurocrine Biosciences Inc	Morgan Stanley	(79.000)	(0,01)
322.093	New Relic Inc	Goldman Sachs International	(48.328)	(0,00)
(2.063.742)	New World Development Co Ltd	Goldman Sachs International	(7.326)	(0,00)
(1.001.537)	NexGen Energy Ltd	Goldman Sachs International	(59.960)	(0,00)
3.051.270	Nexi SpA	Goldman Sachs International	(200.805)	(0,01)
(982)	Nexity SA	Morgan Stanley	(79)	(0,00)
22.600	Nexon Co Ltd	Morgan Stanley	(4.744)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
689	Next Plc	Morgan Stanley	(319)	(0,00)
(4.749.928)	Next Plc	Goldman Sachs International	(168.216)	(0,01)
(300)	Nextage Co Ltd	Morgan Stanley	(200)	(0,00)
35.300	NGK Spark Plug Co Ltd	Morgan Stanley	(12.270)	(0,00)
3.500	NH Foods Ltd	Morgan Stanley	(2.384)	(0,00)
(2.600)	Nichias Corp	Morgan Stanley	(766)	(0,00)
(3.500)	Nichicon Corp	Morgan Stanley	(707)	(0,00)
(6.000)	Nifco Inc	Morgan Stanley	(9.920)	(0,00)
(600)	Nihon M&A Center Inc	Morgan Stanley	(739)	(0,00)
(2.800)	NIKE Inc Class B	Morgan Stanley	(898)	(0,00)
104.564.883	Nintendo Co Ltd	Goldman Sachs International	(47.639)	(0,00)
300	Nintendo Co Ltd	Morgan Stanley	(711)	(0,00)
14.500	Nippon Electric Glass Co Ltd	Morgan Stanley	(6.185)	(0,00)
3.700	Nippon Light Metal Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(441)	(0,00)
9.600	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(5.198)	(0,00)
(51.839.649)	Nippon Shokubai Co Ltd	Morgan Stanley	(38.945)	(0,00)
(47.147.113)	Nippon Steel Corp	Morgan Stanley	(23.260)	(0,00)
50.400	Nippon Suisan Kaisha Ltd	Morgan Stanley	(9.040)	(0,00)
6.100	Nippon Television Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.029)	(0,00)
4.900	Nipro Corp	Morgan Stanley	(383)	(0,00)
(10.100)	Nishimatsu Construction Co Ltd	Morgan Stanley	(2.848)	(0,00)
500	Nishimatsuya Chain Co Ltd	Morgan Stanley	(277)	(0,00)
17.050.405	Nitori Holdings Co Ltd	Goldman Sachs International	(5.791)	(0,00)
1.300	Nitto Denko Corp	Morgan Stanley	(1.336)	(0,00)
2.987	NMC Health Plc	Morgan Stanley	(1.000)	(0,00)
100	Nojima Corp	Morgan Stanley	(42)	(0,00)
(134.257)	Nokian Renkaat OYJ	Morgan Stanley	(1.357)	(0,00)
53.200	Nomura Holdings Inc	Morgan Stanley	(6.329)	(0,00)
286.449	Nordex SE	Morgan Stanley	(258)	(0,00)
549	Norma Group SE	Morgan Stanley	(552)	(0,00)
(841.948)	Northern Star Resources	Morgan Stanley	(78.920)	(0,01)
11.723.929	NortonLifeLock Inc	Goldman Sachs International	(966.865)	(0,05)
4.058.455	Novartis AG	Goldman Sachs International	(161.147)	(0,01)
244.700	Novartis AG	JPMorgan Chase Bank	(19.031)	(0,00)
(21.854)	Novolipetsk Steel PJSC	Goldman Sachs International	(3.096)	(0,00)
(33.834)	Novozymes A/S	Morgan Stanley	(24)	(0,00)
(152.010)	Novus Capital Corp II	Morgan Stanley	(4.223)	(0,00)
152.100	NTN Corp	Morgan Stanley	(18.957)	(0,00)
63.500	NTT Data Corp	Morgan Stanley	(3.137)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
366.009	NVIDIA Corp	Goldman Sachs International	(1.577)	(0,00)
3.946	Ocado Group Plc	Morgan Stanley	(935)	(0,00)
3.294	OCI NV	Morgan Stanley	(1.576)	(0,00)
(143.680.964)	Oji Holdings Corp	Goldman Sachs International	(17.555)	(0,00)
900	Oji Holdings Corp	Morgan Stanley	(78)	(0,00)
664.340	Okta Inc	Goldman Sachs International	(11.141)	(0,00)
(200)	OKUMA Corp	Morgan Stanley	(56)	(0,00)
4.900	Olympus Corp	Morgan Stanley	(3.178)	(0,00)
2.530.349	Omnicom Group Inc	Goldman Sachs International	(44.330)	(0,00)
124.971	Omnicom Group Inc	Morgan Stanley	(5.204)	(0,00)
(800)	Open House Co Ltd	Morgan Stanley	(32)	(0,00)
773.899	Oracle Corp	Morgan Stanley	(204.197)	(0,01)
649.164	Oracle Corp	Goldman Sachs International	(43.625)	(0,00)
4.700	Oracle Corp Japan	Morgan Stanley	(41.959)	(0,00)
307	Orange Belgium SA	Morgan Stanley	(51)	(0,00)
245.293	Orion Corp	JPMorgan Chase Bank	(7.413)	(0,00)
2.898	Orion Oyj	Morgan Stanley	(1.211)	(0,00)
80.020.460	ORIX Corp	Goldman Sachs International	(42.001)	(0,00)
10.645.586	Orsted AS	Goldman Sachs International	(35.182)	(0,00)
(24.927)	Orsted AS	Morgan Stanley	(830)	(0,00)
(9.100)	OSG Corp	Morgan Stanley	(1.830)	(0,00)
(2.261.907)	Oshkosh Corp	Goldman Sachs International	(13.266)	(0,00)
1.900	OSRAM Licht AG	Morgan Stanley	(485)	(0,00)
200	Otsuka Corp	Morgan Stanley	(46)	(0,00)
2.200	Otsuka Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(2.487)	(0,00)
869.086	Outfront Media Inc	Goldman Sachs International	(25.699)	(0,00)
(15.240)	Outokumpu Oyj	Morgan Stanley	(743)	(0,00)
(1.730.640)	Outotec Oyj	Goldman Sachs International	(17.348)	(0,00)
1.944.113	PACCAR Inc	Goldman Sachs International	(5.506)	(0,00)
10.176.924	Palo Alto Networks Inc	Goldman Sachs International	(1.257.621)	(0,06)
(38.082.375)	Pan Pacific International Holdings Corp	Goldman Sachs International	(449)	(0,00)
(47.248.732)	Pan Pacific International Holdings Corp	Morgan Stanley	(26.964)	(0,00)
11.400	Park24 Co Ltd	Morgan Stanley	(9.513)	(0,00)
828.938	Parker Hannifin Corp	JPMorgan Chase Bank	(49.598)	(0,00)
3.979.555	Parker-Hannifin Corp	Goldman Sachs International	(53.138)	(0,00)
112	Partners Group Holding AG	Morgan Stanley	(1.444)	(0,00)
2.813.115	Partners Group Holding AG	Goldman Sachs International	(197.495)	(0,01)
1.363.055	Paycom Software Inc	Goldman Sachs International	(60.727)	(0,00)
857.795	Peloton Interactive Inc Class A	Goldman Sachs International	(132.785)	(0,01)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
31.300	Penta-Ocean Construction Co Ltd	Morgan Stanley	(1.813)	(0,00)
(6.000)	PeptiDream Inc	Morgan Stanley	(7.092)	(0,00)
599	Pernod Ricard SA	Morgan Stanley	(1.449)	(0,00)
725.090	Perrigo Co Plc	Goldman Sachs International	(73.554)	(0,00)
(181.791)	Persimmon Plc	Goldman Sachs International	(16.375)	(0,00)
2.300	Persol Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(274)	(0,00)
(174.205)	Petronas Chemicals Group Bhd	Morgan Stanley	(9.730)	(0,00)
73	Pfeiffer Vacuum Technology AG	Morgan Stanley	(49)	(0,00)
63	Pharmagest Interactive	Morgan Stanley	(67)	(0,00)
1.332.065	Phillips 66	Goldman Sachs International	(93.589)	(0,01)
1.144.191	PICC Property & Casualty Co Ltd	Morgan Stanley	(15.479)	(0,00)
(48.694.733)	Pigeon Corp	Morgan Stanley	(102.650)	(0,01)
(45.284.368)	Pigeon Corp	Goldman Sachs International	(55.607)	(0,00)
7.000.000	Pinduoduo Inc	JP Morgan Chase Bank	(83.100)	(0,01)
1.029.379	Ping An Healthcare and Technology Co Ltd	Goldman Sachs International	(538)	(0,00)
1.628.005	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	Morgan Stanley	(2.322)	(0,00)
1.259.580	Pinnacle Financial Partners Inc	Goldman Sachs International	(3.419)	(0,00)
2.852.885	Pinterest Inc Class A	Goldman Sachs International	(371.673)	(0,03)
1.919.152	Pioneer Natural Resources Co	Goldman Sachs International	(62.698)	(0,00)
483.347	Plains All Amer Pipeline LP	Goldman Sachs International	(133.259)	(0,01)
1.547.424	PNC Financial Services Group Inc	Goldman Sachs International	(30.621)	(0,00)
(438.968)	Polymetal International Plc	Goldman Sachs International	(29.899)	(0,00)
(219.129)	Polypid Ltd	JPMorgan Chase Bank	(51.343)	(0,00)
(12.001)	Polypid Ltd	Goldman Sachs International	(483)	(0,00)
209.550	Polyus PJSC	JPMorgan Chase Bank	(2.639)	(0,00)
62.823	Porsche Automobil Holding SE	Morgan Stanley	(1.235)	(0,00)
(407.999)	Posco	Morgan Stanley	(7.576)	(0,00)
(857)	Postal Savings Bank of China Ltd	Goldman Sachs International	(1)	(0,00)
1.385.356	Prairiesky Royalty Ltd	Goldman Sachs International	(140.481)	(0,01)
(264.789)	Primavera Cap Acquisition Corp	Morgan Stanley	(6.767)	(0,00)
(698.354)	Primoris Services Corp	Goldman Sachs International	(65.502)	(0,00)
457.970	Principal Financial Group Inc	Goldman Sachs International	(5.221)	(0,00)
(290)	Prosegur Cia de Seguridad SA	Morgan Stanley	(44)	(0,00)
(5.499.191)	ProSiebenSat.1 Media SE	Goldman Sachs International	(364.529)	(0,02)
(13)	Prosus NV	Morgan Stanley	(1)	(0,00)
240.942	Prudential Financial Inc	Goldman Sachs International	(5.326)	(0,00)
5.757	Prudential Plc	Morgan Stanley	(2.960)	(0,00)
1.482.229	Prudential Plc	Goldman Sachs International	(503)	(0,00)
511.779	Prysmian SpA	Goldman Sachs International	(76.444)	(0,01)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
108.998	PTC Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	(285)	(0,00)
215.673	Q2 Holdings Inc	Goldman Sachs International	(27.205)	(0,00)
267.245	QIAGEN NV	Goldman Sachs International	(12.332)	(0,00)
1.148.686	Qorvo Inc	Goldman Sachs International	(87.342)	(0,01)
874.756	QUALCOMM Inc	Goldman Sachs International	(39.415)	(0,00)
52.700	Rakuten Group Inc	Morgan Stanley	(15.297)	(0,00)
13.689	Randstad NV	Morgan Stanley	(194)	(0,00)
1.911.269	Randstad NV	Goldman Sachs International	(99.799)	(0,00)
243	Rathbone Brothers Plc	Morgan Stanley	(92)	(0,00)
243	Rational AG	Morgan Stanley	(2.897)	(0,00)
1.890.893	Rayonier Inc	Goldman Sachs International	(30.431)	(0,00)
1.730.606	Rayonier Inc	JPMorgan Chase Bank	(235.778)	(0,01)
(8.586.807)	Raytheon Technologies Corp	Goldman Sachs International	(311.865)	(0,02)
5.873	Redrow Plc	Morgan Stanley	(513)	(0,00)
70.259	Regal Beloit Corp	Goldman Sachs International	(4.211)	(0,00)
4.800	Relo Group Inc	Morgan Stanley	(3.490)	(0,00)
5.665	RELX Plc	Morgan Stanley	(896)	(0,00)
3.583.632	Remgro Ltd	Morgan Stanley	(25.594)	(0,00)
231.663	Renewable Energy Group Inc	Goldman Sachs International	(14.126)	(0,00)
3.600	Rengo Co Ltd	Morgan Stanley	(70)	(0,00)
32.681.806	Rengo Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	(17.733)	(0,00)
16.090	Renishaw Plc	Morgan Stanley	(144.478)	(0,01)
(1.006.214)	Rev Group Inc	Goldman Sachs International	(25.216)	(0,00)
(19.536.447)	Richter Gedeon Nyrt	Goldman Sachs International	(7.260)	(0,00)
42.900	Ricoh Co Ltd	Morgan Stanley	(33.385)	(0,00)
17.194	Rightmove Plc	Morgan Stanley	(2.210)	(0,00)
286.199	Rio Tinto Ltd	Morgan Stanley	(10.949)	(0,00)
159.326	Roblox Corp Class A	Goldman Sachs International	(45.951)	(0,00)
620.031	Roche Holding AG	Goldman Sachs International	(8.646)	(0,00)
6.155.340	Rockwell Automation Inc	Goldman Sachs International	(309.484)	(0,02)
(8.100)	Rohto Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	(6.634)	(0,00)
250.399	Roku Inc	Goldman Sachs International	(90.081)	(0,01)
200	Rorze Corp	Morgan Stanley	(1.000)	(0,00)
550.836	Rosneft OAO	Goldman Sachs International	(59.054)	(0,00)
(142.580)	Rosneft Oil Co PJSC	Goldman Sachs International	(730)	(0,00)
182	Rothschild & Co	Morgan Stanley	(94)	(0,00)
(2.176.817)	Royal Dutch Shell Plc	Goldman Sachs International	(52.523)	(0,00)
(1.399.634)	Royal Mail Plc	Goldman Sachs International	(25.987)	(0,00)
192	Royal Unibrew A/S	Morgan Stanley	(155)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
1.908	RTL Group SA	Morgan Stanley	(11)	(0,00)
1.784.806	RTS Index	Morgan Stanley	(4.732)	(0,00)
(1.049.975)	Rush Str Interactive Inc	Goldman Sachs International	(172.900)	(0,01)
172.288	Ryanair Holdings Plc	Goldman Sachs International	(247.649)	(0,01)
658.162	S&P Global Inc	Goldman Sachs International	(25.620)	(0,00)
5.411.500	Safran SA	JP Morgan Chase Bank	(1.199.613)	(0,06)
29.142	Safran SA	Morgan Stanley	(36.610)	(0,00)
3.440.423	Safran SA	Goldman Sachs International	(85.466)	(0,01)
(4.700)	Saizeriya Co Ltd	Morgan Stanley	(962)	(0,00)
547.384	Sally Beauty Holdings Inc	Goldman Sachs International	(27.216)	(0,00)
2.158	Salmar ASA	Morgan Stanley	(1.671)	(0,00)
1.820	Sampo Oyj	Morgan Stanley	(944)	(0,00)
(3.488.632)	Samsung Electronics Co Ltd	Morgan Stanley	(217.423)	(0,01)
(2.644.910)	Samsung Electronics Co Ltd	Goldman Sachs International	(25.221)	(0,00)
1.299.525	Samsung SDI Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	(136.735)	(0,01)
74.863	Samsung SDI Co Ltd	Morgan Stanley	(5.583)	(0,00)
(354.543)	Sandvik AB	Morgan Stanley	(3.608)	(0,00)
(200)	Sanken Electric Co Ltd	Morgan Stanley	(961)	(0,00)
(9.500)	Sankyo Co Ltd	Morgan Stanley	(1.183)	(0,00)
673.308	Sanofi	JPMorgan Chase Bank	(87.203)	(0,01)
12	Sanofi	Morgan Stanley	(16)	(0,00)
535.863	Sanofi	Goldman Sachs International	(5.392)	(0,00)
(18.500)	Santen Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	(621)	(0,00)
123.131	SAP SE	Goldman Sachs International	(16.202)	(0,00)
35.371	SAP SE	Morgan Stanley	(2.144)	(0,00)
10.900	Sapporo Holdings Ltd	Morgan Stanley	(567)	(0,00)
649	Sartorius Stedim Biotech	Morgan Stanley	(3.703)	(0,00)
851.884	SBA Communications Corp	Goldman Sachs International	(4.953)	(0,00)
18.300	SBI Holdings Inc	Morgan Stanley	(7.495)	(0,00)
(19.306)	Schindler Holding AG	Morgan Stanley	(181.725)	(0,01)
1.129.680	Schindler Holding AG	Goldman Sachs International	(74.147)	(0,01)
(3.305.054)	Schlumberger NV	Goldman Sachs International	(107.891)	(0,00)
(635.163)	Schlumberger NV	Morgan Stanley	(58.780)	(0,00)
1.779.769	Schneider Electric SE	Morgan Stanley	(56.426)	(0,00)
83.799	Schneider Electric SE	Goldman Sachs International	(2.127)	(0,00)
4.811	Schroders Plc	Morgan Stanley	(2.774)	(0,00)
4.400	Scorpio Tankers Inc	Morgan Stanley	(52)	(0,00)
(2.081.031)	Seagate Technology Holdings Plc	Goldman Sachs International	(109.633)	(0,01)
130	SEB SA	Morgan Stanley	(100)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
2.300	Secom Co Ltd	Morgan Stanley	(1.616)	(0,00)
7.100	Sega Sammy Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.545)	(0,00)
4.985	Segro Plc	Morgan Stanley	(786)	(0,00)
9.500	Seibu Holdings Inc	Morgan Stanley	(6.212)	(0,00)
16.800	Seiko Epson Corp	Morgan Stanley	(6.575)	(0,00)
(5.400)	Seiren Co Ltd	Morgan Stanley	(1.831)	(0,00)
(8.100)	Sekisui Chemical Co Ltd	Morgan Stanley	(1.637)	(0,00)
141.307.804	Sekisui Chemical Co Ltd	Goldman Sachs International	(19.650)	(0,00)
3.200	Sekisui House Ltd	Morgan Stanley	(488)	(0,00)
1.162.659	Serco Group Plc	Goldman Sachs International	(45.245)	(0,00)
(2.049.966)	ServiceNow Inc	Morgan Stanley	(34.045)	(0,00)
(522)	SES SA	Morgan Stanley	(12)	(0,00)
(156.000)	Seven Bank Ltd	Morgan Stanley	(3.162)	(0,00)
290.982	Severn Trent Plc	Goldman Sachs International	(33.129)	(0,00)
211.815	Severstal PAO	Morgan Stanley	(1.063)	(0,00)
805	SFS Group AG	Morgan Stanley	(1.251)	(0,00)
(10.800)	SG Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(5.562)	(0,00)
8	SGS SA	Morgan Stanley	(160)	(0,00)
13.005	Shaftesbury Plc	Morgan Stanley	(1.521)	(0,00)
459.333	Shake Shack Inc Class A	Morgan Stanley	(8.321)	(0,00)
(65.875)	Shandong Sinocera Functional Material Co Ltd	Goldman Sachs International	(5.003)	(0,00)
51.300	Sharp Corp	Morgan Stanley	(22.268)	(0,00)
359.569	Shell Midstream Partners LP	Goldman Sachs International	(8.255)	(0,00)
(1.100)	Shimano Inc	Morgan Stanley	(6.835)	(0,00)
(335.102)	Shimao Group Holdings Ltd	Goldman Sachs International	(7.144)	(0,00)
(1.749.048)	Shimao Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	(57.968)	(0,00)
(136.839.991)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Goldman Sachs International	(27.671)	(0,00)
234.499	Shinsegae International	Morgan Stanley	(1.495)	(0,00)
(30.277.678)	Shinsei Bank Ltd	Goldman Sachs International	(30.108)	(0,00)
59.708.149	Shionogi & Co Ltd	Morgan Stanley	(4.576)	(0,00)
7.124.725	Shiseido Co Ltd	Goldman Sachs International	(2.057)	(0,00)
60.881.487	Shiseido Co Ltd	Morgan Stanley	(91.878)	(0,01)
(600)	Shoei Co Ltd	Morgan Stanley	(559)	(0,00)
1.139.232	Shopify Inc Class A	Goldman Sachs International	(87.151)	(0,01)
(78.241.743)	Showa Denko KK	Morgan Stanley	(7.679)	(0,00)
(15.486.097)	Showa Denko KK	Goldman Sachs International	(5.772)	(0,00)
54	Siegfried Holding AG	Morgan Stanley	(532)	(0,00)
(5.359.978)	Siemens AG	Goldman Sachs International	(223.968)	(0,01)
267	Siemens Healthineers AG	Morgan Stanley	(67)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
182	SIG Combibloc Group AG	Morgan Stanley	(19)	(0,00)
12.605.609	Sika AG	Société Générale	(1.409.191)	(0,07)
264	SimCorp A/S	Morgan Stanley	(232)	(0,00)
(347)	Sinch AB	Morgan Stanley	(18)	(0,00)
(1.140.612)	Sino Biopharmaceutical Ltd	Goldman Sachs International	(24.123)	(0,00)
1.372.838	Sinopharm Group Co Ltd	Goldman Sachs International	(15.597)	(0,00)
784.318	Sinopharm Group Co Ltd	Morgan Stanley	(24.219)	(0,00)
611.260	Sirius XM Holdings Inc	Goldman Sachs International	(13.115)	(0,00)
(3.878)	Sixt SE	Morgan Stanley	(2.957)	(0,00)
(5.918.153)	SJM Holdings Ltd	Goldman Sachs International	(86.877)	(0,01)
14.802.785	Skandinaviska Enskilda Banken AB	Goldman Sachs International	(24.575)	(0,00)
29.100	Skylark Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(12.226)	(0,00)
(700)	SMC Corp	Morgan Stanley	(1.805)	(0,00)
150.637	Smith & Nephew Plc	Goldman Sachs International	(0)	(0,00)
1.168.661	Smith (A.O.) Corp	JPMorgan Chase Bank	(311.519)	(0,02)
186.719	Smiths Group Plc	Morgan Stanley	(39.656)	(0,00)
(2.695.127)	Smooore International Holdings Ltd	Goldman Sachs International	(74.146)	(0,00)
(200)	SMS Co Ltd	Morgan Stanley	(52)	(0,00)
(42.203)	Smurfit Kappa Group Plc	Goldman Sachs International	(40.272)	(0,00)
219	Smurfit Kappa Group Plc	Morgan Stanley	(18)	(0,00)
536.284	Snap Inc Class A	Goldman Sachs International	(54.280)	(0,00)
1.042.790	Snap-on Inc	JPMorgan Chase Bank	(35.996)	(0,00)
33	Societe Fonciere Lyonnaise SA	Morgan Stanley	(49)	(0,00)
2.825.277	Societe Generale SA	Goldman Sachs International	(59.291)	(0,00)
(19.984.928)	Société Générale SGBVRRU Index	Société Générale	(240.089)	(0,01)
616	Sofina SA	Morgan Stanley	(2.540)	(0,00)
31.320.433	SoftBank Corp	Goldman Sachs International	(3.100)	(0,00)
148.204.127	SoftBank Corp	Morgan Stanley	(126.499)	(0,01)
5.178	Softcat Plc	Morgan Stanley	(1.499)	(0,00)
57	SOITEC	Morgan Stanley	(165)	(0,00)
273.600	Sojitz Corp	Morgan Stanley	(21.488)	(0,00)
84	Somfy SA	Morgan Stanley	(296)	(0,00)
1.700	Sompo Holdings Inc	Morgan Stanley	(359)	(0,00)
1.502.963	Sonoco Products Co	JPMorgan Chase Bank	(240.355)	(0,01)
(40.956.815)	Sony Group Corp	Goldman Sachs International	(8.514)	(0,00)
38	Sopra Steria Group SACA	Morgan Stanley	(26)	(0,00)
10.000.000	Southwest Airlines Co	Morgan Stanley	(2.035.250)	(0,09)
(149.435)	Spartan Acquisition III Class A	Morgan Stanley	(3.494)	(0,00)
865	Spectris Plc	Morgan Stanley	(270)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
793.801	Spirax-Sarco Engineering	JPMorgan Chase Bank	(213.498)	(0,01)
332.945	Spirax-Sarco Engineering Plc	Goldman Sachs International	(27.348)	(0,00)
1.314	Spirax-Sarco Engineering Plc	Morgan Stanley	(1.200)	(0,00)
369	Spirent Communications Plc	Morgan Stanley	(11)	(0,00)
3.257.840	Spotify Technology SA	Goldman Sachs International	(250.596)	(0,02)
3.243.298	Square Inc Class A	Goldman Sachs International	(252.294)	(0,01)
428	SSE Plc	Morgan Stanley	(84)	(0,00)
6.324	St James's Place Plc	Morgan Stanley	(824)	(0,00)
677	Stabilus SA	Morgan Stanley	(336)	(0,00)
9.819	Standard Life Aberdeen Plc	Morgan Stanley	(378)	(0,00)
(341.971)	Star Peak Corp II	Morgan Stanley	(3.904)	(0,00)
(39.509)	Star Peak Corp II - Class A	Morgan Stanley	(2.022)	(0,00)
511.091	Stellantis NV	Goldman Sachs International	(174.366)	(0,01)
227.088	Steven Madden Ltd	Goldman Sachs International	(1.336)	(0,00)
83.218	STMicroelectronics NV	Goldman Sachs International	(5.163)	(0,00)
351.233	Stora Enso Oyj	Morgan Stanley	(136)	(0,00)
160	Straumann Holding AG	Morgan Stanley	(1.574)	(0,00)
1.479	Stroeer SE & Co KGaA	Morgan Stanley	(2.211)	(0,00)
86.176.111	Subaru Corp	Goldman Sachs International	(14.983)	(0,00)
20.600	Subaru Corp	Morgan Stanley	(9.286)	(0,00)
(5.360)	Suedzucker AG	Morgan Stanley	(390)	(0,00)
(400)	Sumitomo Bakelite Co Ltd	Morgan Stanley	(99)	(0,00)
53.100	Sumitomo Chemical Co Ltd	Morgan Stanley	(6.772)	(0,00)
(51.789.702)	Sumitomo Chemical Co Ltd	Goldman Sachs International	(18.954)	(0,00)
19.300	Sumitomo Corp	Morgan Stanley	(6.176)	(0,00)
64.520.616	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	Morgan Stanley	(12.014)	(0,00)
(211.443.997)	Sumitomo Electric Industries Ltd	Goldman Sachs International	(103.110)	(0,01)
11.800	Sumitomo Forestry Co Ltd	Morgan Stanley	(9.106)	(0,00)
9.200	Sumitomo Heavy Industries Ltd	Morgan Stanley	(3.624)	(0,00)
5.100	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Morgan Stanley	(5.847)	(0,00)
2.700	Sumitomo Osaka Cement Co Ltd	Morgan Stanley	(795)	(0,00)
27.500	Sumitomo Rubber Industries Ltd	Morgan Stanley	(3.316)	(0,00)
(71.253)	Summit Materials Inc Class A	Morgan Stanley	(4.260)	(0,00)
(5.016.718)	Sunac China Holdings Ltd	Morgan Stanley	(101.015)	(0,01)
(1.448.091)	Sunac China Holdings Ltd	Goldman Sachs International	(14.717)	(0,00)
15.200	Sundrug Co Ltd	Morgan Stanley	(12.826)	(0,00)
(44.527.565)	Sundrug Co Ltd	Goldman Sachs International	(16.458)	(0,00)
8.862.559	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	Morgan Stanley	(1.193)	(0,00)
3.265.011	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	Goldman Sachs International	(146.048)	(0,01)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
4.200	Suntory Beverage & Food Ltd	Morgan Stanley	(1.352)	(0,00)
(71.496)	Sustainable Development AC Class A	Morgan Stanley	(2.383)	(0,00)
(72.947)	Sutro Biopharma Inc	Goldman Sachs International	(3.784)	(0,00)
(377.878)	Sutro Biopharma Inc	JPMorgan Chase Bank	(96.772)	(0,01)
2.400	Suzuken Co Ltd	Morgan Stanley	(1.273)	(0,00)
950.859	Swedish Orphan Biovitrum AB	Goldman Sachs International	(587)	(0,00)
118.009	Swiss Re AG	Goldman Sachs International	(43.745)	(0,00)
(532.899)	Switchback II Corp Class A	Morgan Stanley	(6.513)	(0,00)
52.270	Symrise AG	Morgan Stanley	(2.613)	(0,00)
17.130	Synthomer Plc	Morgan Stanley	(2.374)	(0,00)
(4.000)	Systemex Corp	Morgan Stanley	(30.514)	(0,00)
(1.700)	Systema Corp	Morgan Stanley	(1.892)	(0,00)
1.894.983	T Rowe Price Group Inc	Goldman Sachs International	(126.914)	(0,01)
9.500	T&D Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.024)	(0,00)
(9.600)	Tadano Ltd	Morgan Stanley	(1.932)	(0,00)
29.700	Taiheiyu Cement Corp	Morgan Stanley	(5.218)	(0,00)
10.287.491	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs International	(287.660)	(0,01)
64.999.748	Taiyo Yuden Co Ltd	Goldman Sachs International	(32.550)	(0,00)
54.824.000	Taiyo Yuden Co Ltd	JPMorgan Chase Bank	(50.050)	(0,00)
100	Takara Bio Inc	Morgan Stanley	(19)	(0,00)
21.900	Takashimaya Co Ltd	Morgan Stanley	(12.376)	(0,00)
9.900	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	(5.649)	(0,00)
(3.100)	Takeuchi Manufacturing Co Ltd	Morgan Stanley	(958)	(0,00)
2.201	Talanx AG	Morgan Stanley	(223)	(0,00)
3.243	Talaris Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(7.491)	(0,00)
1.356.402	Taylor Wimpey Plc	Morgan Stanley	(275.570)	(0,01)
5.100	TDK Corp	Morgan Stanley	(3.797)	(0,00)
166.693	Tecan Group AG	Goldman Sachs International	(1.764)	(0,00)
140	Tecan Group AG	Morgan Stanley	(2.117)	(0,00)
(13.500)	TechnoPro Holdings Inc	Morgan Stanley	(5.009)	(0,00)
16.300	Teijin Ltd	Morgan Stanley	(4.854)	(0,00)
(3.387)	Telefonica SA	Morgan Stanley	(64)	(0,00)
4.967	Telenor ASA	Morgan Stanley	(354)	(0,00)
83	Teleperformance	Morgan Stanley	(339)	(0,00)
1.664.290	Telia Co AB	Morgan Stanley	(11.528)	(0,00)
2.192.515	Telia Co AB	Goldman Sachs International	(5.884)	(0,00)
(5.759.447)	Tencent Holdings Ltd	Goldman Sachs International	(13.437)	(0,00)
(3.199.661)	Tencent Holdings Ltd	Morgan Stanley	(119.156)	(0,01)
326.837	Teradata Corp	Goldman Sachs International	(72.464)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(500)	Terumo Corp	Morgan Stanley	(257)	(0,00)
4.961.344	Tesla Inc	Goldman Sachs International	(593.136)	(0,03)
145	Tessenderlo Group SA	Morgan Stanley	(25)	(0,00)
1.716.616	Texas Instruments Inc	Goldman Sachs International	(28.614)	(0,00)
(108.443)	TG Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	(364)	(0,00)
885	Thales SA	Morgan Stanley	(318)	(0,00)
5.900	THK Co Ltd	Morgan Stanley	(5.147)	(0,00)
38.124	Thredup Inc Class A	Morgan Stanley	(19.159)	(0,00)
67.944	Thredup Inc Class A	Goldman Sachs International	(19.666)	(0,00)
2.956.405	Tiger Brands Ltd	Goldman Sachs International	(2.688)	(0,00)
788.073	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	Goldman Sachs International	(3.081)	(0,00)
4.126.015	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	Morgan Stanley	(47.514)	(0,00)
100	TIS Inc	Morgan Stanley	(30)	(0,00)
76	TKH Group NV	Morgan Stanley	(14)	(0,00)
(300)	Toei Co Ltd	Morgan Stanley	(1.266)	(0,00)
19.900	Tokai Carbon Co Ltd	Morgan Stanley	(13.122)	(0,00)
(11.228.546)	Tokai Carbon Co Ltd	Goldman Sachs International	(5.988)	(0,00)
(1.300)	Tokai Rika Co Ltd	Morgan Stanley	(536)	(0,00)
(51.041.081)	Tokio Marine Holdings Inc	Goldman Sachs International	(22.746)	(0,00)
11.400	Tokuyama Corp	Morgan Stanley	(2.593)	(0,00)
(1.900)	Tokyo Century Corp	Morgan Stanley	(1.982)	(0,00)
400	Tokyo Electron Ltd	Morgan Stanley	(2.248)	(0,00)
18.200	Tokyo Gas Co Ltd	Morgan Stanley	(12.064)	(0,00)
500	Tokyo Seimitsu Co Ltd	Morgan Stanley	(622)	(0,00)
46.440.876	Tokyo Steel Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs International	(25.413)	(0,00)
(5.400)	Tokyo Steel Manufacturing Co Ltd	Morgan Stanley	(1.251)	(0,00)
400	Tokyotokeiba Co Ltd	Morgan Stanley	(510)	(0,00)
51.000	Tokyu Fudosan Holdings Corp	Morgan Stanley	(19.993)	(0,00)
1.868	TOMRA Systems ASA	Morgan Stanley	(1.637)	(0,00)
1.917.586	Tongcheng-Elong Holdings Ltd	Morgan Stanley	(30.416)	(0,00)
2.376.678	Tongcheng-Elong Holdings Ltd	Goldman Sachs International	(25.438)	(0,00)
15.600	Topcon Corp	Morgan Stanley	(9.251)	(0,00)
116	Topdanmark AS	Morgan Stanley	(4)	(0,00)
71.745.250	Toray Industries Inc	Morgan Stanley	(44.908)	(0,00)
(228.688.171)	Toray Industries Inc	Goldman Sachs International	(63.400)	(0,00)
156.817.364	Tosoh Corp	Goldman Sachs International	(45.050)	(0,00)
(851.382)	TOTAL SE	Société Générale	(64.254)	(0,00)
2.400	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Morgan Stanley	(3.186)	(0,00)
16.500	Toyoda Gosei Co Ltd	Morgan Stanley	(2.081)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
2.300	Toyota Tsusho Corp	Morgan Stanley	(3.147)	(0,00)
(1.444)	Trainline Plc	Morgan Stanley	(13)	(0,00)
(500)	Transcosmos Inc	Morgan Stanley	(458)	(0,00)
161	Traton SE	Morgan Stanley	(35)	(0,00)
400	Tri Chemical Laboratories Inc	Morgan Stanley	(519)	(0,00)
100	TriCo Bancshares	Morgan Stanley	(3.183)	(0,00)
664	Trigano SA	Morgan Stanley	(449)	(0,00)
(5.305.164)	Trip.com Group Ltd	Goldman Sachs International	(38.652)	(0,00)
(2.895.636)	TripAdvisor Inc	Goldman Sachs International	(371.004)	(0,02)
(1.300)	TS Tech Co Ltd	Morgan Stanley	(773)	(0,00)
2.300	Tsuruha Holdings Inc	Morgan Stanley	(3.225)	(0,00)
654.659	Twitter Inc	Goldman Sachs International	(6.353)	(0,00)
10.000.000	Twitter Inc	Morgan Stanley	(130.500)	(0,01)
57.526.702	Ube Industries Ltd	JPMorgan Chase Bank	(115.647)	(0,01)
(12.598.226)	Uber Technologies Inc	Goldman Sachs International	(644.088)	(0,03)
(214.937)	Uber Technologies Inc	Morgan Stanley	(27.396)	(0,00)
(2.707)	Ubisoft Entertainment SA	Morgan Stanley	(552)	(0,00)
(4.570.637)	UBS Group AG	Goldman Sachs International	(47.051)	(0,00)
1.252.053	UGI Corp	Goldman Sachs International	(166.286)	(0,01)
581.354	Ulta Beauty Inc	Goldman Sachs International	(34.405)	(0,00)
(3.900)	Ulvac Inc	Morgan Stanley	(49)	(0,00)
4.902	Umicore	JPMorgan Chase Bank	(1.133)	(0,00)
559.908	Umicore	Goldman Sachs International	(70.831)	(0,00)
(3.912)	Unicaja Banco SA	Morgan Stanley	(3)	(0,00)
(624.611)	UniCredit SpA	Goldman Sachs International	(21.800)	(0,00)
204	Unilever Plc	Morgan Stanley	(43)	(0,00)
2.348	Uniper SE	Morgan Stanley	(214)	(0,00)
(220.430)	uniQure NV	Goldman Sachs International	(8.730)	(0,00)
9.791	UNITE Group Plc	Morgan Stanley	(2.506)	(0,00)
273.548	United Utilities Group Plc	Goldman Sachs International	(19.290)	(0,00)
(160.400)	UPM-Kymmene Oyj	Morgan Stanley	(899)	(0,00)
222.028	Upwork Inc	Goldman Sachs International	(90.719)	(0,01)
(1.004.423)	Uranium Participation Co	Goldman Sachs International	(7.592)	(0,00)
(17.300)	Ushio Inc	Morgan Stanley	(36.575)	(0,00)
(400)	UT Group Co Ltd	Morgan Stanley	(250)	(0,00)
598.121	Vail Resorts Inc	Goldman Sachs International	(39.544)	(0,00)
93.713	Valeo SA	Goldman Sachs International	(274.451)	(0,01)
342	Valmet OYJ	Morgan Stanley	(53)	(0,00)
(300)	ValueCommerce Co Ltd	Morgan Stanley	(290)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
461	VAT Group AG	Morgan Stanley	(28)	(0,00)
(218.242)	Ventas Inc	Goldman Sachs International	(2.088)	(0,00)
(3.859)	Veolia Environnement SA	Morgan Stanley	(118)	(0,00)
68	VERBIO Vereinigte BioEnergie AG	Morgan Stanley	(15)	(0,00)
2.110.794	VeriSign Inc	Goldman Sachs International	(59.763)	(0,00)
435.135	VeriSign Inc	Morgan Stanley	(56.555)	(0,00)
(2.527.297)	Verizon Communications Inc	Goldman Sachs International	(14.132)	(0,00)
3.400.360	Vestas Wind Systems A/S	Goldman Sachs International	(36.146)	(0,00)
102.614	Vesuvius Plc	Goldman Sachs International	(67.004)	(0,00)
37	VGP NV	Morgan Stanley	(25)	(0,00)
303.695	Viatris I	JPMorgan Chase Bank	(526)	(0,00)
446.145	Viatris Inc	Goldman Sachs International	(4.931)	(0,00)
9	Vicat SA	Morgan Stanley	(4)	(0,00)
226	Vifor Pharma AG	Morgan Stanley	(303)	(0,00)
(314.123)	Vinci Partners Investments	Morgan Stanley	(73.715)	(0,00)
225	Vinci SA	Morgan Stanley	(524)	(0,00)
7.797.494	Visa Inc Class A	Goldman Sachs International	(48.075)	(0,00)
439	Viscofan SA	Morgan Stanley	(57)	(0,00)
1.077.292	Vishay Intertechnology Inc	Goldman Sachs International	(4.518)	(0,00)
3.500.000	Vishay Intertechnology Inc	Morgan Stanley	(18.663)	(0,00)
2.338.044	VMware Inc Class A	Goldman Sachs International	(31.722)	(0,00)
160.948	VMware Inc Class A	Morgan Stanley	(25.046)	(0,00)
(257.663)	Vodafone Group Plc	Goldman Sachs International	(127.493)	(0,01)
(46.119)	Volkswagen AG	Goldman Sachs International	(5.336)	(0,00)
100	Volkswagen AG	Morgan Stanley	(3.031)	(0,00)
285.045	Volvo AB	Morgan Stanley	(603)	(0,00)
444	Vonovia SE	JPMorgan Chase Bank	(288)	(0,00)
1.397	Vontobel Holding AG	Morgan Stanley	(1.443)	(0,00)
6.432.444	Wabtec Corp	Goldman Sachs International	(141.311)	(0,01)
(24.061)	Wacker Chemie AG	Morgan Stanley	(1.873)	(0,00)
4.888.741	Walt Disney Co	Goldman Sachs International	(48.371)	(0,00)
779	Warehouses De Pauw CVA	Morgan Stanley	(449)	(0,00)
(1.375.500)	Warner Music Group Corp Class A	Goldman Sachs International	(23.097)	(0,00)
(220.502)	Wartsila OYJ Abp	Morgan Stanley	(1.234)	(0,00)
(14.700)	Washington Federal Inc	Morgan Stanley	(4)	(0,00)
(32)	Watches of Switzerland Group Plc	Morgan Stanley	(6)	(0,00)
7.367.748	Wayfair Inc Class A	Goldman Sachs International	(165.152)	(0,01)
114.893	Weir Group Plc	Goldman Sachs International	(166.462)	(0,01)
3.800	Welcia Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(2.774)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
215.084	Wells Fargo & Co	Goldman Sachs International	(210)	(0,00)
441.955	Welltower Inc	Goldman Sachs International	(6.393)	(0,00)
952	Wendel SE	Morgan Stanley	(2.632)	(0,00)
516.188	Western Midstream Partners LP	Goldman Sachs International	(106.480)	(0,01)
6.469.421	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Goldman Sachs International	(207.422)	(0,01)
3.200.135	Weyerhaeuser Co	Goldman Sachs International	(9.990)	(0,00)
1.217.713	Weyerhaeuser Co	JPMorgan Chase Bank	(513)	(0,00)
(18)	WH Smith Plc	Société Générale	(4)	(0,00)
4.565.674	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	Morgan Stanley	(99.986)	(0,01)
309	Whitbread Plc	Morgan Stanley	(71)	(0,00)
264.450	Whitehaven Coal Ltd	Morgan Stanley	(35.019)	(0,00)
162.790	Wickes Group Plc	Goldman Sachs International	(25.680)	(0,00)
1.608.830	Williams Cos Inc	Goldman Sachs International	(189.455)	(0,01)
158.680	Wizz Air Holdings Plc	Goldman Sachs International	(2.716)	(0,00)
47.293	Wizz Air Holdings Plc	Morgan Stanley	(160.887)	(0,01)
331.461	Wolters Kluwer NV	Goldman Sachs International	(49.229)	(0,00)
512.818	Wolters Kluwer NV	Morgan Stanley	(137.626)	(0,01)
(2.444.666)	Workday Inc Class A	Goldman Sachs International	(36.598)	(0,00)
423	Workspace Group Plc	Morgan Stanley	(6)	(0,00)
878.820	Worldline SA	Morgan Stanley	(104.049)	(0,01)
584.165	Worldline SA	Goldman Sachs International	(12.195)	(0,00)
4.319.664	WW Grainger Inc	Goldman Sachs International	(57.765)	(0,00)
102	Xior Student Housing NV	Morgan Stanley	(34)	(0,00)
2.862.616	Xli Deconstruction	Morgan Stanley	(159.386)	(0,01)
5.027.879	Xylem Inc	Goldman Sachs International	(98.821)	(0,01)
1.004.322	Xylem Inc	JPMorgan Chase Bank	(171.716)	(0,01)
146.100	Yamada Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(5.044)	(0,00)
1.900	Yamaha Motor Co Ltd	Morgan Stanley	(1.901)	(0,00)
(23.339.786)	Ya-Man Ltd	Morgan Stanley	(48.867)	(0,00)
(4.787.971)	Ya-Man Ltd	Goldman Sachs International	(1.439)	(0,00)
(7.800)	Yamato Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(4.299)	(0,00)
1.400	Yamazaki Baking Co Ltd	Morgan Stanley	(367)	(0,00)
14.284.361	Yandex NV Class A	Goldman Sachs International	(1.411.761)	(0,08)
1.163.953	Yelp Inc	Goldman Sachs International	(4.068)	(0,00)
15.700	Yokogawa Electric Corp	Morgan Stanley	(4.722)	(0,00)
7.700	Yokohama Rubber Co Ltd	Morgan Stanley	(1.947)	(0,00)
(10.700)	Yoshinoya Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(4.146)	(0,00)
(110.094.540)	Z Holdings Corp	Goldman Sachs International	(97.564)	(0,01)
465	Zalando SE	Morgan Stanley	(84)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos por diferencias (3,17%) (31 de diciembre de 2020: (2,64%)) (cont.)

Unidades	Descripción de los valores	Contraparte	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
700	Zensho Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(121)	(0,00)
(53.682.233)	Zeon Corp	Morgan Stanley	(36.665)	(0,00)
63.933.289	Zeon Corp	JPMorgan Chase Bank	(1.062)	(0,00)
(355.126)	Zeta Global Holdings Corp Class A	Goldman Sachs International	(1.073)	(0,00)
27.825	Zeta Global Holdings Corp Class A	Morgan Stanley	(44.520)	(0,00)
(80.570)	Zhejiang Dingli Machinery Co Ltd	Morgan Stanley	(34.427)	(0,00)
(1.037.539)	Zhejiang Dingli Machinery Co Ltd	Goldman Sachs International	(245.313)	(0,01)
(64.841)	Zhongsheng Group Holdings Ltd	Goldman Sachs International	(160)	(0,00)
660.604	Zoom Video Communications Inc Class A	Goldman Sachs International	(29.618)	(0,00)
(111)	zooplus AG	Morgan Stanley	(510)	(0,00)
120.539.033	ZOZO Inc	Morgan Stanley	(291.089)	(0,01)
(493.166)	ZTO Express Cayman Inc	Goldman Sachs International	(13.470)	(0,00)
(13)	Zur Rose Group AG	Morgan Stanley	(92)	(0,00)
98.585	Zur Rose Group AG	Goldman Sachs International	(6.163)	(0,00)
(741.070)	Zynga Inc Class A	Morgan Stanley	(53.450)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos por diferencias [∞]			(69.886.319)	(3,17)

Contratos de credit default swap (0,02%) (31 de diciembre de 2020: (0,00%))

Importe notional	Fecha de extinción	Contraparte	Obligación de referencia	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
4.300.000 EUR	20/06/2023	Goldman Sachs International	Buying default protection on Cellnex Telecom SA, 3.13%, 27/07/2025	(461.769)	(0,02)
Total valor razonable en contratos de credit default swap [∞]				(461.769)	(0,02)

Contratos de swap de rentabilidad total (0,28%) (31 de diciembre de 2020: (0,03%))

Nocional notional	Fecha de extinción	Tipo variable	Entidad de referencia	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(2.136.130) EUR	21/10/2022	(1,00) ¹	Morgan Stanley Basket MSABGID1 ⁸	(110.966)	(0,01)
(104.276) EUR	17/07/2025	(1,11) ¹	Goldman Sachs Basket GSABLMO1 ⁹	(1.673)	(0,00)
(211.159) USD	17/07/2025	(1,53) ²	Goldman Sachs Basket GSABMSAL ⁹	(1.547)	(0,00)
(3.002.788) USD	22/04/2022	0,00 ³	Goldman Sachs Basket GSVILG10 ⁹	(24.748)	(0,00)
(3.962.969) USD	22/11/2021	(0,33) ⁴	JPMorgan Basket JPABKCOXS ¹⁰	(626.287)	(0,03)
(339.279) USD	27/06/2022	(0,31) ²	JPMorgan Basket JPAYBPHA ¹⁰	(150.722)	(0,01)
(615.417) EUR	09/05/2022	(0,87) ¹	JPMorgan Basket JPAYEUH1 ¹⁰	(46.888)	(0,00)
(375.147) EUR	26/05/2022	(0,87) ¹	JPMorgan Basket JPAYMCPH ¹⁰	(3.421)	(0,00)
(2.606.846) USD	25/04/2022	(0,30) ²	JPMorgan Basket JPAYSTP2 ¹⁰	(28.663)	(0,00)
(974.953) USD	23/03/2023	(1,90) ²	Morgan Stanley Basket MSABCHXT ⁸	(33.335)	(0,00)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de swap de rentabilidad total (0,28%) (31 de diciembre de 2020: (0,03%)) (cont.)

Nocional nocional	Fecha de extinción	Tipo variable	Entidad de referencia	Minusvalía latente USD	% del Patri- monio neto
(89.268) EUR	21/10/2022	0,00 ¹	Morgan Stanley Basket MSABCON2 ⁸	(653)	(0,00)
(7.189.920) EUR	21/10/2022	(1,00) ¹	Morgan Stanley Basket MSABEUCB ⁸	(681.083)	(0,03)
(3.201.263) GBP	21/10/2022	(0,39) ²	Morgan Stanley Basket MSABGBS ⁸	(211.414)	(0,01)
(113.326) HKD	12/01/2023	(0,37) ⁵	Morgan Stanley Basket MSABHSCC ⁸	(7)	(0,00)
(1.359.052) EUR	21/10/2022	(1,00) ¹	Morgan Stanley Basket MSABIND1 ⁸	(41.793)	(0,00)
(289.633) EUR	21/10/2022	(0,20) ¹	Morgan Stanley Basket MSABREF2 ⁸	(8.930)	(0,00)
(1.698.472) EUR	21/10/2022	(1,00) ¹	Morgan Stanley Basket MSABTEC1 ⁸	(97.646)	(0,01)
(4.495.657) USD	23/02/2023	(0,80) ³	Morgan Stanley Basket MSCBSBTU ⁸	(140.661)	(0,01)
(1.482.466) USD	15/03/2023	(0,80) ³	Morgan Stanley Basket MSCBSMMU ⁸	(23.824)	(0,00)
(434.442) USD	01/06/2023	(1,10) ²	Morgan Stanley Basket MSLYT215 ⁸	(116.653)	(0,01)
(651.126) USD	17/04/2023	(1,46) ²	Morgan Stanley Basket MSNBUIW ⁸	(60.252)	(0,00)
(1.951.294) USD	21/10/2022	(0,54) ⁶	Morgan Stanley Basket MSNBUICL ⁸	(146.040)	(0,01)
(905.229) USD	21/10/2022	0,10 ⁶	Morgan Stanley Basket MSNBUIGV ⁸	(104.606)	(0,01)
(238.099) USD	21/10/2022	(0,20) ⁶	Morgan Stanley Basket MSNBUIVW ⁸	(5.822)	(0,00)
(645.688) USD	07/11/2022	(0,20) ⁶	Morgan Stanley Basket MSNBUIWF ⁸	(50.772)	(0,00)
(8.391.049) USD	21/03/2023	(0,29) ²	Morgan Stanley Basket MSNBUIWM ⁸	(213.008)	(0,01)
(382.366) USD	21/10/2022	(0,29) ⁶	Morgan Stanley Basket MSNBUIWO ⁸	(15.927)	(0,00)
(249.517) USD	24/05/2023	(0,21) ²	Morgan Stanley Basket MSNBUIWP ⁸	(23.196)	(0,00)
(161.222) USD	21/10/2022	(0,20) ⁶	Morgan Stanley Basket MSNBUMTU ⁸	(2.741)	(0,00)
(4.085.646) USD	17/04/2023	(0,23) ²	Morgan Stanley Basket MSNBUIQQ ⁸	(125)	(0,00)
(4.333.426) USD	21/10/2022	(0,20) ⁶	Morgan Stanley Basket MSNBURSP ⁸	(583.185)	(0,03)
(1.407.963) USD	21/10/2022	(0,43) ²	Morgan Stanley Basket MSNBURSX ⁸	(59.110)	(0,00)
(2.529.710) USD	11/01/2023	(0,24) ⁶	Morgan Stanley Basket MSNBUSMH ⁸	(266.329)	(0,02)
(40.084) USD	24/05/2023	(0,23) ²	Morgan Stanley Basket MSNBUSOX ⁸	(2.612)	(0,00)
(30.960.419) USD	06/01/2023	0,10 ⁶	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY ⁸	(471.220)	(0,02)
(3.820.540) USD	15/03/2023	(0,28) ²	Morgan Stanley Basket MSNBUXBI ⁸	(254.392)	(0,01)
(1.983.131) USD	21/10/2022	(0,23) ⁶	Morgan Stanley Basket MSNBUXLB ⁸	(30.372)	(0,00)
(997.213) USD	30/12/2022	(0,20) ⁶	Morgan Stanley Basket MSNBUXLC ⁸	(145.868)	(0,01)
(14.399.875) USD	06/12/2022	(0,20) ⁶	Morgan Stanley Basket MSNBUXLK ⁸	(779.989)	(0,04)
(2.014.835) USD	21/10/2022	(0,23) ⁶	Morgan Stanley Basket MSNBUXOP ⁸	(131.853)	(0,00)
(7.613) USD	19/10/2022	(0,40) ²	Morgan Stanley Basket MSQQUOMOL ⁸	(232)	(0,00)
(890.057) USD	07/06/2023	(0,20) ²	Morgan Stanley Basket MSQQUQLS ⁸	(602)	(0,00)
(16.533.000) EUR	06/05/2022	0,00 ⁷	UBS Basket UBSCFVPR ¹¹	(35.221)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de swap de rentabilidad total [∞]				(5.734.388)	(0,28)

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

² El LIBOR a 1 meses es la referencia para este contrato de swap de rentabilidad total.

³ Tipo fijo.

⁴ El LIBOR a 3 meses es la referencia para este contrato de swap de rentabilidad total.

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de swap de rentabilidad total (0,28%) (31 de diciembre de 2020: (0,03%)) (cont.)

⁵ El HIBOR a 1 meses es la referencia para este contrato de swap de rentabilidad total.

⁶ El FEDEF a 1 día es la referencia para este contrato de swap de rentabilidad total.

⁷ El UBSCFVPR Index es la referencia para este contrato de swap de rentabilidad total.

⁸ La contraparte en este contrato de swap de rentabilidad total es Morgan Stanley.

⁹ La contraparte en este contrato de swap de rentabilidad total es Goldman Sachs International.

¹⁰ La contraparte en este contrato de swap de rentabilidad total es JPMorgan Chase Bank.

¹¹ La contraparte en este contrato de swap de rentabilidad total es UBS AG.

Contratos de swap de varianza (0,02%) (31 de diciembre de 2020: (0,00%))

Vega Importe notional	Fecha de extinción	Contraparte	Entidad de referencia	Tipo de ejercicio de varianza	Minusvalía latente USD	% del Patri- monio neto
350.000 USD/ (350.000)	16/12/2022	BNP	Hang Seng China Enterprises Index vs Swiss Market Index	23,30% 19,50%	(134.394)	(0,00)
(145.000) EUR	17/06/2022	JPM	PIMCO Funds Global Investors Series plc Income Fund (PINEEHA ID Equity)	4,25%	(141.250)	(0,01)
(200.000) EUR	17/06/2022	JPM	PIMCO Funds Global Investors Series plc Income Fund (PINEEHA ID Equity)	4,25%	(180.023)	(0,01)
Minusvalía latente total sobre contratos de swaps de varianza [∞]					(455.667)	(0,02)

Contratos de swap sobre volatilidad (0,09%) (31 de diciembre de 2020: (0,00%))

Importe notional	Fecha de extinción	Contraparte	Obligación de referencia ¹	Minusvalía latente USD	% del Patri- monio neto	
300.000 EUR	20/01/2023	BNP Paribas	BNP 24 Names Global Basket	(115.726)	(0,01)	
200.000 USD	17/06/2022	BNP Paribas	BNP 15 Names US Basket	(129.120)	(0,01)	
150.000 USD	17/06/2022	Goldman Sachs International	GS 9 Names US Tech-Geo Basket	(242.059)	(0,01)	
500.000 EUR	15/12/2023	BNP Paribas	BNP 10 Names Global Geo Basket	(318.103)	(0,01)	
300.000 USD	17/06/2022	UBS	UBS 9 Names US Tech-Geo Basket	(661.671)	(0,03)	
350.000 EUR	16/12/2022	BNP Paribas	BNP 24 Names US and Europe Basket	(25.367)	(0,00)	
200.000 USD	17/06/2022	BNP Paribas	BNP 20 Names US Basket	(65.641)	(0,00)	
150.000 EUR	16/12/2022	BNP Paribas	STOXX Europe 600 Basic Resources vs FTSE 100 Index	(123.288)	(0,01)	
150.000 USD	10/06/2022	BNP Paribas	BNP 33 Names Asia Basket	(181.088)	(0,01)	
Minusvalía latente total sobre contratos de swaps de volatilidad [∞]					(1.862.063)	(0,09)

¹ Los precios de ejercicio están denominados en varias divisas extranjeras basadas en las divisas locales de las posiciones del swap.

	Valor razonable USD	% del Patri- monio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(134.587.217)	(6,14)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	1.152.468.116	52,56
Otro activo neto	1.040.209.661	47,44
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	2.192.677.777	100,00

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

Análisis de la cartera		USD	% de los Activos totales
*	Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	152.193.497	5,14
**	Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	953.817.590	32,24
±	Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	46.178.778	1,56
∞	Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	278.251	0,01
Total inversiones		1.152.468.116	38,95

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

Total compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
120.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 17/06/2021	119.987.000
120.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 02/12/2021	119.972.940
100.000.000	United States Cash Management Bill, 0.00%, 03/08/2021	99.995.328
95.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 24/06/2021	94.991.904
95.000.000	United States Cash Management Bill, 0.00%, 26/10/2021	94.985.241
90.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/09/2021	89.986.873
85.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 14/10/2021	84.984.401
80.000.000	United States Cash Management Bill, 0.00%, 20/07/2021	79.995.217
80.000.000	United States Cash Management Bill, 0.00%, 24/08/2021	79.994.579
80.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 22/04/2021	79.982.089
70.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 05/08/2021	69.998.163
70.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 29/04/2021	69.997.132
70.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 02/09/2021	69.996.719
70.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 06/05/2021	69.996.214
70.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 13/05/2021	69.995.316
70.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 21/10/2021	69.993.622
14.000.000	Best Path Global, 0.00%, 01/06/2022	1.802.892

Total ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
125.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/02/2021	124.988.184
75.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 04/02/2021	74.995.613
55.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 11/02/2021	54.996.078
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 04/03/2021	4.999.442
14.000.000	Best Path Global, 0.00%, 01/06/2022	1.809.552

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund

Informe del Gestor de inversiones

Durante el periodo de 6 meses finalizado el 30 de junio de 2021 (el "periodo analizado") la rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD se situó en el -3,62%. Durante el mismo periodo, el índice de referencia combinado, ponderado en un tercio por el JPMorgan GBI Emerging Markets Global Diversified Investment Grade 15% Cap Index (Total Return, Unhedged, USD) y dos tercios por el JP Morgan EMBI Global Diversified Investment Grade Index (Total Return, USD) (el "Índice"), obtuvo una rentabilidad del -3,00%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

La deuda de mercados emergentes (ME) se enfrentó a un contexto volátil en la primera mitad del año al verse favorecidos los activos de riesgo por la sólida recuperación económica y las continuas campañas de vacunación mundial, a pesar de la presión que ejerció el "reflation trade" en los mercados de renta fija. Los valores del Tesoro fueron objeto de bruscas ventas masivas que elevaron los rendimientos a 10 años a un máximo del 1,74% al final de marzo; esto quedó parcialmente contrarrestado a finales del segundo trimestre, a pesar del giro "hawkish" que adoptó la Reserva Federal estadounidense (la "Fed") a mediados de junio. Los precios del petróleo tuvieron un buen comportamiento durante todo el periodo, mientras que los metales preciosos atravesaron dificultades, en ambos casos como consecuencia del sentimiento económico positivo. El dólar estadounidense avanzó en gran medida en consonancia con las rentabilidades de los bonos del Tesoro, aunque experimentó un gran salto tras la reunión de la Fed del mes de junio.

El índice de deuda soberana con grado de inversión y denominada en divisas fuertes ha rendido un -2,45% en lo que va de año. La mayoría de países se anotaron pérdidas en el periodo, lideradas por algunos ubicados en América Latina, entre ellos Colombia, Perú, Panamá y Uruguay. Por contra, China, Eslovaquia y Lituania fueron los únicos países incluidos en el índice de divisas fuertes que registraron ganancias.

El índice de referencia con grado de inversión en moneda local rindió un -4,14% en dólares en lo que va de año, debido tanto a la depreciación de las divisas de mercados emergentes como al aumento de rendimientos de los bonos locales. Asimismo, en el ámbito local, la mayoría de mercados latinoamericanos se quedaron rezagados, incluidos Perú, Colombia y Chile, mientras que China fue el mercado local que mejor se comportó durante el periodo al apreciarse el renminbi frente al dólar estadounidense.

La Cartera se quedó a la zaga del índice en el periodo analizado como consecuencia de la selección de valores "bottom-up" en el área de divisas fuertes, mientras que el posicionamiento en moneda local aportó valor y la aportación de la asignación táctica de activos resultó neutral. En el área de divisas fuertes, los principales lastres fueron las infraponderaciones en China y Arabia Saudí, así como la selección de valores en México, China y Rumanía, mientras que las asignaciones a bonos supranacionales destacaron por su aportación positiva. En el ámbito de divisas locales los motores de la rentabilidad superior fueron las sobreponderaciones en la corona checa y el rublo ruso, así como la infraponderación en el bath tailandés. El posicionamiento en tipos también aportó ganancias, gracias a las posiciones infraponderadas en países con bajos rendimientos como República Checa y Polonia, así como a las sobreponderaciones en Indonesia y Colombia. Por contra, la duración sobreponderada en México y Rusia restó rentabilidad.

Las expectativas de crecimiento mundial para el resto de 2021 siguen siendo alentadoras, siendo probable que los mercados emergentes se beneficien de la incesante recuperación cíclica, tal como reflejan tanto los datos de manufacturas como los precios de las materias primas. La aceleración de la vacunación prevista para el segundo semestre del año en el mundo emergente probablemente también favorecerá a la dinámica del crecimiento doméstico. Ante esta coyuntura, seguimos siendo optimistas sobre las perspectivas a medio plazo de las monedas de ME, ya que deberían salir bien paradas en nuestro escenario base de recuperación del crecimiento de los ME, y la mejora de los términos de intercambio favorecen especialmente a las monedas de países exportadores de materias primas. Por lo que respecta a los tipos locales, nuestras perspectivas son positivas para los países en los que ya se han descontado unas subidas de tipos significativas o para aquellos que están experimentando una recuperación menos profunda, mientras que mantenemos posiciones infraponderadas en varios países con bajos niveles de rentabilidad.

Un aumento de los tipos de interés estadounidenses mayor del esperado podría suponer un riesgo de cola para esta clase de activos, aunque nuestra hipótesis central es que los tipos subirán gradualmente en los próximos trimestres, lo cual no creemos que trastoque excesivamente las condiciones de financiación o los sectores de diferenciales en ME. En el ámbito corporativo, prevemos una reanimación del EBITDA de las grandes empresas de la región y una mejora de las métricas de apalancamiento de las mismas. También creemos que las valoraciones de los bonos soberanos y corporativos en divisas fuertes de mercados emergentes se encuentran dentro del rango de valor razonable y resultan atractivas en relación con los mercados desarrollados.

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		39.026.928	7.627.250
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	3.603.625	994.587
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		255.623	38
Cuentas a percibir por acciones emitidas		5.811	1.250
Cuentas por cobrar de intermediarios		316.212	169.548
Ingresos a percibir y otros activos		387.912	123.960
Activos totales		43.596.111	8.916.633
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		911.308	83.681
Descubierto bancario	3	–	20
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		3.572	–
Gastos devengados		42.206	27.620
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		1.040.858	69.096
Otras cuentas por pagar		46.475	20.636
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		2.044.419	201.053
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		41.551.692	8.715.580

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		466.764	362.602
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(1.419.279)	(775.618)
		(952.515)	(413.016)
Gastos			
Comisión de gestión	5	63.550	20.325
Comisión de administración	5	41.263	41.440
Comisión de compromiso	16	538	1.030
Comisión de depósito	5	5.939	7.163
Comisión del Depositario	5	721	881
Honorarios profesionales	7	33.678	22.397
Honorarios de los Consejeros	6	1.906	2.314
Costes de transacciones	7	42.419	44.285
Honorarios de auditoría	7	8.441	8.665
Reembolso de IVA		(81)	(59)
Otros gastos	7	4.615	5.198
Gastos no asumidos	5	(108.092)	(110.936)
Gastos totales		94.897	42.703
Costes financieros			
Gastos por intereses		11	236
Repartos de dividendos abonados	1	–	27.470
		11	27.706
Impuestos retenidos en origen		31.804	7.554
Impuesto sobre las plusvalías		(904)	(1.672)
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		(1.078.323)	(489.307)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	8.715.580	19.492.634
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	(1.078.323)	(489.307)
Suscripciones	34.747.882	3.288.149
Reembolsos	(833.447)	(7.008.758)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	41.551.692	15.282.718

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (cont.)

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 Tesoro 0,75% (31 de diciembre de 2020: 0,49%)					
Shekel israelí					
944.830	Bank of Israel Bill - Makam	0,00%	02/09/2021	290.104	0,70
72.329	Israel Treasury Bill MOF	0,00%	31/08/2021	22.196	0,05
Total bonos del Tesoro **				312.300	0,75
Bonos de empresa 19,27% (31 de diciembre de 2020: 20,34%)					
Euro					
200.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	2,75%	22/01/2033	248.119	0,60
Total euro				248.119	0,60
Dólar estadounidense					
200.000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*	4,60%	02/11/2047	236.402	0,57
200.000	Abu Dhabi Ports Co PJSC*	2,50%	06/05/2031	201.972	0,49
200.000	African Export-Import Bank*	2,63%	17/05/2026	202.368	0,49
200.000	African Export-Import Bank*	3,99%	21/09/2029	210.289	0,51
200.000	Alibaba Group Holding Ltd*	4,00%	06/12/2037	225.038	0,54
200.000	Banco de Credito e Inversiones SA*	3,50%	12/10/2027	215.002	0,52
200.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand**	5,38%	17/04/2025	227.178	0,55
200.000	Bank Leumi Le-Israel BM*	3,28%	29/01/2031	205.000	0,49
200.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT*	4,75%	13/05/2025	222.961	0,54
200.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	4,70%	22/10/2031	215.816	0,52
205.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	5,00%	27/07/2027	227.876	0,55
400.000	CCBL Cayman 1 Corp Ltd*	1,99%	21/07/2025	400.286	0,96
200.000	Cencosud SA*	4,38%	17/07/2027	219.142	0,53
200.000	China Development Bank Financial Leasing Co Ltd*	2,88%	28/09/2030	203.054	0,49
400.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	3,15%	14/01/2030	420.859	1,01
200.000	DP World Plc*	6,85%	02/07/2037	271.827	0,65
200.000	Empresa de Transmision Electrica SA*	5,13%	02/05/2049	222.783	0,54
400.000	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA*	3,65%	07/05/2030	431.946	1,04
200.000	Gulf International Bank BSC*	2,38%	23/09/2025	201.932	0,48
200.000	Hanwha Life Insurance Co Ltd*	4,70%	29/12/2049	209.516	0,50
200.000	Indian Railway Finance Corp Ltd*	3,84%	13/12/2027	216.251	0,52
250.000	Malaysia Wakala Sukuk Bhd*	3,08%	28/04/2051	260.189	0,63
200.000	MDGH - GMTN BV*	3,70%	07/11/2049	219.392	0,53
219.000	MDGH GMTN RSC Ltd*	2,50%	03/06/2031	222.011	0,53
200.000	MTR Corp Ltd*	1,63%	19/08/2030	193.470	0,46

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (cont.)

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 19,27% (31 de diciembre de 2020: 20,34%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
200.000	Ooredoo International Finance Ltd*	2,63%	08/04/2031	202.874	0,49
200.000	PSA Treasury Pte Ltd*	2,25%	30/04/2030	205.837	0,49
200.000	QIB Sukuk Ltd*	3,98%	26/03/2024	214.554	0,52
200.000	Sharjah Sukuk Program Ltd*	3,85%	03/04/2026	214.954	0,52
200.000	Shinhan Bank Co Ltd*	4,00%	23/04/2029	223.917	0,54
200.000	Sigma Alimentos SA de CV*	4,13%	02/05/2026	218.499	0,52
200.000	UltraTech Cement Ltd*	2,80%	16/02/2031	194.005	0,47
200.000	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd*	3,13%	16/07/2025	200.250	0,48
Total dólar estadounidense				7.757.450	18,67
Total bonos de empresa				8.005.569	19,27
Bonos del Estado 72,85% (31 de diciembre de 2020: 65,95%)					
Peso chileno					
80.000.000	Bonos de la Tesorería de la República en pesos*	2,80%	01/10/2033	89.324	0,22
25.000.000	Bonos de la Tesorería de la República en pesos*	4,70%	01/09/2030	35.207	0,08
20.000.000	Bonos de la Tesorería de la República en pesos*	6,00%	01/01/2043	30.893	0,07
Total peso chileno				155.424	0,37
Yuan renminbi chino					
100.000	China Government Bond**	1,99%	09/04/2025	14.974	0,04
200.000	China Government Bond**	2,36%	02/07/2023	30.756	0,07
660.000	China Government Bond**	2,68%	21/05/2030	98.385	0,24
530.000	China Government Bond**	2,85%	04/06/2027	81.168	0,20
800.000	China Government Bond**	2,88%	05/11/2023	124.308	0,30
200.000	China Government Bond**	2,94%	17/10/2024	31.089	0,07
2.900.000	China Government Bond**	3,02%	22/10/2025	450.839	1,08
700.000	China Government Bond**	3,03%	11/03/2026	108.855	0,26
100.000	China Government Bond**	3,12%	05/12/2026	15.592	0,04
1.500.000	China Government Bond**	3,27%	19/11/2030	235.435	0,57
2.440.000	China Government Bond**	3,28%	03/12/2027	383.032	0,92
300.000	China Government Bond**	3,72%	12/04/2051	46.938	0,11
650.000	China Government Bond**	3,81%	14/09/2050	102.865	0,25
Total yuan renminbi chino				1.724.236	4,15

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (cont.)

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 del Estado 72,85% (31 de diciembre de 2020: 65,95%) (cont.)					
Peso colombiano					
208.572.685	Colombian TES [†]	3,00%	25/03/2033	53.804	0,13
649.200.000	Colombian TES [†]	5,75%	03/11/2027	166.579	0,40
223.100.000	Colombian TES [†]	6,00%	28/04/2028	57.421	0,14
166.600.000	Colombian TES [†]	6,25%	26/11/2025	45.265	0,11
1.260.100.000	Colombian TES [†]	7,00%	30/06/2032	329.374	0,79
173.800.000	Colombian TES [†]	7,25%	18/10/2034	45.655	0,11
253.100.000	Colombian TES [†]	7,75%	18/09/2030	70.726	0,17
Total peso colombiano				768.824	1,85
Corona checa					
480.000	Czech Republic Government Bond [*]	0,05%	29/11/2029	19.260	0,05
900.000	Czech Republic Government Bond [*]	0,95%	15/05/2030	38.889	0,09
2.850.000	Czech Republic Government Bond [*]	1,00%	26/06/2026	128.147	0,31
2.950.000	Czech Republic Government Bond [*]	1,20%	13/03/2031	129.509	0,31
2.790.000	Czech Republic Government Bond [*]	2,00%	13/10/2033	131.643	0,32
3.710.000	Czech Republic Government Bond [*]	2,40%	17/09/2025	177.750	0,43
1.210.000	Czech Republic Government Bond [*]	2,75%	23/07/2029	60.234	0,14
Total corona checa				685.432	1,65
Euro					
511.000	Croatia Government International Bond [*]	1,13%	19/06/2029	622.436	1,50
100.000	Croatia Government International Bond [*]	1,13%	04/03/2033	117.678	0,28
133.000	Hungary Government International Bond [*]	1,63%	28/04/2032	167.723	0,40
132.000	Hungary Government International Bond [*]	1,75%	05/06/2035	165.669	0,40
750.000	Indonesia Government International Bond [*]	0,90%	14/02/2027	898.306	2,16
100.000	Indonesia Government International Bond [*]	1,10%	12/03/2033	115.727	0,28
400.000	Indonesia Government International Bond [*]	1,40%	30/10/2031	482.299	1,16
200.000	Kazakhstan Government International Bond [*]	0,60%	30/09/2026	236.734	0,57
300.000	Kazakhstan Government International Bond [*]	1,50%	30/09/2034	357.739	0,86
740.000	Kazakhstan Government International Bond [*]	2,38%	09/11/2028	980.159	2,36
250.000	Peruvian Government International Bond [*]	1,25%	11/03/2033	288.074	0,69
450.000	Philippine Government International Bond [*]	0,70%	03/02/2029	530.113	1,28
200.000	Philippine Government International Bond [*]	1,75%	28/04/2041	234.398	0,56
87.000	Romanian Government International Bond [*]	2,00%	14/04/2033	102.279	0,25
400.000	Romanian Government International Bond ^{**}	3,38%	08/02/2038	521.203	1,26

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (cont.)

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 del Estado 72,85% (31 de diciembre de 2020: 65,95%) (cont.)					
Euro (cont.)					
73.000	Romanian Government International Bond*	3,38%	28/01/2050	92.116	0,22
123.000	Romanian Government International Bond*	3,88%	29/10/2035	171.117	0,41
310.000	Romanian Government International Bond*	4,63%	03/04/2049	464.690	1,12
Total euro				6.548.460	15,76
Forint húngaro					
44.250.000	Hungary Government Bond*	1,50%	22/04/2026	145.819	0,35
30.820.000	Hungary Government Bond*	2,25%	20/04/2033	97.613	0,23
8.310.000	Hungary Government Bond*	3,00%	27/10/2027	29.400	0,07
7.780.000	Hungary Government Bond*	3,00%	21/08/2030	27.387	0,07
20.590.000	Hungary Government Bond*	3,00%	27/10/2038	68.204	0,16
12.380.000	Hungary Government Bond*	3,25%	22/10/2031	44.244	0,11
Total forint húngaro				412.667	0,99
Rupia indonesia					
8.300.000.000	Indonesia Treasury Bond*	5,50%	15/04/2026	573.059	1,38
5.400.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,50%	15/06/2025	390.410	0,94
5.506.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,50%	15/02/2031	375.402	0,90
186.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,63%	15/05/2033	12.758	0,03
400.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00%	15/05/2022	28.452	0,07
300.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00%	15/05/2027	21.911	0,05
4.450.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50%	15/06/2035	317.638	0,77
1.420.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50%	15/04/2040	100.423	0,24
84.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,13%	15/05/2024	6.328	0,02
222.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,25%	15/05/2036	16.773	0,04
100.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38%	15/03/2034	7.650	0,02
131.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38%	15/04/2039	10.033	0,02
Total rupia indonesia				1.860.837	4,48
Ringgit malayo					
600.000	Malaysia Government Bond**	2,63%	15/04/2031	136.542	0,33
70.000	Malaysia Government Bond**	3,48%	14/06/2024	17.435	0,04
500.000	Malaysia Government Bond**	3,48%	15/03/2023	123.530	0,30
710.000	Malaysia Government Bond**	3,50%	31/05/2027	176.769	0,43
229.000	Malaysia Government Bond**	3,62%	30/11/2021	55.573	0,13

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (cont.)

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 del Estado 72,85% (31 de diciembre de 2020: 65,95%) (cont.)					
Ringgit malayo (cont.)					
40.000	Malaysia Government Bond**	3,76%	20/04/2023	9.942	0,03
243.000	Malaysia Government Bond**	3,76%	22/05/2040	55.100	0,13
425.000	Malaysia Government Bond**	3,83%	05/07/2034	102.040	0,25
65.000	Malaysia Government Bond**	3,88%	10/03/2022	15.880	0,04
70.000	Malaysia Government Bond**	3,91%	15/07/2026	17.806	0,04
150.000	Malaysia Government Bond**	3,96%	15/09/2025	38.137	0,09
140.000	Malaysia Government Bond**	4,07%	15/06/2050	32.369	0,08
300.000	Malaysia Government Bond**	4,25%	31/05/2035	75.383	0,18
6.000	Malaysia Government Bond**	4,89%	08/06/2038	1.569	0,00
Total ringgit malayo				858.075	2,07
Peso mexicano					
893.200	Mexican Bonos*	6,50%	09/06/2022	45.304	0,11
3.948.800	Mexican Bonos*	7,50%	03/06/2027	206.892	0,50
2.730.000	Mexican Bonos*	7,75%	29/05/2031	144.837	0,35
5.490.000	Mexican Bonos*	7,75%	23/11/2034	291.203	0,70
2.950.000	Mexican Bonos*	7,75%	13/11/2042	152.439	0,37
903.800	Mexican Bonos*	8,00%	07/11/2047	47.924	0,11
1.220.000	Mexican Bonos*	8,50%	31/05/2029	67.487	0,16
1.560.000	Mexican Bonos*	8,50%	18/11/2038	86.650	0,21
2.590.000	Mexican Bonos*	10,00%	05/12/2024	145.362	0,35
88.142.100	Mexico Cetes*	0,00%	01/07/2021	442.683	1,07
151.380.000	Mexico Cetes*	0,00%	29/07/2021	757.735	1,82
67.135.800	Mexico Cetes*	0,00%	04/11/2021	331.894	0,80
Total peso mexicano				2.720.410	6,55
Sol peruano					
71.000	Peru Government Bond*	5,35%	12/08/2040	16.444	0,04
86.000	Peru Government Bond*	5,40%	12/08/2034	21.267	0,05
13.000	Peru Government Bond*	5,94%	12/02/2029	3.716	0,01
117.000	Peru Government Bond*	6,15%	12/08/2032	32.056	0,08
44.000	Peruvian Government International Bond**	5,20%	12/09/2023	12.564	0,03
56.000	Peruvian Government International Bond*	5,40%	12/08/2034	13.848	0,03
38.000	Peruvian Government International Bond**	6,35%	12/08/2028	11.113	0,03
226.000	Peruvian Government International Bond**	6,90%	12/08/2037	62.667	0,15

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (cont.)

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 del Estado 72,85% (31 de diciembre de 2020: 65,95%) (cont.)					
Sol peruano (cont.)					
508.000	Peruvian Government International Bond*	6,95%	12/08/2031	149.103	0,36
Total sol peruano				322.778	0,78
Zloty polaco					
722.000	Republic of Poland Government Bond**	1,25%	25/10/2030	183.582	0,44
288.000	Republic of Poland Government Bond*	2,50%	25/04/2024	79.682	0,19
69.000	Republic of Poland Government Bond*	2,50%	25/07/2027	19.286	0,05
594.000	Republic of Poland Government Bond**	2,75%	25/04/2028	169.136	0,41
323.000	Republic of Poland Government Bond*	2,75%	25/10/2029	92.908	0,22
Total zloty polaco				544.594	1,31
Nuevo leu rumano					
25.000	Romania Government Bond*	3,25%	24/06/2026	6.141	0,01
70.000	Romania Government Bond*	3,65%	28/07/2025	17.498	0,04
315.000	Romania Government Bond*	3,65%	24/09/2031	77.009	0,19
30.000	Romania Government Bond*	4,00%	25/10/2023	7.489	0,02
290.000	Romania Government Bond*	4,15%	26/01/2028	74.288	0,18
70.000	Romania Government Bond*	4,40%	25/09/2023	17.657	0,04
15.000	Romania Government Bond*	4,50%	17/06/2024	3.819	0,01
10.000	Romania Government Bond*	4,75%	11/10/2034	2.585	0,01
305.000	Romania Government Bond*	4,85%	22/04/2026	80.152	0,19
Total nuevo leu rumano				286.638	0,69
Rublo ruso					
39.057.000	Russian Federal Bond - OFZ*	4,50%	16/07/2025	491.194	1,18
15.136.000	Russian Federal Bond - OFZ*	6,90%	23/05/2029	206.566	0,50
23.105.000	Russian Federal Bond - OFZ*	7,25%	10/05/2034	320.784	0,77
5.145.000	Russian Federal Bond - OFZ*	7,70%	16/03/2039	74.582	0,18
2.102.000	Russian Federal Bond - OFZ*	8,50%	17/09/2031	31.753	0,07
8.900.635	Russian Federal Inflation Linked Bond*	2,50%	17/07/2030	119.461	0,29
Total rublo ruso				1.244.340	2,99
Baht tailandés					
10.500.000	Thailand Government Bond**	0,95%	17/06/2025	330.948	0,80
1.330.000	Thailand Government Bond**	1,45%	17/12/2024	42.657	0,10

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (cont.)

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 del Estado 72,85% (31 de diciembre de 2020: 65,95%) (cont.)					
Baht tailandés (cont.)					
7.510.000	Thailand Government Bond*	1,59%	17/12/2035	216.835	0,52
7.674.000	Thailand Government Bond**	1,60%	17/12/2029	239.618	0,58
1.000.000	Thailand Government Bond**	2,00%	17/12/2022	31.883	0,08
4.830.000	Thailand Government Bond*	2,00%	17/12/2031	153.812	0,37
1.300.000	Thailand Government Bond**	2,40%	17/12/2023	42.392	0,10
250.000	Thailand Government Bond**	2,88%	17/12/2028	8.620	0,02
62.000	Thailand Government Bond**	2,88%	17/06/2046	2.031	0,00
4.732.000	Thailand Government Bond**	3,30%	17/06/2038	166.345	0,40
200.000	Thailand Government Bond**	3,78%	25/06/2032	7.402	0,02
Total baht tailandés				1.242.543	2,99
Dólar estadounidense					
200.000	Abu Dhabi Government International Bond*	3,88%	16/04/2050	229.136	0,55
200.000	Airport Authority*	2,10%	29/12/2049	201.090	0,48
600.000	Bermuda Government International Bond*	3,72%	25/01/2027	658.500	1,58
630.000	Colombia Government International Bond*	4,50%	15/03/2029	688.880	1,66
880.000	Colombia Government International Bond*	6,13%	18/01/2041	1.044.833	2,51
200.000	Export Import Bank of Thailand*	1,06%	20/11/2023	201.916	0,49
400.000	Indonesia Government International Bond*	5,25%	17/01/2042	499.592	1,20
100.000	Indonesia Government International Bond*	6,63%	17/02/2037	138.562	0,33
300.000	Indonesia Government International Bond*	8,50%	12/10/2035	480.882	1,16
359.000	Korea Resources Corp*	1,75%	15/04/2026	360.681	0,87
200.000	Mexico Government International Bond*	5,00%	27/04/2051	227.600	0,55
786.000	Mexico Government International Bond*	5,75%	12/10/2110	942.155	2,27
200.000	Panama Government International Bond*	3,16%	23/01/2030	210.252	0,51
200.000	Panama Government International Bond*	6,70%	26/01/2036	272.159	0,65
630.000	Panama Government International Bond*	9,38%	01/04/2029	933.698	2,25
1.000.000	Peruvian Government International Bond*	8,75%	21/11/2033	1.573.072	3,79
600.000	Qatar Government International Bond*	4,00%	14/03/2029	689.882	1,66
400.000	Qatar Government International Bond*	5,10%	23/04/2048	531.991	1,28
500.000	Uruguay Government International Bond*	4,38%	23/01/2031	583.005	1,40
280.000	Uruguay Government International Bond*	5,10%	18/06/2050	367.857	0,89
Total dólar estadounidense				10.835.743	26,08

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (cont.)

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 del Estado 72,85% (31 de diciembre de 2020: 65,95%) (cont.)					
Peso uruguayo					
178.480	Uruguay Government International Bond*	4,38%	15/12/2028	4.873	0,01
2.336.000	Uruguay Government International Bond*	9,88%	20/06/2022	55.316	0,13
Total peso uruguayo				60.189	0,14
Total bonos del Estado				30.271.190	72,85
Total inversiones				38.589.059	92,87

Contratos de divisas a plazo 0,62% (31 de diciembre de 2020: 0,67%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
159.198.498 CLP	216.217 USD	27/09/2021	Citibank NA	1	1.897	0,01
1.955.621 CNY	296.863 USD	09/07/2021	Citibank NA	3	5.661	0,02
479.479 CNY	74.091 USD	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	122	0,00
2.741.826 CNY	420.648 USD	27/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	1.035	0,00
479.945 CNY	73.748 USD	08/10/2021	Morgan Stanley	1	10	0,00
243.738 CNY	37.217 USD	09/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	488	0,00
124.497 €	562.024 PLN	07/07/2021	Goldman Sachs International	1	23	0,00
62.600 €	21.952.869 HUF	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	287	0,00
55 €	250 PLN	30/09/2021	HSBC Bank Plc	1	0	0,00
62.860 €	21.952.892 HUF	15/09/2021	HSBC Bank Plc	1	595	0,00
123.335 €	555.492 PLN	07/07/2021	HSBC Bank Plc	1	360	0,00
118.842 €	3.025.089 CZK	15/09/2021	Morgan Stanley	3	591	0,00
21.517.095 HUF	60.366 €	15/09/2021	Citibank NA	1	897	0,00
27.600.317 HUF	77.563 €	15/09/2021	HSBC Bank Plc	1	996	0,00
411.818.846 IDR	28.044 USD	27/07/2021	BNP Paribas	1	202	0,00
4.428.963 INR	58.792 USD	09/07/2021	HSBC Bank Plc	1	741	0,00
237.689.684 KRW	209.640 USD	27/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	643	0,00
6.627.501 KZT	15.230 USD	24/09/2021	Goldman Sachs International	1	21	0,00
3.120.314 KZT	7.236 USD	14/07/2021	Goldman Sachs International	1	55	0,00
3.378.120 KZT	7.846 USD	14/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	46	0,00
9.984.654 KZT	22.945 USD	24/09/2021	Morgan Stanley	1	32	0,00
1.474.370 MXN	72.897 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	442	0,00
4.384.045 MXN	214.182 USD	27/09/2021	Citibank NA	1	3.528	0,01
3.723.017 MXN	185.332 USD	23/07/2021	Goldman Sachs International	1	1.165	0,00
234.418 PEN	60.349 USD	16/07/2021	Goldman Sachs International	1	889	0,00
106.827 PEN	27.891 USD	16/07/2021	HSBC Bank Plc	1	16	0,00
148.241 PHP	3.006 USD	10/09/2021	Morgan Stanley	1	12	0,00

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,62% (31 de diciembre de 2020: 0,67%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
362.035 PLN	78.978 €	06/07/2021	BNP Paribas	1	1.432	0,01
621.699 PLN	135.321 €	06/07/2021	Citibank NA	3	2.818	0,01
234.710 PLN	51.908 €	07/07/2021	Citibank NA	1	90	0,00
1.230.693 PLN	269.132 €	06/07/2021	Goldman Sachs International	3	4.089	0,01
1.930.378 PLN	426.639 €	15/09/2021	Goldman Sachs International	2	427	0,00
493.245 PLN	108.268 €	06/07/2021	HSBC Bank Plc	1	1.160	0,00
493.245 PLN	108.483 €	07/07/2021	HSBC Bank Plc	1	903	0,00
70.251 PLN	15.456 €	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	123	0,00
334.202 PLN	73.925 €	02/07/2021	Morgan Stanley	1	118	0,00
942.569 PLN	205.445 €	06/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	4	3.937	0,01
139.686 RON	28.001 €	06/10/2021	Citibank NA	1	230	0,00
578.566 RON	116.277 €	06/10/2021	Goldman Sachs International	2	597	0,00
678.141 RON	136.283 €	06/10/2021	JPMorgan Chase Bank	4	708	0,00
2.198.920 RUB	29.425 USD	16/07/2021	BNP Paribas	1	618	0,00
1.336.048 RUB	17.604 USD	16/07/2021	Citibank NA	1	649	0,00
6.289.822 RUB	81.617 USD	16/07/2021	Goldman Sachs International	2	4.318	0,01
4.688.316 RUB	61.422 USD	16/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	2.632	0,01
32.625.912 RUB	421.134 USD	16/07/2021	Morgan Stanley	1	24.616	0,06
1.509.446 RUB	20.365 USD	16/07/2021	Standard Chartered Bank	1	258	0,00
259.943 USD	8.266.731 THB	01/07/2021	Barclays Bank Plc	1	2.011	0,01
14.800 USD	12.383 €	06/07/2021	Barclays Bank Plc	1	114	0,00
26.350 USD	379.445.060 IDR	27/07/2021	BNP Paribas	1	324	0,00
255.660 USD	211.316 €	04/08/2021	Citibank NA	1	4.886	0,01
309.362 USD	22.615.284 RUB	16/07/2021	Citibank NA	2	382	0,00
88.885 USD	99.442.377 KRW	19/07/2021	Citibank NA	1	886	0,00
188.617 USD	3.723.017 MXN	23/07/2021	Citibank NA	1	2.120	0,01
82.240 USD	2.577.762 THB	01/07/2021	Citibank NA	1	1.810	0,01
147.851 USD	123.566 €	06/07/2021	Citibank NA	1	1.302	0,00
44.577 USD	284.250 CNY	02/07/2021	Citibank NA	1	581	0,00
73.288 USD	2.040.269 TWD	26/07/2021	Goldman Sachs International	1	56	0,00
47.148 USD	153.144 ILS	10/09/2021	Goldman Sachs International	1	112	0,00
74.422 USD	2.062.377 TWD	21/07/2021	Goldman Sachs International	1	428	0,00
17.258 USD	14.489 €	06/07/2021	Goldman Sachs International	1	73	0,00
128.794 USD	1.859.211.068 IDR	19/08/2021	HSBC Bank Plc	2	1.661	0,01
124.871 USD	167.142 SGD	12/07/2021	HSBC Bank Plc	1	531	0,00
72.956 USD	2.024.008 TWD	09/07/2021	HSBC Bank Plc	1	413	0,00

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,62% (31 de diciembre de 2020: 0,67%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
66.618 USD	55.759 €	06/07/2021	HSBC Bank Plc	2	489	0,00
28.715 USD	183.768 CNY	09/07/2021	HSBC Bank Plc	1	287	0,00
58.136 USD	240.798 MYR	03/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	317	0,00
14.859 USD	212.225.430 IDR	27/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	302	0,00
954.421 USD	801.242 €	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	2	4.147	0,01
59.206 USD	1.175.165 MXN	02/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	184	0,00
21.459 USD	17.962 €	06/07/2021	Morgan Stanley	1	156	0,00
112.300 USD	1.616.934.200 IDR	19/08/2021	Standard Chartered Bank	2	1.732	0,01
3.921.279 USD	3.255.091 €	04/08/2021	Standard Chartered Bank	1	58.375	0,14
2.680.755 USD	2.195.206 €	06/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	3	77.239	0,19
203.127 USD	729.326.012 COP	23/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	8.012	0,02
171.713 USD	143.507 €	04/08/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	1.409	0,00
Clases NOK con cobertura						
33.300 NOK	3.868 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	3	0,00
4.471 USD	37.171 NOK	19/07/2021	Citibank NA	5	152	0,00
11 USD	91 NOK	15/09/2021	Citibank NA	1	0	0,00
49.100 USD	404.217 NOK	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	2.122	0,00
388.633 USD	3.222.234 NOK	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	14.066	0,03
90.794 USD	761.357 NOK	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	3	2.310	0,01
3.382 USD	28.620 NOK	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	55	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					259.524	0,62

Contratos de futuros 0,40% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(3)	90-Day Eurodollar Future December 2023	750	0,00
(2)	South Korea 10-Year Bond Future September 2021	107	0,00
7	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2021	4.108	0,01
(1)	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2021	454	0,00
4	US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2021	18.531	0,05
18	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2021	140.846	0,34
Plusvalía latente total sobre contratos de futuros ±		164.796	0,40

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de swap de tipos de interés 0,03% (31 de diciembre de 2020: 0,06%)

Importe nocional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/ (Pagar)#	Tipo fijo	Tipo variable	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto	
CZK	7.318.560	19/02/2026	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,35%	6M PRIBOR	8.611	0,02
CLP	6.474.990	05/06/2030	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	2,33%	1D CLICP	1.253	0,01
PLN	292.417	18/05/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	1,91%	6M WIBOR	1.123	0,00
CLP	44.018.437	12/07/2022	JPMorgan Chase Bank	(Pagar)	3,37%	1D CLICP	980	0,00
CZK	2.894.110	13/05/2026	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,81%	6M PRIBOR	582	0,00
	100.000.000	21/06/2029	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	5,37%	1D COOVIBR	489	0,00
CZK	1.519.001	13/05/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	1,88%	6M PRIBOR	291	0,00
	35.469.000	11/03/2030	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	5,47%	1D COOVIBR	163	0,00
PLN	2.845.929	02/07/2023	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	1,17%	3M WIBOR	55	0,00
KRW	108.000.000	19/02/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,50%	3M KORIBOR	2	0,00
KRW	108.000.000	05/02/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,40%	3M KORIBOR	0	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de swap de tipos de interés^o						13.549	0,03	

Recibir – El Fondo recibe un tipo variable y paga un tipo fijo.

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

¹Swap liquidada centralmente.

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	39.026.928	93,92

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (1,89%) (31 de diciembre de 2020: (0,58%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
218.802.475 CLP	304.780 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(4.885)	(0,01)
53.555.634 CLP	74.825 USD	15/09/2021	HSBC Bank Plc	1	(1.420)	(0,00)
284.716 CNY	44.451 USD	02/07/2021	Citibank NA	1	(383)	(0,00)
342.041 CNY	53.000 USD	09/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(88)	(0,00)
323.085.665 COP	89.632 USD	15/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(3.474)	(0,01)
729.326.012 COP	197.382 USD	23/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(2.267)	(0,01)
3.054.952 CZK	119.993 €	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(571)	(0,00)
49.670 €	59.094 USD	06/07/2021	Barclays Bank Plc	1	(185)	(0,00)
24.846 €	29.600 USD	06/07/2021	BNP Paribas	1	(132)	(0,00)
44.715 €	206.337 PLN	06/07/2021	Citibank NA	1	(1.169)	(0,00)
388.776 €	1.764.854 PLN	06/07/2021	Goldman Sachs International	3	(2.505)	(0,01)
189.609 €	856.278 PLN	07/07/2021	Goldman Sachs International	1	(49)	(0,00)

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (1,89%) (31 de diciembre de 2020: (0,58%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
9.213 €	10.959 USD	06/07/2021	Goldman Sachs International	1	(33)	(0,00)
361.186 €	1.647.068 PLN	06/07/2021	HSBC Bank Plc	5	(4.286)	(0,01)
49.670 €	59.151 USD	06/07/2021	HSBC Bank Plc	1	(242)	(0,00)
783.507 €	933.357 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(3.549)	(0,01)
215.661 €	260.550 USD	06/07/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(4.776)	(0,01)
21.971 €	102.233 PLN	06/07/2021	Morgan Stanley	1	(797)	(0,00)
103.536 €	124.213 USD	06/10/2021	Standard Chartered Bank	1	(1.176)	(0,00)
90.287 €	110.325 USD	06/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(3.244)	(0,01)
721.775 €	883.592 USD	06/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(27.567)	(0,07)
176.130 €	211.079 USD	27/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(1.819)	(0,01)
72.371.342 HUF	207.047 €	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(1.746)	(0,01)
386.820.244 IDR	26.841 USD	19/08/2021	BNP Paribas	1	(390)	(0,00)
1.157.103.084 IDR	80.648 USD	27/07/2021	BNP Paribas	2	(1.283)	(0,00)
427.249.416 IDR	29.299 USD	19/08/2021	HSBC Bank Plc	1	(84)	(0,00)
1.333.162.257 IDR	92.677 USD	27/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(1.237)	(0,00)
99.565 ILS	30.690 USD	10/09/2021	Standard Chartered Bank	1	(110)	(0,00)
1.312.938 INR	17.931 USD	09/07/2021	Citibank NA	1	(283)	(0,00)
8.792.458 INR	118.824 USD	16/09/2021	Citibank NA	1	(1.656)	(0,00)
139.872.388 KRW	125.925 USD	09/07/2021	Citibank NA	1	(2.142)	(0,01)
18.144.615 KRW	16.250 USD	19/07/2021	HSBC Bank Plc	1	(193)	(0,00)
86.024.019 KRW	77.103 USD	16/07/2021	HSBC Bank Plc	2	(976)	(0,00)
254.339.090 KRW	225.206 USD	21/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(136)	(0,00)
29.826.084 KZT	69.728 USD	14/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(43)	(0,00)
1.599.087 MXN	79.729 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(186)	(0,00)
1.614.954 MXN	80.701 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(369)	(0,00)
297.428 MXN	14.799 USD	15/09/2021	HSBC Bank Plc	1	(4)	(0,00)
1.149.934 MYR	278.472 USD	04/08/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(2.072)	(0,01)
356.757 MYR	86.117 USD	03/09/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(455)	(0,00)
183.476 MYR	44.514 USD	04/08/2021	Standard Chartered Bank	1	(413)	(0,00)
888.805 MYR	215.631 USD	15/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(1.794)	(0,01)
245.741 PEN	65.244 USD	16/07/2021	Citibank NA	1	(1.048)	(0,00)
212.139 PEN	58.833 USD	16/07/2021	Goldman Sachs International	1	(3.416)	(0,01)
3.595.190 PHP	73.521 USD	26/07/2021	HSBC Bank Plc	1	(65)	(0,00)
3.596.244 PHP	73.648 USD	26/07/2021	Morgan Stanley	1	(170)	(0,00)
758.041 PHP	15.708 USD	10/09/2021	Standard Chartered Bank	1	(272)	(0,00)
535.110 PLN	119.783 €	07/07/2021	Citibank NA	1	(1.501)	(0,00)

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (1,89%) (31 de diciembre de 2020: (0,58%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
307.796 PLN	68.596 €	07/07/2021	Goldman Sachs International	1	(504)	(0,00)
1.284.435 PLN	287.301 €	30/09/2021	Goldman Sachs International	1	(3.885)	(0,01)
402.934 PLN	90.244 €	07/07/2021	Morgan Stanley	1	(1.188)	(0,00)
190.818 PLN	42.388 €	30/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(228)	(0,00)
178.602 RON	36.057 €	06/10/2021	Goldman Sachs International	1	(9)	(0,00)
596.610 RON	117.721 €	30/06/2022	HSBC Bank Plc	1	(18)	(0,00)
166.342 SGD	125.658 USD	12/07/2021	Goldman Sachs International	1	(1.913)	(0,01)
8.266.731 THB	259.387 USD	29/09/2021	Barclays Bank Plc	1	(1.550)	(0,00)
3.202.589 THB	102.779 USD	01/07/2021	Citibank NA	1	(2.854)	(0,01)
1.123.065 THB	35.961 USD	01/07/2021	Goldman Sachs International	1	(920)	(0,00)
3.279.818 THB	102.912 USD	01/07/2021	HSBC Bank Plc	1	(578)	(0,00)
3.239.021 THB	102.170 USD	01/07/2021	Standard Chartered Bank	2	(1.109)	(0,00)
1.852.418 TWD	67.123 USD	09/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(730)	(0,00)
81.581 USD	6.201.044 RUB	16/07/2021	Citibank NA	1	(3.141)	(0,01)
157.657 USD	2.321.685.541 IDR	27/07/2021	Citibank NA	1	(1.586)	(0,00)
73.760 USD	99.174 SGD	26/07/2021	Goldman Sachs International	1	(15)	(0,00)
56.496 USD	1.177.292 MXN	15/09/2021	Goldman Sachs International	1	(2.065)	(0,01)
14.674 USD	472.255 THB	29/09/2021	Goldman Sachs International	1	(55)	(0,00)
39.360 USD	2.891.962 RUB	16/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(152)	(0,00)
74.245 USD	479.945 CNY	02/07/2021	Morgan Stanley	1	(40)	(0,00)
73.208 USD	2.040.269 TWD	26/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(24)	(0,00)
73.667 USD	99.175 SGD	26/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(109)	(0,00)
61.891 USD	4.710.683 INR	09/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(1.428)	(0,00)
1.011.644 USD	20.385.243 MXN	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(2.371)	(0,01)
26.417 USD	1.954.589 RUB	16/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(287)	(0,00)
Clases AUD con cobertura						
131.472 AUD	101.726 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(3.015)	(0,00)
16.376.438 AUD	12.714.326 USD	15/09/2021	BNP Paribas	1	(415.742)	(1,00)
155.635 AUD	117.258 USD	15/09/2021	Citibank NA	1	(378)	(0,00)
139.466 AUD	108.001 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(3.288)	(0,01)
Clases NOK con cobertura						
4.010.613 NOK	482.857 USD	19/07/2021	Citibank NA	10	(16.748)	(0,04)
494.899 NOK	57.811 USD	15/09/2021	Citibank NA	5	(282)	(0,00)
892.130 NOK	106.817 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	(3.135)	(0,01)
32.269.105 NOK	3.887.996 USD	15/09/2021	Goldman Sachs International	3	(136.895)	(0,33)
23.184.895 NOK	2.777.283 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	16	(82.756)	(0,20)

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (1,89%) (31 de diciembre de 2020: (0,58%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
NOK Hedged Classes (continued)						
3.257.436 NOK	390.195 USD	15/09/2021	State Street Bank and Trust and Co	5	(11.535)	(0,03)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					(787.194)	(1,89)

Contratos de futuros (0,15%) (31 de diciembre de 2020: (0,14%))

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(6)	Euro-BOBL Future September 2021	(1.210)	(0,00)
(20)	Euro-Bund Future September 2021	(27.715)	(0,07)
(6)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2021	(25.189)	(0,06)
2	Euro-Schatz Future September 2021	(35)	(0,00)
(5)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2021	(1.796)	(0,00)
9	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future September 2021	(3.414)	(0,01)
13	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2021	(3.758)	(0,01)
Minusvalía latente total sobre contratos de futuros ±		(63.117)	(0,15)

Contratos de swaps de tipos de interés (0,15%) (31 de diciembre de 2020: (0,24%))

Importe notional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar)#	Tipo fijo	Tipo variable	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto	
CNY	1.000.000	01/07/2026	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	2,78%	7D CNRR007	(2)	(0,00)
THB	3.500.000	01/03/2026	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,00%	6M BKIBOR	(9)	(0,00)
THB	3.500.000	10/03/2026	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,10%	6M BKIBOR	(25)	(0,00)
PLN	642.924	02/07/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	2,12%	6M WIBOR	(107)	(0,00)
COP	29.484.935	15/05/2029	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	5,93%	1D COOVIBR	(151)	(0,00)
COP	50.515.065	15/05/2029	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	5,92%	1D COOVIBR	(245)	(0,00)
CZK	3.581.654	19/02/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	1,73%	6M PRIBOR	(306)	(0,00)
CLP	58.692.267	12/12/2021	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	1,96%	1D CLICP	(310)	(0,00)
MXN	878.329	13/04/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,55%	28D MXIBTIE	(334)	(0,00)
COP	117.823.720	03/04/2029	Chicago Mercantile Exchange ¹	Recibir	5,81%	1D COOVIBR	(383)	(0,00)
CZK	570.000	12/11/2030	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	1,40%	6M PRIBOR	(458)	(0,00)
CZK	569.812	13/11/2030	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	1,38%	6M PRIBOR	(475)	(0,00)
CLP	6.936.353	12/01/2026	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	1,63%	1D CLICP	(699)	(0,00)
MXN	1.387.492	22/11/2023	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,01%	28D MXIBTIE	(1.067)	(0,00)
MXN	1.299.503	27/05/2031	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	6,69%	28D MXIBTIE	(1.464)	(0,00)
MXN	3.221.901	19/06/2024	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,47%	28D MXIBTIE	(1.865)	(0,00)
CLP	17.013.289	09/11/2025	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	1,24%	1D CLICP	(1.998)	(0,01)
MXN	1.386.679	06/04/2026	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,82%	28D MXIBTIE	(2.183)	(0,01)
CLP	47.475.919	12/04/2026	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	2,48%	1D CLICP	(2.709)	(0,01)

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de swap de tipos de interés (0,15%) (31 de diciembre de 2020: (0,24%)) (cont.)

	Importe notional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/ (Pagar)#	Tipo fijo	Tipo variable	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
CLP	39.183.166	17/06/2025	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	1,36%	1D CLICP	(3.718)	(0,01)
RUB	13.002.084	14/01/2023	Goldman Sachs International	(Pagar)	5,50%	3M MOSPRIME	(3.781)	(0,01)
RUB	11.030.102	04/08/2022	Goldman Sachs International	(Pagar)	4,79%	3M MOSPRIME	(4.090)	(0,01)
CLP	39.366.311	23/06/2025	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	1,16%	1D CLICP	(4.176)	(0,01)
CLP	84.951.903	16/03/2026	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	2,26%	1D CLICP	(5.820)	(0,01)
RUB	50.000.000	21/03/2023	Goldman Sachs International	(Pagar)	6,72%	3M MOSPRIME	(6.511)	(0,02)
MXN	9.321.661	22/02/2024	Chicago Mercantile Exchange ¹	(Pagar)	5,15%	28D MXIBTIIE	(6.611)	(0,02)
RUB	55.690.792	18/02/2023	Goldman Sachs International	(Pagar)	6,14%	3M MOSPRIME	(11.500)	(0,03)
Minusvalía latente total sobre contratos de swap de tipos de interés ∞							(60.997)	(0,15)

Recibir – El Fondo recibe un tipo variable y paga un tipo fijo.

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

¹Swap liquidada centralmente.

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(911.308)	(2,19)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	38.115.620	91,73
Otro activo neto	3.436.072	8,27
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	41.551.692	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	33.635.109	77,16
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	4.953.950	11,36
± Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	101.679	0,23
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(575.118)	(1,32)
Total inversiones	38.115.620	87,43

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
760.000	Colombia Government International Bond, 6.13%, 18/01/2041	936.031
520.000	Peruvian Government International Bond, 8.75%, 21/11/2033	806.978
151.380.000	Mexico Cetes, 0.00%, 29/07/2021	740.477
630.000	Colombia Government International Bond, 4.50%, 15/03/2029	698.749
500.000	Kazakhstan Government International Bond, 2.38%, 09/11/2028	676.595
600.000	Bermuda Government International Bond, 3.72%, 25/01/2027	663.330
540.000	Mexico Government International Bond, 5.75%, 12/10/2110	626.112
400.000	Panama Government International Bond, 9.38%, 01/04/2029	603.460
350.000	Peruvian Government International Bond, 8.75%, 21/11/2033	575.400
450.000	Indonesia Government International Bond, 0.90%, 14/02/2027	550.468
400.000	Romanian Government International Bond, 3.38%, 08/02/2038	547.222
400.000	Qatar Government International Bond, 5.10%, 23/04/2048	527.312
7.400.000.000	Indonesia Treasury Bond, 5.50%, 15/04/2026	513.494
400.000	Croatia Government International Bond, 1.13%, 19/06/2029	502.153
400.000	Indonesia Government International Bond, 1.40%, 30/10/2031	495.676
400.000	Indonesia Government International Bond, 5.25%, 17/01/2042	492.500
39.057.000	Russian Federal Bond - OFZ, 4.50%, 16/07/2025	491.542
310.000	Romanian Government International Bond, 4.63%, 03/04/2049	489.981
300.000	Indonesia Government International Bond, 8.50%, 12/10/2035	486.470
400.000	Uruguay Government International Bond, 4.38%, 23/01/2031	469.778
400.000	Qatar Government International Bond, 4.00%, 14/03/2029	460.686
400.000	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA, 3.65%, 07/05/2030	444.390
88.142.100	Mexico Cetes, 0.00%, 01/07/2021	433.373
2.800.000	China Government Bond, 3.02%, 22/10/2025	431.647
400.000	Corp Nacional del Cobre de Chile, 3.15%, 14/01/2030	425.660
5.750.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.50%, 15/02/2031	405.703
400.000	CCBL Cayman 1 Corp Ltd, 1.99%, 21/07/2025	404.602
2.600.000	China Government Bond, 3.27%, 19/11/2030	401.635
1.276.984	Bank of Israel Bill – Makam, 0.00%, 02/06/2021	385.882
2.440.000	China Government Bond, 3.28%, 03/12/2027	377.491
5.000.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.50%, 15/06/2025	372.325
300.000	Philippine Government International Bond, 0.70%, 03/02/2029	363.502
300.000	Kazakhstan Government International Bond, 1.50%, 30/09/2034	359.583
25.822.000	Russian Federal Bond - OFZ, 7.25%, 10/05/2034	359.459
359.000	Korea Resources Corp, 1.75%, 15/04/2026	357.241

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas (cont.)

20 ventas de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
1.400.000	China Government Bond, 3.27%, 19/11/2030	215.504
200.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd, 4.50%, 29/05/2029	215.466
200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd, 4.38%, 03/07/2029	206.640
200.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd, 4.50%, 29/12/2049	203.300
12.558.000	Russian Federal Bond - OFZ, 7.25%, 10/05/2034	174.221
11.854.000	Russian Federal Bond - OFZ, 6.90%, 23/05/2029	161.936
2.200.000.000	Indonesia Treasury Bond, 7.50%, 15/04/2040	158.420
514.000	Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2027	148.728
1.850.000	Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029	101.487
1.200.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.50%, 15/02/2031	82.051
1.460.000	Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031	80.997
1.790.000	Czech Republic Government Bond, 1.20%, 13/03/2031	79.712
24.700.000	Hungary Government Bond, 2.25%, 20/04/2033	79.421
1.030.000.000	Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/09/2030	72.562
265.000	Malaysia Government Bond, 3.89%, 15/08/2029	67.906
17.320.000	Hungary Government Bond, 3.25%, 22/10/2031	64.422
218.000	Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2026	62.181
1.790.000	Thailand Government Bond, 1.59%, 17/12/2035	54.431
1.170.000	Czech Republic Government Bond, 0.95%, 15/05/2030	51.151
300.000	China Government Bond, 3.02%, 22/10/2025	46.136

Neuberger Berman Emerging Markets Sustainable Equity Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 6,27%. En el mismo período, el índice de referencia, el MSCI Emerging Markets Index (Total Return, Net of Tax, USD) (el "Índice"), registró una rentabilidad del 7,45%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

La renta variable de mercados emergentes ("ME") avanzó durante el periodo analizado, favorecida por la recuperación de la economía mundial. Sin embargo, la renta variable de ME se situó a la zaga de su homóloga de mercados desarrollados, debido sobre todo al impacto de variantes nuevas y más contagiosas de la COVID-19 en determinados países, así como a los cambios de reglamentación y a los posibles giros políticos en China. Las acciones de momentum continuaron dominando en los ME durante el periodo, tal y como venían haciendo desde marzo de 2020.

Por sectores, destacaron los de materiales, industria y energía, como resultado de la apuesta de los inversores por los valores cíclicos durante la reapertura de las economías. En el caso de la energía, el aumento previsto de la demanda concurre con la decisión de la Organización de Países Exportadores de Petróleo ("OPEP+") de no aumentar la oferta. El sector inmobiliario retrocedió ligeramente a consecuencia de la preocupación por los cambios de política de China, y los sectores de consumo básico y discrecional también se situaron a la zaga, en el caso de este último con varios cambios de política que afectaron a Internet.

Por países, las economías impulsadas por el petróleo de Arabia Saudí y los Emiratos Árabes Unidos se anotaron los mejores resultados del periodo, seguidas de la República Checa. Turquía, Colombia y Perú fueron los que más retrocedieron.

Las valoraciones constituyen una parte importante de nuestra estrategia a largo plazo. Pese a que este planteamiento de inversión de eficacia probada se enfrentó a una tendencia desfavorable dada la actual dinámica del mercado, la selección de valores benefició relativamente a la cartera en su conjunto, en especial dentro de los sectores de atención sanitaria, suministros públicos y servicios de comunicaciones. La Cartera fue a la zaga del Índice en los sectores de consumo básico, industrial y de tecnología de la información.

Por países, las posiciones de la Cartera en la India y China, así como una inversión en Kazajistán —ausente en el Índice— fueron las que más contribuyeron a la rentabilidad relativa, mientras que las posiciones en Brasil y Corea y nuestra sobreponderación en Polonia lastraron los resultados.

El equipo, que aplica un enfoque bottom-up, sigue centrado en la rentabilidad y las tendencias del flujo de efectivo a más largo plazo de las empresas en Cartera. China representa en estos momentos nuestra principal infraponderación, tras la revisión y venta de varias posiciones que habían generado una rentabilidad inferior. La India sigue representando nuestra principal sobreponderación, después de que el equipo consolidase algunas posiciones pequeñas en empresas de alta convicción y recortase la exposición a aquellas que se habían aproximado a sus objetivos de precios.

El consumo discrecional sigue siendo nuestra mayor infraponderación, y el consumo básico nuestra mayor sobreponderación distribuida entre los minoristas repartidos en diversas geografías.

De cara al futuro, prevemos que el ruido que ha persistido durante todo este periodo en los ME —reaperturas y repuntes relacionados con la COVID-19, temor a la inflación, tipos de interés del dólar estadounidense y cambios de política del gobierno chino— continuará. Esta incertidumbre ha llevado a los inversores a apostar por las acciones de momentum y, en particular en los mercados asiáticos, por las inversiones temáticas.

Sin embargo, el liderazgo tanto en materia temática (las empresas del sector de la automoción chinas sustituyeron a los títulos de Internet, por ejemplo) como por lo que respecta a las acciones de momentum ha cambiado rápidamente en los últimos meses. Teniendo en cuenta las valoraciones, estas áreas parecen especulativas y posiblemente predisuestas a experimentar una corrección.

Nuestro equipo, en lugar de centrarse en las fluctuaciones de precios a corto plazo y en los titulares sobre acontecimientos recientes, continúa elaborando sus planes a más largo plazo, al considerar que el crecimiento positivo en todo el mundo promueve un aumento de la rentabilidad de los ME a medio plazo.

A pesar de los obstáculos relativos a corto plazo, el equipo sigue creyendo que nuestra exposición diversificada, que apuesta por empresas domésticas junto con proveedores de tecnología diferenciados al servicio de los consumidores de todo el mundo, puede ofrecer una fuerte rentabilidad ajustada por riesgo a largo plazo y ayudar a los inversores a afrontar cualquier ruido a corto plazo que pueda surgir.

Neuberger Berman Emerging Markets Sustainable Equity Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		139.990.574	152.492.008
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	7.345.796	5.612.457
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		277.915	–
Cuentas a percibir por acciones emitidas		1.782	–
Ingresos a percibir y otros activos		233.019	320.085
Activos totales		147.849.086	158.424.550
Pasivo circulante			
Gastos devengados		137.445	139.848
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		71.013	–
Otras cuentas por pagar		218.864	41.057
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		427.322	180.905
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		147.421.764	158.243.645

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Emerging Markets Sustainable Equity Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		181	10.519
Ingresos por dividendos		1.304.418	1.171.159
Ingresos por préstamo de valores	15	–	2.757
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		9.059.880	(11.934.619)
		10.364.479	(10.750.184)
Gastos			
Comisión de gestión	5	647.180	468.379
Comisión de distribución	5	–	126
Comisión de administración	5	62.827	62.096
Comisión de compromiso	16	10.024	1.907
Comisión de depósito	5	31.324	24.168
Comisión del Depositario	5	4.006	2.973
Honorarios profesionales	7	62.379	23.826
Honorarios de los Consejeros	6	1.929	2.069
Costes de transacciones	7	191.200	148.224
Honorarios de auditoría	7	8.239	7.012
Reembolso de IVA		(760)	(404)
Otros gastos	7	9.965	9.786
Gastos totales		1.028.313	750.162
Costes financieros			
Gastos por intereses		–	164
Repartos de dividendos abonados	1	153	257
		153	421
Impuestos retenidos en origen		157.541	108.007
Impuesto sobre las plusvalías		(51.909)	(138.567)
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		9.230.381	(11.470.207)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Emerging Markets Sustainable Equity Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	158.243.645	129.864.482
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	9.230.381	(11.470.207)
Suscripciones	3.187.112	15.437.878
Reembolsos	(23.239.374)	(10.973.761)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	147.421.764	122.858.392

Neuberger Berman Emerging Markets Sustainable Equity Fund (cont.)

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 92,00% (31 de diciembre de 2020: 90,57%)			
Real brasileño			
519.983	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao*	1.743.000	1,18
179.460	Banco Bradesco SA - Preferred Shares*	920.216	0,62
437.234	CSN Mineracao SA*	798.163	0,54
130.799	Energisa SA*	1.214.710	0,82
32.187	Natura & Co Holding SA*	363.959	0,25
34.845	Petrobras Distribuidora SA*	185.272	0,13
	Total real brasileño	5.225.320	3,54
Yuan renminbi chino			
588.998	Beijing Sinnet Technology Co Ltd Class A*	1.311.852	0,89
38.700	Fujian Green Pine Co Ltd Class A*	126.387	0,09
1.050.086	Jiangsu Changshu Rural Commercial Bank Co Ltd Class A*	1.007.690	0,68
4.700	Kweichow Moutai Co Ltd Class A*	1.496.164	1,02
22.038	NARI Technology Co Ltd Class A*	79.272	0,05
233.800	Ping An Insurance Group Co of China Ltd Class A*	2.326.113	1,58
83.500	Riyue Heavy Industry Co Ltd Class A*	349.982	0,24
263.846	Xianhe Co Ltd Class A*	1.551.831	1,05
192.360	Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd Class A*	1.669.977	1,13
	Total yuan renminbi chino	9.919.268	6,73
Euro			
59.459	InPost SA*	1.193.493	0,81
	Total euro	1.193.493	0,81
Dólar de Hong Kong			
296.420	Alibaba Group Holding Ltd*	8.397.329	5,70
439.412	A-Living Smart City Services Co Ltd*	2.186.917	1,48
66.500	ASM Pacific Technology Ltd*	900.841	0,61
192.000	China Conch Venture Holdings Ltd*	808.463	0,55
791.000	China Longyuan Power Group Corp Ltd - H Shares*	1.362.836	0,92
293.500	China Merchants Bank Co Ltd - H Shares*	2.503.831	1,70
174.000	China Resources Gas Group Ltd*	1.044.110	0,71
87.750	JD.com Inc Class A*	3.450.859	2,34
32.100	Kuaishou Technology Class B*	805.202	0,55
208.500	Longfor Group Holdings Ltd*	1.167.902	0,79
132.100	Tencent Holdings Ltd*	9.934.057	6,74
140.888	Tsingtao Brewery Co Ltd - H Shares*	1.516.671	1,03
	Total dólar de Hong Kong	34.079.018	23,12

Neuberger Berman Emerging Markets Sustainable Equity Fund (cont.)

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 92,00% (31 de diciembre de 2020: 90,57%) (cont.)			
Forint húngaro			
86.723	MOL Hungarian Oil & Gas Plc*	690.847	0,47
29.651	OTP Bank Nyrt*	1.598.233	1,08
	Total forint húngaro	2.289.080	1,55
Rupia india			
55.367	ACC Ltd*	1.500.786	1,02
49.077	AU Small Finance Bank Ltd*	683.929	0,46
48.588	Housing Development Finance Corp Ltd*	1.619.622	1,10
98.016	Reliance Industries Ltd*	1.959.858	1,33
103.436	State Bank of India*	583.350	0,40
	Total rupia india	6.347.545	4,31
Rupia indonesia			
381.900	Bank Central Asia Tbk PT*	793.430	0,54
	Total rupia indonesia	793.430	0,54
Peso mexicano			
141.081	Fomento Economico Mexicano SAB de CV*	1.194.730	0,81
	Total peso mexicano	1.194.730	0,81
Nuevo dólar taiwanés			
68.000	Accton Technology Corp*	806.604	0,55
67.000	Eclat Textile Co Ltd*	1.577.461	1,07
12.000	Largan Precision Co Ltd*	1.335.128	0,91
25.000	Parade Technologies Ltd*	1.242.710	0,84
76.000	RichWave Technology Corp*	1.321.561	0,90
504.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd*	10.762.853	7,30
225.218	Tong Hsing Electronic Industries Ltd*	1.717.679	1,16
676.000	Uni-President Enterprises Corp*	1.775.978	1,20
	Total nuevo dólar taiwanés	20.539.974	13,93
Zloty polaco			
56.864	Allegro.eu SA*	980.146	0,66
22.668	Dino Polska SA*	1.666.607	1,13
	Total zloty polaco	2.646.753	1,79

Neuberger Berman Emerging Markets Sustainable Equity Fund (cont.)

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 92,00% (31 de diciembre de 2020: 90,57%) (cont.)			
Libra esterlina			
11.582	Rio Tinto Plc*	951.837	0,65
Total libra esterlina		951.837	0,65
Dólar de Singapur			
1.791.520	Thai Beverage PCL*	899.625	0,61
Total dólar de Singapur		899.625	0,61
Rand sudafricano			
72.964	Bid Corp Ltd*	1.582.098	1,07
9.084	Naspers Ltd Class N*	1.907.419	1,30
Total rand sudafricano		3.489.517	2,37
Won de Corea del Sur			
4.682	Korea Petrochemical Ind Co Ltd*	989.492	0,67
2.641	LG Chem Ltd*	1.993.385	1,35
4.876	NAVER Corp*	1.807.690	1,23
2.074	NCSOFT Corp*	1.510.172	1,02
12.287	Orion Corp*	1.292.909	0,88
109.747	Samsung Electronics Co Ltd*	7.864.479	5,34
31.293	SK Hynix Inc*	3.542.918	2,40
2.050	SK IE Technology Co Ltd*	333.126	0,23
5.405	SK Telecom Co Ltd*	1.535.852	1,04
Total won de Corea del Sur		20.870.023	14,16
Baht tailandés			
822.700	Ngern Tid Lor PCL*	1.065.275	0,72
Total baht tailandés		1.065.275	0,72
Dólar estadounidense			
5.161	Credicorp Ltd*	625.049	0,43
8.650	Fabrinet*	829.275	0,56
98.413	Fix Price Group Ltd GDR*	861.114	0,59
264.271	Gazprom PJSC*	1.017.744	0,69
19.403	HDFC Bank Ltd ADR*	1.418.747	0,96
127.519	ICICI Bank Ltd ADR*	2.180.575	1,48
132.430	Infosys Ltd ADR*	2.806.192	1,90
16.699	Kaspi.KZ JSC GDR*	1.770.094	1,20
27.895	LUKOIL PJSC ADR**	2.566.340	1,74

Neuberger Berman Emerging Markets Sustainable Equity Fund (cont.)

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 92,00% (31 de diciembre de 2020: 90,57%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
51.193	Mahindra & Mahindra Ltd GDR**	534.967	0,36
22.428	Momo Inc ADR*	343.373	0,23
25.384	Pagseguro Digital Ltd Class A*	1.419.473	0,96
3.628	Polyus PJSC*	703.463	0,48
182.270	Sberbank of Russia PJSC*	762.700	0,52
42.453	State Bank of India GDR**	2.373.123	1,61
21.388	Trip.com Group Ltd ADR*	758.418	0,52
23.192	X5 Retail Group NV GDR*	813.112	0,55
32.954	Yandex NV Class A*	2.331.495	1,58
Total dólar estadounidense		24.115.254	16,36
Total valores de renta variable		135.620.142	92,00

Número de acciones	Descripción de los valores	Fecha de vencimiento	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Participatory Notes 2,96% (31 de diciembre de 2020: 5,80%)				
Dólar estadounidense				
30.152	Apollo Hospitals Enterprise Ltd	14/09/2021	1.467.703	0,99
140.382	IndusInd Bank Ltd	01/09/2021	1.918.607	1,30
50.601	United Breweries Ltd	24/09/2021	984.122	0,67
Total participatory notes **			4.370.432	2,96
Total inversiones			139.990.574	94,96

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	139.990.574	94,96
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	139.990.574	94,96
Otro activo neto	7.431.190	5,04
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	147.421.764	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	130.145.712	88,02
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	9.844.862	6,66
Total inversiones	139.990.574	94,68

Neuberger Berman Emerging Markets Sustainable Equity Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
298.400	Alibaba Group Holding Ltd	9.441.346
633.600	Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd Class A	7.425.028
2.645.592	Beijing Sinnet Technology Co Ltd Class A	7.308.657
456.816	Reliance Industries Ltd – Partly Paid	7.125.719
8.780	NCSOFT Corp	6.826.032
194.352	Housing Development Finance Corp Ltd	6.710.402
258.000	ACC Ltd	6.203.479
281.180	InPost SA	6.189.088
990.000	Longfor Group Holdings Ltd	5.822.378
676.000	Bharti Airtel International Netherlands BV, 21/01/2022 – Participatory Notes	5.273.179
304.000	RichWave Technology Corp	4.963.519
460.040	Fix Price Group Ltd GDR	4.482.013
1.057.084	Gazprom PJSC	3.950.958
3.290.800	Ngern Tid Lor PCL	3.881.142
2.268.660	CSN Mineracao SA	3.611.570
196.308	AU Small Finance Bank Ltd	2.504.577
11.384	Polyus PJSC	2.281.294
109.212	Bid Corp Ltd	2.185.649
120.548	Allegro.eu SA	2.153.171
296.000	Tong Hsing Electronic Industries Ltd	2.121.214
115.360	Infosys Ltd ADR	2.113.516
133.600	Kuaishou Technology Class B	1.981.467
413.744	State Bank of India	1.910.745
492.000	Xianhe Co Ltd Class A	1.824.418
19.200	Tencent Holdings Ltd	1.668.382
16.400	SK IE Technology Co Ltd	1.546.892
128.748	Natura & Co Holding S.A.	1.483.423
334.000	Riyue Heavy Industry Co Ltd Class A	1.482.167
129.600	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd Class A	1.475.870
30.056	Pagseguro Digital Ltd Class A	1.464.714

Neuberger Berman Emerging Markets Sustainable Equity Fund (cont.)

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
163.592	Samsung Electronics Co Ltd	11.781.255
7.604.000	China Longyuan Power Group Corp Ltd - H Shares	10.799.792
412.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	8.700.263
254.600	JP Morgan Structured Product, 19/04/2021 – Participatory Notes	8.686.832
1.830.720	NARI Technology Co Ltd Class A	8.628.479
156.000	Reliance Industries Ltd GDR	8.546.497
343.688	ACC Ltd, 29/04/2021 – Participatory Notes	7.907.939
91.600	Tencent Holdings Ltd	7.342.026
99.340	Coway Co Ltd	6.207.867
199.200	Alibaba Group Holding Ltd	5.751.461
461.620	IndusInd Bank Ltd, 01/09/2021 – Participatory Notes	5.561.649
38.872	Com2uS Corp	5.537.288
3.741.600	Huatai Securities Co Ltd - H Shares	5.402.966
512.000	Accton Technology Corp	5.389.157
20.764	Naspers Ltd Class N	5.200.275
676.000	Bharti Airtel International Netherlands BV, 21/01/2022 – Participatory Notes	4.891.536
313.208	ICICI Bank Ltd ADR	4.851.948
1.002.792	Banco Bradesco SA - Preferred Shares	4.676.080
556.000	China Merchants Bank Co Ltd - H Shares	4.587.474
3.136.000	Times China Holdings Ltd	4.336.353
54.708	Dino Polska SA	3.861.698
378.840	BIM Birlesik Magazalar AS	3.848.059
3.632.000	3SBio Inc	3.512.716
26.216	Credicorp Ltd	3.492.034
36.812	Rio Tinto Plc	3.199.981
3.868	LG Chem Ltd	3.163.606
536.000	China Resources Gas Group Ltd	3.152.707
68.000	Parade Technologies Ltd	3.089.910
1.547.600	CP ALL PCL	2.860.454
280.000	Tsingtao Brewery Co Ltd - H Shares	2.844.804
36.116	HDFC Bank Ltd ADR	2.784.896
23.100	SK Hynix Inc	2.669.398
1.187.600	Poly Developments & Holdings Group Co Ltd Class A	2.636.623
64.800	JD.com Inc Class A	2.495.778
158.400	ASM Pacific Technology Ltd	2.493.068

Neuberger Berman China Equity Opportunities Fund

Balance

	Nota	A 31 de diciembre de 2020* USD
Activo circulante		
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	43.811
Ingresos a percibir y otros activos		1.552
Activos totales		45.363
Pasivo circulante		
Gastos devengados		18.256
Otras cuentas por pagar		27.107
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		45.363
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		—

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman China Equity Opportunities Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos		
Ingresos por intereses		251
Ingresos por dividendos		15.231
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		2.054
		17.536
Gastos		
Comisión de gestión	5	7.203
Comisión de distribución	5	776
Comisión de administración	5	10.919
Comisión de compromiso	16	65
Comisión de depósito	5	5.975
Comisión del Depositario	5	66
Honorarios profesionales	7	21.406
Honorarios de los Consejeros	6	2.375
Costes de transacciones	7	8.768
Honorarios de auditoría	7	5.984
Reembolso de IVA		(5)
Otros gastos	7	4.271
Gastos no asumidos	5	(56.193)
Gastos totales		11.610
Costes financieros		
Repartos de dividendos abonados	1	7.756
		7.756
Impuestos retenidos en origen		1.018
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		(2.848)

*La Cartera se liquidó el 30 de noviembre de 2020.

Los ingresos y gastos se derivaron exclusivamente de actividades interrumpidas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman China Equity Opportunities Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	1.307.374
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	(2.848)
Suscripciones	181.572
Reembolsos	(105.139)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	1.380.959

*La Cartera se liquidó el 30 de noviembre de 2020.

Neuberger Berman Multi-Asset Growth Fund

Balance

	Nota	A 31 de diciembre de 2020* USD
Activo circulante		
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	9.814
Ingresos a percibir y otros activos		23.833
Activos totales		33.647
Pasivo circulante		
Gastos devengados		8.522
Otras cuentas por pagar		25.125
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		33.647
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		–

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Multi-Asset Growth Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Periodo finalizado el 30 de junio de 2020* USD
Ingresos		
Ingresos por intereses		118.005
Ingresos por dividendos		66.712
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	11	(2.678.614)
		(2.493.897)
Gastos		
Comisión de gestión	5	34.162
Comisión de distribución	5	136
Comisión de administración	5	27.743
Comisión de compromiso	16	2.323
Comisión de depósito	5	7.484
Comisión del Depositario	5	1.293
Honorarios profesionales	7	23.078
Honorarios de los Consejeros	6	1.754
Costes de transacciones	7	64.027
Honorarios de auditoría	7	8.312
Reembolso de IVA		(41)
Otros gastos	7	10.621
Gastos no asumidos	5	(123.953)
Gastos totales		56.939
Costes financieros		
Gastos por intereses		167
Repartos de dividendos abonados	1	312.391
		312.558
Impuestos retenidos en origen		8.731
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		(2.872.125)

*La Cartera se liquidó el 7 de mayo de 2020.

Todos los beneficios y pérdidas proceden exclusivamente de operaciones interrumpidas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Multi-Asset Growth Fund (cont.)

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

	Periodo finalizado el 30 de junio de 2020*
	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	19.627.216
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	(2.872.125)
Reembolsos	5 (16.755.091)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	-

*La Cartera se liquidó el 7 de mayo de 2020.

Neuberger Berman Global Thematic Equity Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el periodo de 6 meses finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 24,14%. En el mismo periodo, el índice de referencia, el MSCI World Index Total Return, Net of Tax, USD (el "Índice"), registró una rentabilidad del 13,05%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Entre las posiciones que más contribuyeron a la rentabilidad superior de la Cartera destacan Criteo (sistemas inteligentes), Inovalon (salud y bienestar) y Charles River Labs (salud y bienestar). Asimismo, siguiendo su enfoque disciplinado de gestión de riesgos, la Cartera evitó invertir en compañías tecnológicas valoradas a precios excesivos, muchas de las cuales se quedaron rezagadas durante el primer semestre de 2021.

El ritmo de los programas de vacunación mundial ha mejorado sustancialmente en los últimos meses, lo cual ha permitido a muchas sociedades empezar a "reabrir" sus negocios y volver a una vida más "normal". Como era de esperar, la actividad económica repuntó con la mayor movilidad, ya que la mayoría de regiones geográficas vacunadas asistieron a una brusca aceleración. El equipo es consciente de que las organizaciones sanitarias mundiales tardarán varios meses en anunciar el fin del trabajo de vacunación y sabe que regiones continúan pasando apuros. No obstante, en el segundo trimestre los mercados de capitales, cautivados por las historias del futuro y vislumbrando la robusta recuperación económica que experimentaron las regiones vacunadas, llegando, en última instancia, a todos los rincones del mundo, continuaron mostrando indicios de la especulación que auguramos ya en abril.

En este entorno cinético, el enfoque disciplinado de gestión de riesgos adoptado por el equipo le llevó inevitablemente a reducir la exposición a varias empresas que cotizan a precios que, en su opinión, ya incorporaban el potencial alcista de los próximos años, lo que implica un perfil de riesgo/rentabilidad que ya no es satisfactorio. Como el equipo suele recordar a los inversores, lo fundamental para invertir a lo largo de los diversos ciclos económicos y bursátiles de los últimos 30 años es (i) invertir en los temas y (ii) empresas adecuados, ya que ambos aumentan la convicción y la paciencia (especialmente en entornos complicados), aunque es igual de importante (iii) invertir a precios razonables con un claro potencial alcista y un margen de seguridad.

Operando de un modo constructivo, el producto generado por las ventas de acciones financió varias inversiones nuevas, lo que refleja un periodo especialmente activo para una estrategia concentrada. El equipo, a pesar de su amplia cautela, se muestra optimista al ver que, aparentemente, todavía existen oportunidades atractivas disponibles incluso en mercados donde abundan los títulos sobrevalorados.

En este sentido, considera que las empresas incluidas en la cartera están bien posicionadas para prosperar a medida que la situación mejore, más aún de lo que puede deducirse de sus respectivos valores de mercado. Durante las próximas semanas examinaremos los resultados del primer semestre con nuestros equipos de gestión y estamos impacientes por conocer sus ideas y percepciones sobre las perspectivas que auguran para el resto del año.

Neuberger Berman Global Thematic Equity Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		52.656.255	27.446.769
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	2.631.973	191.524
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		614	223
Cuentas a percibir por acciones emitidas		966.226	86.786
Ingresos a percibir y otros activos		56.634	57.992
Activos totales		56.311.702	27.783.294
Pasivo circulante			
Descubierto bancario	3	-	1
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		29.935	61.234
Gastos devengados		143.603	103.860
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		833.802	-
Otras cuentas por pagar		26.740	11.847
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		1.034.080	176.942
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		55.277.622	27.606.352

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global Thematic Equity Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		23	1.302
Ingresos por dividendos		188.893	625.534
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		7.653.626	(3.205.569)
		7.842.542	(2.578.733)
Gastos			
Comisión de gestión	5	361.183	205.064
Comisión de distribución	5	84.711	39.087
Comisión de administración	5	36.384	30.368
Comisión de compromiso	16	2.001	1.134
Comisión de depósito	5	5.958	6.002
Comisión del Depositario	5	947	1.069
Honorarios profesionales	7	31.947	25.368
Honorarios de los Consejeros	6	1.172	2.314
Costes de transacciones	7	24.427	10.965
Honorarios de auditoría	7	7.441	6.757
Reembolso de IVA		(134)	(72)
Otros gastos	7	4.026	4.668
Gastos no asumidos	5	(32.948)	(52.108)
Gastos totales		527.115	280.616
Costes financieros			
Gastos por intereses		203	1.797
Repartos de dividendos abonados	1	–	158
		203	1.955
Impuestos retenidos en origen		30.486	171.894
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		7.284.738	(3.033.198)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global Thematic Equity Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	27.606.352	24.484.889
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	7.284.738	(3.033.198)
Suscripciones	27.659.090	8.379.551
Reembolsos	(7.272.558)	(7.280.817)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	55.277.622	22.550.425

Neuberger Berman Global Thematic Equity Fund (cont.)

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 95,26% (31 de diciembre de 2020: 99,41%)			
Dólar canadiense			
211.382	Element Fleet Management Corp	2.468.371	4,46
Total dólar canadiense		2.468.371	4,46
Libra esterlina			
391.970	Pets at Home Group Plc	2.469.181	4,47
Total libra esterlina		2.469.181	4,47
Dólar estadounidense			
14.094	Alibaba Group Holding Ltd ADR	3.196.237	5,78
60.567	Allegheny Technologies Inc	1.262.822	2,28
402	Alphabet Inc Class A	981.599	1,78
31.016	Amdocs Ltd	2.399.398	4,34
6.777	Aon Plc Class A	1.618.076	2,93
3.396	Charles River Laboratories International Inc	1.256.248	2,27
60.289	Corning Inc	2.465.820	4,46
68.498	Criteo SA ADR	3.098.164	5,61
55.260	Delta Air Lines Inc	2.390.548	4,32
116.667	Despegar.com Corp	1.541.171	2,79
10.098	Expedia Group Inc	1.653.144	2,99
75.186	Inovalon Holdings Inc Class A	2.562.339	4,64
15.128	ModivCare Inc	2.572.819	4,65
2.759	Nice Ltd ADR	682.742	1,24
96.078	NortonLifeLock Inc	2.615.243	4,73
238.630	Paya Holdings Inc Class A	2.629.703	4,76
73.830	Perrigo Co Plc	3.385.105	6,12
15.296	Quanta Services Inc	1.385.359	2,51
69.476	Scholastic Corp	2.632.446	4,76
12.475	Stericycle Inc	892.586	1,61
5.708	TE Connectivity Ltd	771.779	1,40
9.215	Tetra Tech Inc	1.124.599	2,03
167.411	Vistra Corp	3.105.474	5,62
21.010	Western Digital Corp	1.495.282	2,71
Total dólar estadounidense		47.718.703	86,33
Total valores de renta variable *		52.656.255	95,26
Total inversiones		52.656.255	95,26

Neuberger Berman Global Thematic Equity Fund (cont.)

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	52.656.255	95,26
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	52.656.255	95,26
Otro activo neto	2.621.367	4,74
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	55.277.622	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	52.656.255	93,51
Total inversiones	52.656.255	93,51

Neuberger Berman Global Thematic Equity Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

Total compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
167.411	Vistra Corp	3.101.311
10.458	Alibaba Group Holding Ltd ADR	2.375.184
211.382	Element Fleet Management Corp	2.193.720
191.049	Paya Holdings Inc Class A	2.102.210
46.064	Perrigo Co Plc	1.948.425
12.921	ModivCare Inc	1.859.155
116.667	Despegar.com Corp	1.465.732
28.827	Delta Air Lines Inc	1.299.419
28.790	Corning Inc	1.178.596
39.549	NortonLifeLock Inc	834.399
148.685	Pets at Home Group Plc	829.749
9.056	Amdocs Ltd	679.493
2.603	Aon Plc Class A	595.826
18.483	Scholastic Corp	553.516
3.183	Tetra Tech Inc	380.846
1.635	Expedia Group Inc	272.752
7.783	Inovalon Holdings Inc Class A	232.559

Neuberger Berman Global Thematic Equity Fund (cont.)

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
292.702	GTT Communications Inc	688.537
21.062	Criteo SA ADR	579.902
19.671	Inovalon Holdings Inc Class A	526.863
17.021	Allegheny Technologies Inc	318.240
876	Charles River Laboratories International Inc	234.389
3.131	Western Digital Corp	169.750
2.390	Amdocs Ltd	167.868
542	Nice Ltd ADR	146.355
5.550	Scholastic Corp	143.386
3.022	Perrigo Co Plc	139.309
6.152	NortonLifeLock Inc	129.371
23.298	Pets at Home Group Plc	126.042
2.877	Delta Air Lines Inc	116.045
810	Expedia Group Inc	113.581
3.016	Corning Inc	112.134
1.465	Quanta Services Inc	109.866
431	Alibaba Group Holding Ltd ADR	100.884
455	Aon Plc Class A	93.940
1.195	Stericycle Inc	83.114
578	Tetra Tech Inc	75.246
547	TE Connectivity Ltd	71.084
39	Alphabet Inc Class A	68.128

Neuberger Berman CLO Income Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 4,65%. En el mismo período, el índice ICE BofA US Dollar 3-month Deposit Offered Rate Constant Maturity (rentabilidad total en USD) (el "Índice") rindió un 0,11%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

El mercado de Obligaciones de Préstamos Garantizados ("CLO"), después del considerable repunte que registró a finales de 2020, continuó su buena racha al inicio de 2021, beneficiándose del potencial ofrecido por los estímulos cada vez mayores del gobierno de Estados Unidos, el avance en la distribución de vacunas y el valor relativo permanentemente atractivo frente a otros activos de renta fija. Este dinamismo se mantuvo hasta mediados de febrero, cuando los diferenciales de CLO sobre la deuda con calificación BB se aproximaron al área L+625, momento en que el mercado comenzó a experimentar la confluencia de un sólido mercado de nuevas emisiones de obligaciones CLO y el comienzo de una oleada récord de operaciones de refinanciación y restablecimiento de CLO con antelación a la próxima fecha de pago de intereses de abril para la mayoría de obligaciones CLO. Esto dio lugar a un modesto deterioro del mercado CLO hasta marzo, cuando los diferenciales de CLO respecto a la deuda con calificación BB se ampliaron en unos 25-50 puntos básicos desde los mínimos registrados a mediados de febrero debido a la considerable oferta del mercado.

Tras esta aceleración de los volúmenes en el mercado primario, el mercado de CLO comenzó a repuntar desde abril hasta mayo al mejorar los ánimos sobre la economía estadounidense después de una distribución de vacunas más rápida de lo esperado, unido a la incesante mejoría asociada de los niveles de negociación de garantías CLO y calidad de la cartera, lo cual compensó con creces la actividad permanentemente alta del mercado primario que había hecho mella en su homólogo CLO. Hacia mayo, los diferenciales CLO respecto a la deuda con calificación BB habían convergido con los niveles de diferenciales compatibles con métricas previas a la COVID, estrechándose en torno al área L+600. En vista de la actividad del mercado primario continuamente alta, el mercado de CLO se mostró resistente y permaneció relativamente plano desde mayo hasta junio de 2021.

En este último mes, la tasa de morosidad de los préstamos ponderada por el valor nominal de los últimos 12 meses se situó en el 1,25%, lo que supone un descenso de 292 puntos básicos respecto al máximo del 4,17% alcanzado en septiembre de 2020. En el año hasta la fecha, el volumen total de nuevas emisiones de CLO, refinanciación y restablecimientos continuó aumentando a ritmo récord hasta 203.000 millones de dólares, lo que contrasta con 56.000 millones de dólares registrados en el mismo periodo de 2020 y 144.000 millones en el año récord anterior de 2018.

Durante el semestre cerrado a 30 de junio de 2021, el fondo registró entradas de capital netas de 23 millones de dólares. A 30 de junio de 2021, los diferenciales de la deuda CLO para emisiones con calificación BB de mayor calidad se situaban en L+625. Incluso en estos niveles más excesivos, el mercado primario de CLO de calidad superior continuó beneficiándose de unos niveles de intereses sólidos, lo que apunta a una fuerte apuesta persistente de un amplio grupo de inversores. El Fondo batió al Índice gracias a las favorables condiciones crediticias y al estrechamiento general de los diferenciales de crédito sin grado de inversión acaecido durante el primer semestre del año.

Desde la perspectiva de los fundamentales, mantenemos nuestra confianza en la importante protección estructural proporcionada frente a las pérdidas crediticias sufridas por nuestra cartera de préstamos subyacentes. Las estructuras CLO en general, y los CLO con calificación BB en particular, han vuelto a demostrar su gran solidez ante una recesión digna de mención. A nuestro juicio, apostar por invertir en las carteras de préstamos subyacentes de máxima calidad nos permitirá obtener una rentabilidad sostenida superior a la del Índice de aquí a varios años.

Neuberger Berman CLO Income Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		124.506.108	103.204.368
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	17.511.752	17.063.520
Ingresos a percibir y otros activos		1.576.138	1.296.749
Activos totales		143.593.998	121.564.637
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		265.169	342.087
Descubierto bancario	3	–	25
Gastos devengados		136.551	126.044
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		1.790.979	5.568.860
Otras cuentas por pagar		56.947	39.532
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		2.249.646	6.076.548
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		141.344.352	115.488.089

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman CLO Income Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		3.912.623	6.137.396
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		2.664.473	(26.381.494)
		6.577.096	(20.244.098)
Gastos			
Comisión de gestión	5	422.986	416.041
Comisión de administración	5	64.001	81.349
Comisión de compromiso	16	9.848	7.251
Comisión de depósito	5	5.955	5.958
Comisión del Depositario	5	3.671	7.677
Honorarios profesionales	7	33.858	31.122
Honorarios de los Consejeros	6	2.413	2.375
Costes de transacciones	7	6.997	8.441
Honorarios de auditoría	7	5.265	8.055
Reembolso de IVA		(640)	(533)
Otros gastos	7	–	7.175
Gastos totales		554.354	574.911
Costes financieros			
Repartos de dividendos abonados	1	2.464.987	4.021.760
		2.464.987	4.021.760
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		3.557.755	(24.840.769)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman CLO Income Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	115.488.089	152.483.625
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	3.557.755	(24.840.769)
Suscripciones	63.744.987	98.738.349
Reembolsos	(41.446.479)	(69.088.002)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	141.344.352	157.293.203

Neuberger Berman CLO Income Fund (cont.)

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
Valores respaldados por activos 87,87% (31 de diciembre de 2020: 87,55%)					
Dólar estadounidense					
1.500.000	Aimco CLO Series 2017-A Series 2017-AX Class FR	8,72%	20/04/2034	1.495.250	1,06
2.000.000	Apidos CLO XX Series 2015-20X Class DR	5,88%	16/07/2031	1.889.979	1,34
2.100.000	Apidos CLO XXIV Series 2016-24X Class DR	5,99%	20/10/2030	1.973.154	1,40
1.000.000	Ares XLIX CLO Ltd Series 2018-49X Class E	5,92%	22/07/2030	979.556	0,69
4.000.000	Ares XXXVII CLO Ltd Series 2015-4X Class DR	6,33%	15/10/2030	3.932.733	2,78
4.000.000	Assurant CLO I Ltd Series 2018-2X Class E	6,34%	20/10/2031	3.938.588	2,79
4.750.000	Atrium XII Series 12X Class DR	2,98%	22/04/2027	4.711.601	3,33
2.825.000	Ballyrock CLO 2018-1 Ltd Series 2018-1X Class D	5,99%	20/04/2031	2.729.663	1,93
1.100.000	Bardot CLO Ltd Series 2019-2X Class E	7,13%	22/10/2032	1.106.961	0,78
2.000.000	Burnham Park CLO Ltd Seires 2016-1X Class ER	5,59%	20/10/2029	1.938.674	1,37
5.000.000	Carlyle Global Market Strategies Series 2014-2RX Class D	5,51%	15/05/2031	4.591.137	3,25
2.000.000	Chenango Park CLO Ltd Series 2018-1X Class D	5,98%	15/04/2030	1.964.785	1,39
6.000.000	Cifc Funding 2018-I Ltd Series 2018-1X Class E	5,19%	18/04/2031	5.707.640	4,04
5.000.000	Dryden 60 CLO Ltd Series 2018-60X Class E	5,78%	15/07/2031	4.956.021	3,51
1.250.000	Eaton Vance CLO 2015-1 Ltd Series 2015-1X Class ER	5,79%	20/01/2030	1.209.839	0,86
2.000.000	Eaton Vance CLO 2018-1 Ltd Series 2018-1X Class E	6,18%	15/10/2030	1.993.912	1,41
1.700.000	Flatiron CLO 17 Ltd Series 2017-1X Class E	6,06%	15/05/2030	1.699.901	1,20
1.050.000	Galaxy XIX CLO Ltd Series 2015-19X Class D1R	6,71%	24/07/2030	1.041.210	0,74
4.000.000	Galaxy XXV CLO Ltd Series 2018-25X Class E	6,13%	25/10/2031	3.941.608	2,79
1.400.000	Goldentree Loan Management US CLO 5 Ltd Series 2019-5X Class F	6,76%	20/10/2032	1.298.056	0,92
5.000.000	Goldentree Loan Management US CLO 6 Ltd Series 2019-6X Class E	5,41%	20/01/2033	4.823.908	3,41
1.000.000	Invesco CLO Ltd Series 2021-1X Class E	6,63%	15/04/2034	1.005.750	0,71
750.000	KKR CLO 17 Ltd Series 17X Class E	7,57%	15/04/2034	759.583	0,54
1.000.000	Long Point Park CLO Ltd Series 2017-1X Class D2	5,79%	17/01/2030	967.629	0,68
3.300.000	Magnetite CLO Ltd Series 2015-14RX Class E	5,79%	18/10/2031	3.270.028	2,31
1.650.000	Magnetite VII Ltd Series 2012-7X Class ER2	6,68%	15/01/2028	1.619.706	1,15
2.650.000	Magnetite VIII Ltd Series 2014-8X Class FR2	7,62%	15/04/2031	2.603.071	1,84
4.600.000	Magnetite XII Ltd Series 2015-12X Class ER	5,86%	15/10/2031	4.568.608	3,23
750.000	Magnetite XV Ltd Series 2015-15X Class ER	5,38%	25/07/2031	723.332	0,51
2.490.000	Magnetite XVII Ltd Series 2016-18X Class FR	7,76%	15/11/2028	2.436.015	1,72
2.000.000	Mariner CLO 5 Ltd Series 2018-5X Class E	6,64%	25/04/2031	1.969.481	1,39
2.650.000	OCP CLO 2014-6 Ltd Series 2014-6X Class DR	6,71%	17/10/2030	2.645.778	1,87
4.125.000	OCP CLO 2016-12 Ltd Series 2016-12X Class DR	5,14%	18/10/2028	4.084.671	2,89
6.385.000	Octagon Investment Partners XV Ltd Series 2013-1X Class ER	7,19%	19/07/2030	6.411.724	4,54
500.000	Octagon Loan Funding Ltd Series 2014-1X Class ERR	6,16%	18/11/2031	489.155	0,35
4.000.000	Oha Loan Funding 2013-1 Ltd Series 2013-1X Class ER2	5,67%	23/07/2031	3.941.187	2,79
4.750.000	Palmer Square CLO 2018-2 Ltd Series 2018-2X Class D	5,78%	16/07/2031	4.777.642	3,38

Neuberger Berman CLO Income Fund (cont.)

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
Valores respaldados por activos (ABS) 87,87% (31 de diciembre de 2020: 87,55%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
500.000	Palmer Square Loan Funding 2020-3 Ltd Series 2020-3X Class D	7,56%	15/11/2031	503.812	0,36
4.600.000	Palmer Squeare Loan Funding 2018-4 Ltd Series 2018-4X Class D	4,41%	15/11/2026	4.599.858	3,25
2.000.000	Post CLO 2018-1 Ltd Series 2018-1X Class E	6,05%	16/04/2031	2.002.128	1,42
2.000.000	PPM CLO 3 Ltd Series 2019-3X Class E	6,80%	17/04/2034	2.011.743	1,42
1.500.000	Symphony CLO XXV Ltd Series 2021-25X Class E	6,69%	19/04/2034	1.501.913	1,06
1.500.000	TICP CLO XI Ltd Series 2018-11X Class E	6,19%	20/10/2031	1.499.937	1,06
4.000.000	Trestles CLO II Ltd Series 201802X Class D	5,93%	25/07/2031	3.902.789	2,76
1.675.000	Trinitas CLO X Ltd Series 2019-10X Class E	7,08%	15/04/2032	1.681.502	1,19
4.000.000	Trinitas CLO XII Ltd Series 2020-12X Class E	7,58%	25/04/2033	4.036.623	2,86
2.500.000	Voya CLO 2015-1 Ltd Series 2015-1X Class DR	5,84%	18/01/2029	2.264.157	1,60
Total valores respaldados por activos **				124.201.998	87,87
Total inversiones				124.201.998	87,87

Contratos de divisas a plazo 0,17% (31 de diciembre de 2020: 1,76%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases EUR con cobertura						
2.551.138 USD	2.127.932 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	26.714	0,02
2.550.082 USD	2.127.932 €	19/07/2021	UBS AG	1	25.659	0,02
2.644.072 USD	2.206.501 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	26.440	0,02
Clases GBP con cobertura						
10.288.416 £	14.162.621 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	51.019	0,04
10.127.501 £	13.941.953 USD	19/07/2021	UBS AG	2	49.380	0,03
9.976.344 £	13.727.849 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	54.659	0,04
226.250 USD	162.373 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	1.929	0,00
Clases SEK con cobertura						
372.756 USD	3.134.350 SEK	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	6.197	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					241.997	0,17

Contratos de swap de rentabilidad total 0,05% (31 de diciembre de 2020: 0,05%)

Importe notional	Fecha de extinción	Tipo variable ¹	Entidad de referencia	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
USD 14.499.955	20/09/2021	0,13	iBoxx USD Liquid High Yield Index ²	62.113	0,05
Plusvalía latente total sobre contratos de swap de rentabilidad total ∞				62.113	0,05

¹ El LIBOR a 3 meses es la referencia para este contrato de swap de rentabilidad total.

² La contraparte en este contrato de swap de rentabilidad total es Goldman Sachs International.

Neuberger Berman CLO Income Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	124.506.108	88,09

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,19%) (31 de diciembre de 2020: (0,30%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
238.224 €	285.589 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(2.977)	(0,00)
Clases EUR con cobertura						
4.720.181 €	5.658.998 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(59.320)	(0,04)
4.830.764 €	5.789.101 USD	19/07/2021	UBS AG	3	(58.236)	(0,04)
5.249.550 €	6.295.440 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	(67.758)	(0,05)
Clases GBP con cobertura						
157.647 £	218.320 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(528)	(0,00)
385.630 £	540.522 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	(7.767)	(0,01)
Clases SEK con cobertura						
15.497.022 SEK	1.830.379 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	5	(18.017)	(0,01)
14.757.773 SEK	1.744.581 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(18.674)	(0,02)
29.482.280 SEK	3.479.816 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	(31.892)	(0,02)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					(265.169)	(0,19)

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(265.169)	(0,19)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	124.240.939	87,90
Otro activo neto	17.103.413	12,10
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	141.344.352	100,00

Análisis de la cartera	USD	% de los Activos totales
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	124.201.998	86,49
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	38.941	0,03
Total inversiones	124.240.939	86,52

Neuberger Berman CLO Income Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
4.125.000	OCP CLO 2016-12 Ltd Series 2016-12X Class DR, 7.94%, 18/10/2028	4.125.000
4.000.000	Trinitas CLO Xii Ltd Series 2020-12X Class E, 7.58%, 25/04/2033	4.015.260
4.000.000	Ares XXXVII CLO Ltd Series 2015-4X Class DR, 7.37%, 15/10/2030	3.942.840
3.270.000	Octagon Investment Partners XV Ltd Series 2013-1X Class ER, 7.22%, 19/07/2030	3.264.212
2.825.000	Ballyrock CLO 2018-1 Ltd Series 2018-1X Class D, 8.16%, 20/04/2031	2.722.509
2.650.000	OCP CLO 2014-6 Ltd Series 2014-6X Class DR, 7.98%, 17/10/2030	2.632.325
2.650.000	Magnetite VIII Ltd Series 2014-8X Class FR2, 9.53%, 15/04/2031	2.612.132
2.500.000	Riserva CLO Ltd Series 2016-3X Class ERE, 6.61%, 18/01/2034	2.500.000
2.500.000	Octagon Investment Partners XXIII Ltd Series 2015-1X Class ER, 8.01%, 15/07/2027	2.474.300
2.490.000	Magnetite XVII Ltd Series 2016-18X Class FR, 10.22%, 15/11/2028	2.437.038
2.170.000	Ares XLI CLO Ltd Series 2016-41X Class E, 7.96%, 15/01/2029	2.166.159
2.000.000	Goldentree Loan Management US CLO 1 Ltd Series 2017-1X Class ER2, 6.70%, 20/04/2034	2.000.000
2.000.000	PPM CLO 3 Ltd Series 2019-3X Class E, 6.80%, 17/04/2034	1.980.000
1.700.000	Flatiron CLO 17 Ltd Series 2017-1X Class E, 6.06%, 15/05/2030	1.700.000
1.675.000	Trinitas CLO X Ltd Series 2019-10X Class E, 9.52%, 15/04/2032	1.657.334
1.650.000	Magnetite VII Ltd Series 2012-7X Class ER2, 8.32%, 15/01/2028	1.577.780
1.500.000	Symphony CLO XXV Ltd Series 2021-25X Class E, 6.69%, 23/01/2032	1.485.000
1.500.000	Aimco CLO 2017-A Series 2017-AX Class FR, 8.73%, 20/04/2034	1.455.150
1.400.000	Goldentree Loan Management US CLO 5 Ltd Series 2019-5X Class F, 8.76%, 20/10/2032	1.303.694
1.250.000	Eaton Vance CLO 2015-1 Ltd Series 2015-1X Class ER, 7.29%, 20/01/2030	1.220.888
1.100.000	Bardot CLO Ltd Series 2019-2X Class E, 8.82%, 22/10/2032	1.109.911
1.050.000	Galaxy XIX CLO Ltd Series 2015-19X Class D1R, 7.93%, 24/07/2030	1.040.246
1.000.000	Invesco CLO 2021-1 Ltd Series 2021-1X Class E, 6.63%, 15/04/2034	980.000
1.000.000	CIFC Funding Ltd Series 2017-5X Class D, 7.68%, 16/11/2030	979.920
1.000.000	Long Point Park CLO Ltd Series 2017-1X Class D2, 6.73%, 17/01/2030	978.230
1.000.000	Galaxy XXIII CLO Ltd Series 2017-23X Class E, 7.40%, 24/04/2029	975.710
1.000.000	Ares XLIX CLO Ltd Series 2018-49X Class E, 8.11%, 22/07/2030	974.220
750.000	Grippen Park CLO Ltd Series 2017-1X Class E, 6.97%, 20/01/2030	745.613
750.000	KKR CLO 17 Ltd Series 17X Class E, 7.57%, 15/04/2034	720.000

Neuberger Berman CLO Income Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Total ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
4.500.000	Magnetite VII Ltd Series 2014-8X Class ER2, 6.87%, 15/04/2031	4.486.500
4.500.000	Milos CLO Ltd Series 2017-1X Class ER, 7.29%, 20/10/2030	4.480.600
3.125.000	Oha Credit Partners XIII Ltd Series 2016-13X Class E, 8.26%, 21/01/2030	3.133.125
2.500.000	Octagon Investment Partners XXIII Ltd Series 2015-1X Class ER, 8.01%, 15/07/2027	2.500.550
2.500.000	Riserva CLO Ltd Series 2016-3X Class ERE, 6.61%, 18/01/2034	2.500.300
2.000.000	Goldentree Loan Management US CLO 1 Ltd Series 2017-1X Class ER2, 6.70%, 20/04/2034	1.996.022
1.250.000	CIFC Funding Ltd Series 2018-4X Class D, 7.03%, 17/10/2031	1.241.250
1.100.000	Catskill Park CLO Ltd Series 2017-1X Class D, 6.22%, 20/04/2029	1.096.590
1.000.000	CIFC Funding Ltd Series 2018-5X Class D, 7.37%, 15/01/2032	996.000
1.000.000	CIFC Funding Ltd Series 2017-5X Class D, 7.68%, 16/11/2030	993.050
1.000.000	Galaxy XXIII CLO Ltd Series 2017-23X Class E, 7.40%, 24/04/2029	993.050
750.000	Grippen Park CLO Ltd Series 2017-1X Class E, 6.97%, 20/01/2030	748.500
750.000	TCI-Flatiron CLO 2016-1 Ltd Series 2017-1X Class E, 6.57%, 18/11/2030	747.675
500.000	OCP CLO 2017-13 Ltd 2017-13X Class D, 7.96%, 15/07/2030	500.075

Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 13,33%. En el mismo periodo, el MSCI All-Country World Index (ACWI) (Total Return, Net of Tax, USD) (el "Índice") registró una rentabilidad del 12,30%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

La selección de valores en el sector de tecnología de la información contribuyó positivamente a la rentabilidad relativa, mientras que la asignación al sector financiero fue lo que más mermó los resultados. Las participaciones de la Cartera que más contribuyeron a las ganancias durante la primera mitad de 2021 fueron ASML Holding, Deere y Trimble. Por el contrario, los principales lastres de la rentabilidad fueron Murata, Verisk y JD.com.

Los mercados de renta variable continuaron su trayectoria alcista durante la primera mitad de 2021, impulsados por los sólidos beneficios empresariales, la administración de vacunas contra la COVID-19 y la continuación de la recuperación económica mundial. En el mes de mayo se produjo una rotación hacia compañías de mayor crecimiento y tecnologías al moderarse los tipos de interés respecto a sus máximos. Esta tendencia se prolongó a lo largo de junio al percibir el mercado que la mayoría de las presiones inflacionistas que se habían instalado durante buena parte del año eran "transitorias" o estaban más relacionadas con la reapertura de la economía global que con cualquier factor estructural. En el ámbito político, el mercado acogió con satisfacción la noticia de que el presidente de EE. UU., Joe Biden, y un grupo formado por 10 senadores habían anunciado un mecanismo para destinar aproximadamente 579.000 millones de dólares de nuevo gasto a infraestructuras físicas, que incluye carreteras, transporte público e infraestructura para vehículos eléctricos.

En cuanto a temas de inversión, el fuerte crecimiento registrado en los principales pilares que sustentan el tema Movilidad de próxima generación continúa a buen ritmo. Por consiguiente, vemos oportunidades convincentes en todo el universo invertible a medida que sigue evolucionando el sector del transporte global, con ejemplos recientes concretos que lo evidencian.

En el ámbito de *Conducción autónoma*, las tendencias de seguridad activa siguen avanzando, dando lugar a notables descubrimientos que se aplican a la industria del robotaxi. Cruise Automation, filial de GM, recibió la autorización para transportar pasajeros en sus robotaxis totalmente autónomos (sin conductor) en San Francisco. Paralelamente, Cruise y Waymo de Google solicitaron permiso para comenzar a cobrar por prestar servicios relacionados con vehículos autónomos (VA) en California. Ambas noticias marcan un importante avance hacia la comercialización. Además, Waymo concluyó su segunda ronda de financiación externa, y el consejero delegado de Argo AI señaló que la compañía podría acometer una salida a Bolsa en el transcurso del próximo año; por su parte, Cruise obtuvo una línea de crédito de GM Financial. De estas noticias se desprende que algunos de los líderes del sector podrían tener capital suficiente para ir aumentando progresivamente las operaciones comerciales.

En el ámbito de la *Electrificación*, continúan proliferando las inversiones adelantadas en vehículos eléctricos (VE), nuevos despliegues de productos y prohibiciones del motor de combustión. General Motors incrementó un 30% su gasto global dirigido a vehículos eléctricos, situándose ahora en 35.000 millones de dólares hasta 2025, mientras que BMW se marcó como objetivo que sus vehículos totalmente eléctricos representasen un 50% de las ventas globales hacia 2030. Honda publicó su plan de suspender la venta de vehículos de motor de combustión interna hacia 2040 (y equipar todos sus vehículos con sistemas avanzados de asistencia al conductor hacia 2030). De igual modo, Canadá declaró la prohibición de vender nuevos vehículos con motores de combustión a partir de 2035. La Feria del Automóvil de Shanghái, reflejando también la apuesta por los vehículos eléctricos, acogió una gran cantidad de presentaciones de nuevos productos, muchos de ellos totalmente eléctricos. VW reveló al mercado chino su familia de automóviles totalmente eléctricos ID.6; Volvo exhibió su primer vehículo totalmente eléctrico y Toyota anunció 15 nuevos modelos de VE.

Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		173.852.581	72.086.148
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	6.512.962	5.100.667
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		702.515	194.754
Cuentas a percibir por acciones emitidas		3.223.379	1.473.096
Ingresos a percibir y otros activos		53.271	67.009
Activos totales		184.344.708	78.921.674
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		45.000	731
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		428.981	856.039
Gastos devengados		298.799	171.483
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		1.588.313	805.071
Otras cuentas por pagar		35.757	15.827
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		2.396.850	1.849.151
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		181.947.858	77.072.523

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		194	4.955
Ingresos por dividendos		487.040	205.229
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		15.423.626	(1.287.504)
		15.910.860	(1.077.320)
Gastos			
Comisión de gestión	5	894.773	213.985
Comisión de distribución	5	156.795	22.316
Comisión de administración	5	75.184	42.890
Comisión de compromiso	16	3.765	1.953
Comisión de depósito	5	6.267	6.197
Comisión del Depositario	5	3.233	1.790
Honorarios profesionales	7	48.462	31.200
Honorarios de los Consejeros	6	2.250	2.117
Costes de transacciones	7	45.320	22.425
Honorarios de auditoría	7	8.637	8.445
Reembolso de IVA		(434)	(115)
Otros gastos	7	8.054	10.555
Gastos no asumidos	5	–	(67.709)
Gastos totales		1.252.306	296.049
Repartos de dividendos abonados	1	–	22.668
		–	22.668
Impuestos retenidos en origen		94.085	38.981
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		14.564.469	(1.435.018)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	77.072.523	42.655.448
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	14.564.469	(1.435.018)
Suscripciones	116.552.321	10.562.708
Reembolsos	(26.241.455)	(15.250.236)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	181.947.858	36.532.902

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund (cont.)

Cartera de inversiones

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Número de acciones	Descripción de los valores	Valor USD	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 95,54% (31 de diciembre de 2020: 93,52%)			
Euro			
31.041	BE Semiconductor Industries NV	2.633.496	1,45
33.465	Infineon Technologies AG	1.342.185	0,74
22.863	Schneider Electric SE	3.597.384	1,97
	Total euro	7.573.065	4,16
Dólar de Hong Kong			
67.936	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	2.146.770	1,18
	Total dólar de Hong Kong	2.146.770	1,18
Yen japonés			
35.614	Murata Manufacturing Co Ltd	2.721.668	1,50
35.741	Taiyo Yuden Co Ltd	1.767.890	0,97
	Total yen japonés	4.489.558	2,47
Nuevo dólar taiwanés			
68.000	MediaTek Inc	2.347.815	1,29
	Total nuevo dólar taiwanés	2.347.815	1,29
Corona sueca			
19.353	Epiroc AB Class A	441.273	0,24
	Total corona sueca	441.273	0,24
Dólar estadounidense			
12.578	Air Products & Chemicals Inc	3.618.439	1,99
9.670	Alibaba Group Holding Ltd ADR	2.192.963	1,21
872	Alphabet Inc Class A	2.129.241	1,17
18.598	Altair Engineering Inc Class A	1.282.704	0,70
729	Amazon.com Inc	2.507.877	1,38
8.767	Ambarella Inc	934.825	0,51
93.136	Amphenol Corp Class A	6.371.434	3,50
26.489	Analog Devices Inc	4.560.346	2,51
15.348	ANSYS Inc	5.326.677	2,93
14.398	Aptiv Plc	2.265.237	1,25
9.000	ASML Holding NV	6.217.560	3,42
21.688	Autodesk Inc	6.330.727	3,48
20.619	Cadence Design Systems Inc	2.821.092	1,55
15.575	Caterpillar Inc	3.389.587	1,86

Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund (cont.)

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 95,54% (31 de diciembre de 2020: 93,52%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
4.693	Coherent Inc	1.240.548	0,68
14.303	Deere & Co	5.044.811	2,77
42.834	General Motors Co	2.534.488	1,39
57.443	Gentex Corp	1.900.789	1,04
16.287	IHS Markit Ltd	1.834.893	1,01
55.095	II-VI Inc	3.999.346	2,20
34.164	JD.com Inc ADR	2.726.629	1,50
26.619	Keysight Technologies Inc	4.110.240	2,26
3.954	Lam Research Corp	2.572.868	1,41
49.721	Lattice Semiconductor Corp	2.793.326	1,54
13.996	Linde Plc	4.046.244	2,22
42.843	Lyft Inc Class A	2.591.145	1,42
34.343	Maxim Integrated Products Inc	3.618.378	1,99
69.783	Micron Technology Inc	5.930.159	3,26
122.769	MP Materials Corp	4.525.265	2,49
48.204	NIO Inc ADR	2.564.453	1,41
3.456	NVIDIA Corp	2.765.146	1,52
16.846	NXP Semiconductors NV	3.465.559	1,90
43.210	ON Semiconductor Corp	1.654.079	0,91
4.590	Qorvo Inc	898.033	0,49
49.426	Sensata Technologies Holding Plc	2.865.225	1,57
37.196	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	4.469.471	2,46
26.934	TE Connectivity Ltd	3.641.746	2,00
118.781	Telefonaktiebolaget LM Ericsson ADR	1.494.265	0,82
4.060	Tesla Inc	2.759.582	1,52
33.715	Texas Instruments Inc	6.483.395	3,56
36.396	T-Mobile US Inc	5.271.233	2,90
73.594	Trimble Inc	6.022.197	3,31
108.170	Uber Technologies Inc	5.421.480	2,98
8.917	Verisk Analytics Inc Class A	1.557.978	0,86
6.783	Visteon Corp	820.336	0,45
26.159	Xilinx Inc	3.783.638	2,08
6.879	Zscaler Inc	1.486.277	0,82
Total dólar estadounidense		156.841.931	86,20
Total valores de renta variable *		173.840.412	95,54
Total inversiones		173.840.412	95,54

Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund (cont.)

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 2020: 0,01%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases EUR con cobertura						
14.675 €	17.403 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	7	0,00
256.856 USD	211.636 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	8	5.786	0,01
164.492 USD	136.832 €	19/07/2021	UBS AG	3	2.164	0,00
272.931 USD	226.514 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	7	4.212	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					12.169	0,01
					Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados					173.852.581	95,55

Contratos de divisas a plazo (0,02%) (31 de diciembre de 2020: (0,00%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases EUR con cobertura						
1.207.037 €	1.450.413 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	11	(18.472)	(0,01)
1.014.974 €	1.218.066 USD	19/07/2021	UBS AG	7	(13.974)	(0,01)
975.771 €	1.170.136 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	19	(12.554)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(45.000)	(0,02)
					Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados					(45.000)	(0,02)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados					173.807.581	95,53
Otro activo neto					8.140.277	4,47
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables					181.947.858	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	173.840.412	94,30
[∞] Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(32.831)	(0,02)
Total inversiones	173.807.581	94,28

Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
91.490	Uber Technologies Inc	4.738.824
55.700	Micron Technology Inc	4.718.428
15.240	Autodesk Inc	4.325.328
125.437	MP Materials Corp	4.036.855
44.768	Amphenol Corp Class A	3.790.031
21.241	Texas Instruments Inc	3.710.477
27.773	T-Mobile US Inc	3.541.217
9.151	ANSYS Inc	3.255.992
45.203	II-VI Inc	3.220.043
39.768	Trimble Inc	2.937.898
24.448	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	2.922.066
48.960	Lyft Inc Class A	2.906.779
20.619	Cadence Design Systems Inc	2.773.187
28.216	Maxim Integrated Products Inc	2.599.430
4.060	Tesla Inc	2.579.779
31.041	BE Semiconductor Industries NV	2.533.586
41.888	Sensata Technologies Holding Plc	2.403.894
17.160	Xilinx Inc	2.273.966
7.548	Air Products & Chemicals Inc	2.064.234
5.615	Deere & Co	2.007.432
7.360	Linde Plc	1.990.169
22.600	Murata Manufacturing Co Ltd	1.964.248
12.431	Schneider Electric SE	1.924.619
12.606	Analog Devices Inc	1.921.539
34.606	Intel Corp	1.865.736
48.204	NIO Inc ADR	1.854.005
3.062	ASML Holding NV	1.807.752
21.173	JD.com Inc ADR	1.802.100
12.580	TE Connectivity Ltd	1.671.129
10.558	Keysight Technologies Inc	1.494.814
26.633	General Motors Co	1.464.649
31.653	Lattice Semiconductor Corp	1.450.194
2.473	NVIDIA Corp	1.418.944
6.145	Caterpillar Inc	1.313.075
4.693	Coherent Inc	1.224.583
4.482	Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.058.135
29.063	Gentex Corp	1.037.557

Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas (cont.)

20 ventas de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
34.736	NextEra Energy Inc	2.525.602
34.606	Intel Corp	2.223.905
18.598	Lumentum Holdings Inc	1.703.606
9.790	T-Mobile US Inc	1.406.463
21.273	Lyft Inc Class A	1.271.122
32.806	MP Materials Corp	1.175.779
6.456	Qorvo Inc	1.160.902
4.646	Universal Display Corp	1.028.510
6.999	Ambarella Inc	736.739
1.092	Lam Research Corp	691.920
14.697	STMicroelectronics NV	570.471
42.983	Telefonaktiebolaget LM Ericsson ADR	559.278
5.389	Progressive Corp	476.335
5.551	II-VI Inc	442.612
7.845	Lattice Semiconductor Corp	437.126
5.218	Uber Technologies Inc	270.222
7.400	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	207.014
2.071	IHS Markit Ltd	177.924
972	NXP Semiconductors NV	170.573
270	ASML Holding NV	160.188

Neuberger Berman Ultra Short Term EURO Bond Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I EUR en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 1,07%. Durante el mismo periodo, el ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (Total Return, EUR) obtuvo una rentabilidad del -0,34%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

En el primer semestre del año la pandemia por COVID-19 volvió a estar controlada en la zona euro, fruto de la aceleración de las campañas de vacunación. La incesante normalización de la economía propició un repunte de los activos de riesgo, como la renta variable y el crédito, mientras que los precios del mercado de bonos se vieron sometidos a presión: en mayo, el rendimiento de los Bunds alcanzó su nivel más alto en un año al situarse en -9bps, cerrando el semestre en -0,21bps, es decir, 36 puntos básicos más que a comienzos del año. De hecho, la mayoría de países del euro suavizaron las restricciones sociales, con la consiguiente reapertura de los sectores de servicios. Esto se tradujo en una creación de empleo y en un brusco aumento de la confianza en la actividad: Los indicadores adelantados de la zona euro, como el IFO alemán, alcanzaron su nivel más alto en años. El desglose del PIB alemán del 1T mostró un inesperado crecimiento sostenible del CapEx. Las producciones de las fábricas de la zona euro ha vuelto a marcar sus niveles previos a la crisis, tal como reflejan los sólidos indicadores PMI de la región, que aumentaron por quinto mes consecutivo. El optimismo se extendió a los países periféricos, donde los indicadores PMI de servicios se dispararon como consecuencia del fuerte nivel de crecimiento. El PIB de Italia correspondiente al primer trimestre también se revisó al alza.

En este contexto, el bajísimo nivel de rendimientos llevó a los gestores de la cartera a intentar crear una infraexposición a duración, lo cual resultó crucial al inicio del año cuando la duración de la cartera era de 0,4 años. Posteriormente, la duración de la cartera se incrementó cuando el rendimiento de los bunds se amplió de manera significativa; esto ocurrió en mayo, momento en que la duración se elevó a su límite superior de 2 años y luego se redujo ligeramente a 1,3 años, ya al final del semestre, cuando el rendimiento de los bunds cedió parte de su ampliación. Nuestro enfoque consistió en gestionar activamente esta estrategia para sacar provecho de la volatilidad del mercado. Por esa razón preferimos participar a través de derivados y sus respectivas opciones. A menudo gestionamos una exposición larga a opciones de venta sobre bunds a 10 años para aprovechar la volatilidad del mercado en el contexto de una tendencia bajista. Esta apuesta activa sobre la duración contribuyó en un 45% a la rentabilidad superior de la cartera durante el periodo analizado. Sin embargo, la principal aportación a la rentabilidad vino del posicionamiento largo en crédito y valores respaldados por activos (ABS), gracias al estrechamiento de los diferenciales registrado en el trimestre. Estas clases de activos contribuyeron en alrededor del 50% a la rentabilidad superior de la cartera.

Durante la primera mitad del año, seguimos rotando la cartera para extraer valor de un mercado que todavía presenta ciertos desajustes, al tiempo que la mantuvimos invertida principalmente en crédito europeo. De hecho, la Cartera está posicionada en crédito europeo (60%), ABS europeos de pago preferente (18%), bonos del Estado europeos (12%) y bonos vinculados a la inflación (4%), a fecha de final de junio.

La gestión de la Cartera se asienta en dos estrategias o "cubos" principales: el "básico" y el "táctico". Mientras que el primero se utiliza para producir un carry estable y mantener baja la volatilidad de la cartera, el segundo permite la creación de alfa. Durante el primer semestre del año, redujimos el cubo "táctico" de la cartera, llevándolo del 18% al 13%. La idea era eliminar parte del riesgo de la cartera en vista de las valoraciones infladas que presentaban los bonos, a pesar de los sólidos fundamentales. En caso de materializarse cierta volatilidad, la cartera estaría en una posición más neutral y podría incorporar algunos bonos de alto beta en este cubo. En particular, recortamos los bonos de seguros subordinados y de bancos centrales y semicentrales de categoría inferior a dos, al ser sumamente caros comparado con los rendimientos que ofrecen actualmente (inferiores al 1%). Además, vendimos bonos corporativos de alta rentabilidad BB que cotizan a rentabilidades inferiores al 1,5%, al tiempo que mantuvimos nuestros bonos con calificación B que, en nuestra opinión, siguen teniendo cierto margen de compresión. En cuanto a sectores, mantuvimos por lo general el cubo táctico de la cartera expuesto a sectores que retoman su actividad (ocio, hoteles, aerolíneas, etc.), ya que todavía continúan a la zaga. En el área de deuda pública, recortamos nuestros bonos con vencimiento a largo plazo, tanto en países centrales como semicentrales, al no ser desdeñable el riesgo de duración en vista del fuerte rebote de la economía. Durante este periodo, incrementamos el cubo "básico" convenientemente para permitir que el "táctico" disminuya. El cubo "básico" pasó del 82% al 87% del AUM durante el trimestre. En general, preferimos sectores cíclicos y títulos financieros senior, que ofrecen una prima frente a sectores más defensivos. También pusimos en práctica varios posicionamientos de ampliación de vencimientos para incrementar la renovación de los bonos, siempre que las curvas estaban suficientemente pronunciadas como para justificar esas ampliaciones.

Durante los próximos meses creemos que los inversores deberían estar atentos a las consecuencias a largo plazo de la recuperación económica mundial. Los grandes planes de rescate fiscal implantados en todo el mundo, unido a la aceleración de las campañas de vacunación, deberían favorecer el aumento de la tasa de inflación en un contexto de brusco encarecimiento de las materias primas e interrupciones en la cadena de suministro. La nueva incógnita es cuánto tiempo permanecerá la inflación por encima de su objetivo del 2% y luego cómo reaccionará el BCE ante eso. Así pues, la normalización de la actividad en la zona euro debería llevar al mercado a preguntarse si la compra de bonos por parte del BCE podría reajustarse a la baja después del verano. En este contexto, auguramos que la prima de riesgo por rentabilidad comenzará a aumentar desde su nivel más bajo en décadas.

Como conclusión, al cierre del año auguramos unos tipos básicos más altos, fruto del rebote más largo y fuerte de la tasa de inflación. La mayor actividad debería favorecer al mercado de crédito, especialmente reforzado por la búsqueda de rentabilidades por parte de inversores que todavía cuentan con excedentes de efectivo.

Neuberger Berman Ultra Short Term EURO Bond Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 EUR	A 31 de diciembre de 2020 EUR
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		661.671.270	406.078.697
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	56.920.238	29.242.481
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		379.670	2.335.480
Cuentas a percibir por acciones emitidas		9.431.111	1.584.321
Cuentas por cobrar de intermediarios		4.120.855	2.174.347
Ingresos a percibir y otros activos		2.602.972	2.570.311
Activos totales		735.126.116	443.985.637
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		2.118.014	1.769.161
Descubierto bancario	3	23.907	9.951
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		1.204.230	4.719.220
Gastos devengados		167.089	111.470
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		20.396.484	3.298.074
Otras cuentas por pagar		53.915	75.809
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		23.963.639	9.983.685
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		711.162.477	434.001.952

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Ultra Short Term EURO Bond Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 EUR	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 EUR
Ingresos			
Ingresos por intereses		3.314.085	2.466.609
Ingresos por dividendos		–	2.425
Ingresos por préstamo de valores	15	8.201	89
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		7.971.110	(4.909.851)
		11.293.396	(2.440.728)
Gastos			
Comisión de gestión	5	368.094	236.480
Comisión de distribución	5	57	80
Comisión de administración	5	190.673	202.387
Comisión de compromiso	16	30.772	17.667
Comisión de depósito	5	18.796	14.855
Comisión del Depositario	5	13.238	19.550
Honorarios profesionales	7	49.011	33.419
Honorarios de los Consejeros	6	1.699	1.899
Costes de transacciones	7	29.869	35.595
Honorarios de auditoría	7	4.286	7.618
Reembolso de IVA		(2.122)	(1.330)
Otros gastos	7	3.753	16.017
Gastos no asumidos	5	(28.180)	(120.712)
Gastos totales		679.946	463.525
Costes financieros			
Gastos por intereses		30	1
Repartos de dividendos abonados	1	2.958	23
		2.988	24
Impuestos retenidos en origen		18	–
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		10.610.444	(2.904.277)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Ultra Short Term EURO Bond Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 EUR	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 EUR
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	434.001.952	377.519.116
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	10.610.444	(2.904.277)
Suscripciones	373.742.604	226.483.169
Reembolsos	(107.192.523)	(226.590.015)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	711.162.477	374.507.993

Neuberger Berman Ultra Short Term EURO Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Importe principal	Descripción de los valores	Cupón	Fecha de vencimiento	Valor razonable EUR	% del Patrimonio neto
Valores respaldados por activos (ABS) 16,32% (31 de diciembre de 2020: 17,65%)					
Euro					
1.755.292	Brignole CO S.r.l. Series 2019-1 Class A	0,18%	24/07/2034	1.756.940	0,25
5.021.729	Brignole CQ S.r.l. Series 2019-1 Class A	0,19%	24/03/2036	5.033.896	0,71
969.225	Bumper NL B.r.l. 2020-NL1 Class A	0,63%	24/06/2031	979.019	0,14
396.794	Citizen Irish Auto Receivables Trust Series 2018-1 Class A	0,15%	15/12/2027	398.154	0,06
380.000	Citizen Irish Auto Receivables Trust Series 2020-1 Class A	0,27%	15/12/2029	382.741	0,05
2.458.991	Delft BV Series 2020-1 Class A	0,40%	17/10/2042	2.459.940	0,35
250.000	Delft BV Series 2020-1 Class B	0,85%	17/10/2042	250.469	0,03
1.120.986	Dilosk RMBS No. 2 DAC Class A	0,21%	20/12/2057	1.124.424	0,16
1.039.117	Domi B.V. Series 2019-1 Class A	0,30%	15/06/2051	1.046.238	0,15
1.663.896	Domi B.V. Series 2020-1 Class A	0,26%	15/04/2052	1.675.101	0,23
893.318	Domi B.V. Series 2020-2 Class A	0,34%	15/11/2052	900.616	0,13
3.800.000	Domi B.V. Series 2021-1 Class A	0,10%	15/06/2053	3.820.752	0,54
1.906.470	Dutch Property Finance BV Series 2019-1 Class A	0,21%	28/10/2052	1.913.450	0,27
3.753.471	Dutch Property Finance BV Series 2020-2 Class A	0,30%	29/12/2049	3.781.382	0,53
5.924.463	European Residential Loan Securitisation 2018-1 DAC	1,44%	24/03/2061	5.933.036	0,83
5.670.082	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC Class A	0,99%	24/02/2058	5.679.295	0,80
4.715.906	Futura S.r.l. Series 2019-1 Class A	2,67%	31/07/2044	4.735.279	0,67
7.032.137	Gedesco Trade Receivables Designated Activity Co Series 2020-1 Class A	0,64%	24/01/2026	7.039.914	0,99
3.763.324	Glenbeigh Ltd Class A	0,21%	24/03/2046	3.765.492	0,53
1.844.759	Grecale Abs S.R.L Series 2015-1 Class A	0,00%	22/12/2067	1.844.153	0,26
5.289.767	Jepson DAC Series 2019-1 Class A	0,34%	24/11/2057	5.309.980	0,75
1.700.000	Jepson DAC Series 2019-1 Class B	0,74%	24/11/2057	1.706.232	0,24
562.232	Lanterna S.r.l. Series 2015-1 Class A	0,31%	28/10/2065	562.126	0,08
12.171.141	MIRAVET S.A R.L. Series 20019-1 Class A	0,00%	26/05/2065	12.238.240	1,72
4.220.032	MIRAVET S.A R.L. Series 20019-1 Class A	0,21%	26/05/2065	4.237.765	0,60
3.275.627	Mulcair Securities DAC Series 1 Class A	0,81%	24/04/2071	3.297.871	0,46
3.000.000	Pelmo S.r.l. Series 1 Class A	0,15%	15/02/2036	3.019.416	0,42
1.939.697	Pembroke Property Finance DAC Series 1 Class A	0,66%	01/06/2037	1.942.490	0,27
2.504.397	Pepper Residential Securities Trust No 25 Series 25X Class A1	0,70%	12/03/2061	2.508.220	0,35
7.751.980	Primrose Residential Series 2021-1 Class A	0,00%	24/03/2061	7.759.027	1,09
1.700.000	Progetto Quinto Series 1 Class A	0,04%	27/10/2036	1.705.727	0,24
1.185.000	Retiro Mortgage Securities Series 1X Class A1	0,00%	30/07/2075	1.176.517	0,16
1.625.257	Shamrock Residential Series 2021-1 Class A	0,00%	24/12/2059	1.628.656	0,23
4.126.489	Siena Mortgages S.r.l. Series 2010-7 Class A3	0,06%	22/11/2070	4.131.833	0,58
2.607.246	Strandhill RMBS Series 1 Class A	0,11%	30/01/2065	2.617.996	0,37
2.200.860	Tagus - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA Series 2009 Class A1	1,40%	12/05/2025	2.231.161	0,31
3.547.447	Tagus - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA Series 5 Class SEN	0,85%	12/02/2022	3.562.492	0,50

Neuberger Berman Ultra Short Term EURO Bond Fund (cont.)

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 EUR	% del Patrimonio neto
Valores respaldados por activos (ABS) 16,32% (31 de diciembre de 2020: 17,65%) (cont.)					
Euro (cont.)					
1.896.094	Tagus - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA Series 6 Class SEN	1,10%	13/02/2023	1.913.276	0,27
Total valores respaldados por activos **				116.069.316	16,32
Bonos de empresa 72,31% (31 de diciembre de 2020: 70,33%)					
Euro					
2.600.000	AbbVie Inc*	1,25%	01/06/2024	2.691.429	0,38
1.000.000	AbbVie Inc*	1,38%	17/05/2024	1.038.633	0,15
3.000.000	AbbVie Inc*	1,50%	15/11/2023	3.115.398	0,44
1.300.000	Abertis Infraestructuras Finance BV*	2,63%	29/12/2049	1.290.900	0,18
1.400.000	Accor SA*	2,63%	29/12/2049	1.373.800	0,19
2.100.000	ADLER Group SA*	2,25%	14/01/2029	2.043.525	0,29
2.900.000	ADLER Real Estate AG*	1,50%	17/04/2022	2.894.899	0,41
1.000.000	ALD SA*	0,00%	23/02/2024	1.000.422	0,14
4.000.000	ALD SA*	0,38%	18/07/2023	4.041.740	0,57
1.100.000	ALD SA*	0,38%	19/10/2023	1.110.671	0,16
1.500.000	AMCO - Asset Management Co SpA*	1,50%	17/07/2023	1.548.438	0,22
2.500.000	American Tower Corp*	1,38%	04/04/2025	2.610.607	0,37
1.000.000	Aroundtown SA*	3,38%	29/12/2049	1.041.250	0,15
5.000.000	Arval Service Lease SA*	0,00%	30/09/2024	5.002.015	0,70
1.000.000	Asahi Group Holdings Ltd*	0,01%	19/04/2024	1.003.057	0,14
400.000	Asahi Group Holdings Ltd*	0,16%	23/10/2024	402.830	0,06
6.000.000	Athene Global Funding*	1,13%	02/09/2025	6.232.530	0,88
3.000.000	Athene Global Funding*	1,88%	23/06/2023	3.115.328	0,44
1.700.000	Atrium European Real Estate Ltd*	3,63%	29/12/2049	1.668.593	0,23
1.500.000	Autostrade per l'Italia SpA*	2,00%	04/12/2028	1.565.379	0,22
1.400.000	Balder Finland OYJ*	0,06%	14/06/2023	1.402.240	0,20
1.000.000	Banco de Sabadell SA*	0,63%	07/11/2025	1.008.725	0,14
3.100.000	Banco Santander SA*	0,00%	11/02/2025	3.108.699	0,44
2.000.000	Bank of America Corp*	0,16%	25/04/2024	2.013.498	0,28
5.700.000	Bank of America Corp*	0,81%	09/05/2026	5.864.074	0,82
4.000.000	Bank of America Corp*	1,38%	07/02/2025	4.150.696	0,58
9.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA*	0,01%	11/05/2026	8.974.854	1,26
6.000.000	Barclays Plc*	3,38%	02/04/2025	6.538.764	0,92
5.000.000	Bayer AG*	0,05%	12/01/2025	4.991.725	0,70
2.900.000	Bayer AG*	0,38%	06/07/2024	2.933.608	0,41
600.000	Becton Dickinson & Co*	1,40%	24/05/2023	616.448	0,09
500.000	BMW Finance NV*	0,00%	24/03/2023	502.830	0,07
1.500.000	BMW Finance NV*	0,63%	06/10/2023	1.530.534	0,22

Neuberger Berman Ultra Short Term EURO Bond Fund (cont.)

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 EUR	% del Patrimonio neto
Bonos de empresa 72,31% (31 de diciembre de 2020: 70,33%) (cont.)					
Euro (cont.)					
5.000.000	BNP Paribas SA*	0,50%	15/07/2025	5.067.735	0,71
1.600.000	BP Capital Markets Plc*	3,63%	29/12/2049	1.743.856	0,25
13.900.000	BPCE SA*	0,63%	28/04/2025	14.251.753	2,00
900.000	Carrefour Banque SA*	0,11%	14/06/2025	901.777	0,13
1.700.000	CCEP Finance Ireland DAC*	0,00%	06/09/2025	1.701.297	0,24
2.300.000	CDP Reti SpA*	1,88%	29/05/2022	2.342.338	0,33
1.400.000	Cellnex Telecom SA*	1,75%	23/10/2030	1.395.488	0,20
4.000.000	CK Hutchison Finance 16 II Ltd*	0,88%	03/10/2024	4.111.448	0,58
7.215.000	CK Hutchison Finance 16 Ltd*	1,25%	06/04/2023	7.386.097	1,04
800.000	CMA CGM SA*	5,25%	15/01/2025	819.106	0,12
2.000.000	CNH Industrial Finance Europe SA*	2,88%	17/05/2023	2.110.810	0,30
6.000.000	Commerzbank AG*	0,63%	28/08/2024	6.131.244	0,86
1.000.000	Commerzbank AG*	1,25%	23/10/2023	1.030.293	0,14
1.500.000	Commerzbank AG*	4,00%	23/03/2026	1.697.135	0,24
5.000.000	Credit Agricole SA*	1,38%	13/03/2025	5.238.095	0,74
650.000	Credit Agricole SA*	3,39%	18/10/2023	705.152	0,10
2.400.000	Credit Logement SA*	0,60%	29/12/2049	2.347.306	0,33
4.800.000	Credit Suisse AG*	0,25%	05/01/2026	4.817.482	0,68
2.750.000	Credit Suisse Group AG*	0,46%	16/01/2026	2.768.439	0,39
300.000	Credit Suisse Group AG*	1,25%	17/07/2025	308.139	0,04
4.000.000	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd*	1,25%	14/04/2022	4.044.000	0,57
2.000.000	Daimler Canada Finance Inc*	0,16%	11/09/2022	2.013.982	0,28
2.000.000	Daimler International Finance BV*	0,25%	06/11/2023	2.018.189	0,28
6.000.000	Danske Bank*	1,38%	24/05/2023	6.077.532	0,85
3.500.000	Dell Bank International DAC*	0,63%	17/10/2022	3.538.626	0,50
3.000.000	Deutsche Bank AG*	0,26%	16/05/2022	3.013.179	0,42
2.000.000	Deutsche Bank AG*	1,00%	19/11/2025	2.042.613	0,29
5.000.000	Deutsche Bank AG*	1,88%	14/02/2022	5.065.875	0,71
900.000	Deutsche Bank AG*	4,50%	19/05/2026	1.038.481	0,15
2.000.000	DH Europe Finance Sarl*	0,00%	30/06/2022	2.006.498	0,28
1.500.000	Digital Dutch Finco BV*	0,63%	15/07/2025	1.530.331	0,22
500.000	doValue SpA**	5,00%	04/08/2025	524.778	0,07
1.700.000	Dufry One BV*	3,38%	15/04/2028	1.691.500	0,24
800.000	easyJet FinCo BV*	1,88%	03/03/2028	801.928	0,11
2.000.000	Electricite de France SA*	3,38%	29/12/2049	2.092.790	0,29
1.000.000	Energizer Gamma Acquisition BV**	3,50%	30/06/2029	997.829	0,14
1.450.000	ENI SpA*	0,63%	19/09/2024	1.485.525	0,21
1.200.000	ENI SpA*	2,00%	29/12/2049	1.200.721	0,17

Neuberger Berman Ultra Short Term EURO Bond Fund (cont.)

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 EUR	% del Patrimonio neto
Bonos de empresa 72,31% (31 de diciembre de 2020: 70,33%) (cont.)					
Euro (cont.)					
1.400.000	ENI SpA [*]	3,38%	29/12/2049	1.489.635	0,21
1.679.000	European Union [*]	0,00%	04/07/2031	1.675.966	0,24
1.041.000	European Union [*]	0,70%	06/07/2051	1.054.386	0,15
3.000.000	Fastighets AB Balder [*]	1,13%	14/03/2022	3.018.735	0,42
4.000.000	Fastighets AB Balder [*]	1,88%	14/03/2025	4.205.420	0,59
1.300.000	FCA Bank SpA [*]	0,00%	16/04/2024	1.300.142	0,18
6.080.000	FCA Bank SpA [*]	0,13%	16/11/2023	6.101.022	0,86
5.000.000	FCA Bank SpA [*]	0,25%	28/02/2023	5.030.240	0,71
2.000.000	FCA Bank SpA [*]	0,50%	18/09/2023	2.022.128	0,28
1.600.000	FCA Bank SpA [*]	0,50%	13/09/2024	1.622.878	0,23
1.500.000	FCA Bank SpA [*]	0,63%	24/11/2022	1.515.516	0,21
2.000.000	Fidelity National Information Services Inc [*]	0,75%	21/05/2023	2.033.092	0,29
665.000	Fiserv Inc [*]	0,38%	01/07/2023	671.441	0,09
750.000	Foncia Management SASU ^{**}	3,38%	31/03/2028	747.470	0,10
1.500.000	Ford Motor Credit Co LLC [*]	1,36%	07/02/2025	1.502.048	0,21
7.000.000	General Electric Co [*]	0,88%	17/05/2025	7.195.286	1,01
1.765.000	General Electric Co [*]	1,25%	26/05/2023	1.808.126	0,25
3.664.000	Goldman Sachs Group Inc [*]	0,01%	30/04/2024	3.666.499	0,52
2.972.000	Goldman Sachs Group Inc [*]	0,08%	26/09/2023	2.981.068	0,42
1.100.000	Goldman Sachs Group Inc [*]	1,38%	15/05/2024	1.129.312	0,16
2.000.000	Goldman Sachs Group Inc ^{**}	2,00%	27/07/2023	2.087.892	0,29
3.678.000	Goldman Sachs Group Inc [*]	2,13%	30/09/2024	3.926.515	0,55
2.000.000	Goldman Sachs Group Inc [*]	3,38%	27/03/2025	2.243.404	0,32
1.200.000	Grupo Antolin-Irausa SA [*]	3,50%	30/04/2028	1.198.534	0,17
2.000.000	Heathrow Funding Ltd [*]	1,50%	12/10/2025	2.087.590	0,29
2.300.000	Heathrow Funding Ltd [*]	1,88%	23/05/2022	2.340.892	0,33
1.968.000	Heimstaden Bostad AB [*]	2,13%	05/09/2023	2.057.105	0,29
2.230.000	Heimstaden Bostad AB [*]	3,38%	29/12/2049	2.312.465	0,33
400.000	Heimstaden Bostad Treasury BV [*]	0,06%	12/01/2023	400.827	0,06
2.000.000	Intesa Sanpaolo SpA [*]	1,00%	22/07/2022	2.027.138	0,28
4.600.000	Intesa Sanpaolo SpA ^{**}	2,13%	30/08/2023	4.825.262	0,68
8.000.000	Intesa Sanpaolo SpA ^{**}	2,13%	26/05/2025	8.594.048	1,21
1.500.000	Intesa Sanpaolo SpA [*]	2,93%	14/10/2030	1.599.471	0,22
1.400.000	Intrum AB [*]	3,00%	15/09/2027	1.388.429	0,20
1.000.000	IPD 3 BV [*]	5,50%	01/12/2025	1.043.200	0,15
3.800.000	Islandsbanki HF [*]	0,50%	20/11/2023	3.837.187	0,54
5.517.000	Islandsbanki HF [*]	1,13%	19/01/2024	5.597.377	0,79
1.100.000	JCDecaux SA [*]	1,00%	01/06/2023	1.121.483	0,16

Neuberger Berman Ultra Short Term EURO Bond Fund (cont.)

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 EUR	% del Patrimonio neto
Bonos de empresa 72,31% (31 de diciembre de 2020: 70,33%) (cont.)					
Euro (cont.)					
900.000	Kedrion SpA*	3,38%	15/05/2026	897.098	0,13
4.500.000	Landsbankinn HF*	0,38%	23/05/2025	4.491.009	0,63
4.500.000	Landsbankinn HF*	0,50%	20/05/2024	4.524.930	0,64
5.400.000	Landsbankinn HF*	1,00%	30/05/2023	5.496.158	0,77
1.700.000	Landsbankinn HF*	1,38%	14/03/2022	1.716.844	0,24
2.600.000	LeasePlan Corp NV*	0,13%	13/09/2023	2.615.756	0,37
5.000.000	LeasePlan Corp NV*	0,25%	23/02/2026	4.986.546	0,70
1.860.000	LeasePlan Corp NV*	0,75%	03/10/2022	1.883.092	0,26
3.500.000	Lloyds Bank Corporate Markets Plc*	0,25%	04/10/2022	3.527.977	0,50
7.000.000	Lloyds Banking Group Plc*	3,50%	01/04/2026	7.880.416	1,11
600.000	Loxam SAS*	3,25%	14/01/2025	605.970	0,09
800.000	Lseg Netherlands BV*	0,00%	06/04/2025	800.627	0,11
1.000.000	Mercedes-Benz Finance Co Ltd*	0,00%	21/08/2022	1.003.212	0,14
4.300.000	MMS USA Holdings Inc*	0,63%	13/06/2025	4.382.289	0,62
3.500.000	Molson Coors Beverage Co*	1,25%	15/07/2024	3.616.327	0,51
4.500.000	Morgan Stanley*	0,64%	26/07/2024	4.573.016	0,64
1.450.000	Mylan Inc*	2,13%	23/05/2025	1.548.182	0,22
4.500.000	Natwest Group Plc*	1,75%	02/03/2026	4.745.473	0,67
4.000.000	Natwest Group Plc*	2,00%	08/03/2023	4.059.732	0,57
5.000.000	Natwest Group Plc*	2,00%	04/03/2025	5.258.985	0,74
4.500.000	NatWest Markets Plc*	0,13%	18/06/2026	4.484.772	0,63
1.600.000	Ontex Group NV*	3,50%	15/07/2026	1.599.960	0,22
1.300.000	PCF GmbH*	4,75%	15/04/2026	1.329.555	0,19
1.528.000	Petroleos Mexicanos*	4,75%	26/02/2029	1.518.442	0,21
1.500.000	Picard Groupe SAS**	3,88%	01/07/2026	1.500.000	0,21
700.000	Pinnacle Bidco Plc*	5,50%	15/02/2025	719.138	0,10
900.000	Platin 1426 GmbH**	5,38%	15/06/2023	908.123	0,13
800.000	PLT VII Finance Sarl**	4,63%	05/01/2026	828.460	0,12
1.000.000	PSA Banque France SA*	0,63%	21/06/2024	1.017.712	0,14
1.300.000	RCI Banque SA*	0,00%	12/01/2023	1.304.758	0,18
2.000.000	RCI Banque SA*	0,04%	04/11/2024	2.008.186	0,28
1.200.000	RCI Banque SA*	0,50%	15/09/2023	1.213.092	0,17
3.720.000	RCI Banque SA*	1,00%	17/05/2023	3.786.625	0,53
1.700.000	Repsol International Finance BV*	2,50%	29/12/2049	1.712.742	0,24
1.000.000	Rolls-Royce Plc*	4,63%	16/02/2026	1.093.250	0,15
1.100.000	Ryanair DAC*	0,88%	25/05/2026	1.104.808	0,16
3.500.000	Ryanair DAC*	2,88%	15/09/2025	3.834.579	0,54
700.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB*	2,63%	29/12/2049	702.187	0,10

Neuberger Berman Ultra Short Term EURO Bond Fund (cont.)

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 EUR	% del Patrimonio neto
Bonos de empresa 72,31% (31 de diciembre de 2020: 70,33%) (cont.)					
Euro (cont.)					
1.000.000	Santander Consumer Finance SA ⁺	0,38%	17/01/2025	1.012.319	0,14
1.000.000	Santander Consumer Finance SA ⁺	1,13%	09/10/2023	1.030.425	0,14
6.232.000	Santander UK Group Holdings Plc ⁺	0,39%	28/02/2025	6.291.104	0,88
1.200.000	Sappi Papier Holding GmbH ⁺	3,63%	15/03/2028	1.203.114	0,17
884.000	Sazka Group AS ^{**}	3,88%	15/02/2027	895.757	0,13
2.500.000	Scania CV AB ⁺	0,00%	23/11/2022	2.505.900	0,35
2.000.000	Scania CV AB ⁺	0,50%	06/10/2023	2.024.753	0,28
1.400.000	SGL Carbon SE ⁺	4,63%	30/09/2024	1.433.509	0,20
3.655.000	Smurfit Kappa Acquisitions ULC ⁺	2,88%	15/01/2026	4.047.752	0,57
3.000.000	Societe Generale SA ⁺	0,13%	24/02/2026	3.013.182	0,42
1.200.000	Societe Generale SA ⁺	1,13%	23/01/2025	1.241.672	0,17
1.000.000	SoftBank Group Corp ⁺	5,00%	15/04/2028	1.121.820	0,16
400.000	Solvay SA ⁺	2,50%	29/12/2049	413.350	0,06
3.000.000	Stellantis NV ⁺	3,75%	29/03/2024	3.302.217	0,46
1.800.000	Stellantis NV ⁺	4,50%	07/07/2028	2.248.301	0,32
800.000	Telefonica Europe BV ⁺	2,38%	29/12/2049	783.347	0,11
3.000.000	Thames Water Utilities Finance Plc ⁺	0,19%	23/10/2023	3.011.978	0,42
2.000.000	Thermo Fisher Scientific Inc ⁺	2,00%	15/04/2025	2.145.798	0,30
900.000	TotalEnergies SE ⁺	1,63%	29/12/2049	902.088	0,13
800.000	Traton Finance Luxembourg SA ⁺	0,13%	24/03/2025	802.180	0,11
11.000.000	UBS AG ⁺	0,01%	31/03/2026	10.989.132	1,55
2.000.001	Unibail-Rodamco-Westfield SE ⁺	0,00%	01/07/2021	5.761.202	0,81
2.000.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE ⁺	2,13%	29/12/2049	1.984.880	0,28
2.500.000	UniCredit Leasing Corp. IFN SA ⁺	0,50%	18/10/2022	2.518.487	0,35
4.000.000	UniCredit SpA ^{**}	0,16%	30/06/2023	4.019.886	0,57
1.889.000	UniCredit SpA ^{**}	0,50%	09/04/2025	1.910.332	0,27
2.200.000	UniCredit SpA ⁺	2,00%	23/09/2029	2.218.927	0,31
800.000	UPCB Finance VII Ltd ⁺	3,63%	15/06/2029	818.914	0,12
900.000	Veolia Environnement SA ⁺	2,50%	29/12/2049	906.791	0,13
500.000	Virgin Media Finance Plc ^{**}	3,75%	15/07/2030	500.762	0,07
1.600.000	Virgin Money UK Plc ⁺	0,38%	27/05/2024	1.611.272	0,23
1.000.000	Vivion Investments Sarl ⁺	3,00%	08/08/2024	999.030	0,14
1.600.000	Vodafone Group Plc ⁺	3,00%	27/08/2080	1.647.310	0,23
4.200.000	Volkswagen International Finance NV ⁺	0,05%	10/06/2024	4.208.753	0,59
2.000.000	Volkswagen International Finance NV ⁺	3,88%	29/12/2049	2.225.302	0,31
1.000.000	Volkswagen Leasing GmbH ^{**}	2,38%	06/09/2022	1.031.042	0,14
8.000.000	Volkswagen Leasing GmbH ⁺	2,63%	15/01/2024	8.548.896	1,20
1.500.000	Volvo Treasury AB ⁺	0,00%	11/02/2023	1.507.216	0,21

Neuberger Berman Ultra Short Term EURO Bond Fund (cont.)

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 EUR	% del Patrimonio neto
Bonos de empresa 72,31% (31 de diciembre de 2020: 70,33%) (cont.)					
Euro (cont.)					
1.800.000	Volvo Treasury AB*	0,10%	24/05/2022	1.807.519	0,25
1.700.000	Vonovia SE*	0,38%	16/06/2027	1.702.867	0,24
5.500.000	Wells Fargo & Co*	0,50%	26/04/2024	5.588.291	0,79
10.000.000	Wells Fargo & Co*	1,34%	04/05/2025	10.370.760	1,46
5.500.000	Wizz Air Finance Co BV*	1,35%	19/01/2024	5.622.138	0,79
1.000.000	ZF Finance GmbH*	3,75%	21/09/2028	1.097.200	0,15
Total bonos de empresa				514.254.238	72,31
Bonos del Estado 4,28% (31 de diciembre de 2020: 5,55%)					
Euro					
100.000	Acquirente Unico SpA*	2,80%	20/02/2026	110.745	0,02
1.276.500	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond*	0,10%	15/04/2033	1.547.202	0,22
1.775.367	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond*	0,50%	15/04/2030	2.143.401	0,30
2.398.728	French Republic Government Bond OAT*	0,10%	25/07/2031	2.771.516	0,39
2.497.968	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,40%	11/04/2024	2.579.329	0,36
991.408	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	0,40%	15/05/2030	1.071.296	0,15
504.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,60%	01/08/2031	493.641	0,07
3.056.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	0,95%	01/12/2031	3.082.266	0,43
2.153.238	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,40%	26/05/2025	2.326.776	0,33
1.000.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,70%	01/09/2051	969.087	0,14
1.976.223	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	3,10%	15/09/2026	2.417.711	0,34
750.000	Italy Government International Bond*	5,13%	31/07/2024	867.947	0,12
1.147.000	Latvia Government International Bond*	0,00%	24/01/2029	1.146.736	0,16
3.480.000	Romanian Government International Bond*	3,88%	29/10/2035	4.096.239	0,58
1.600.000	Slovenia Government Bond*	0,13%	01/07/2031	1.599.984	0,23
1.848.000	Spain Government Bond*	0,50%	31/10/2031	1.851.378	0,26
1.098.006	Spain Government Inflation Linked Bond*	0,70%	30/11/2033	1.305.624	0,18
Total bonos del Estado				30.380.878	4,28
Total inversiones				660.704.432	92,91

Contratos de divisas a plazo 0,06% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto
Clases CHF con cobertura						
693.725 CHF	629.045 €	19/07/2021	Citibank NA	1	3.873	0,00
693.725 CHF	629.017 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	3.901	0,00
683.371 CHF	620.001 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	3.471	0,00

Neuberger Berman Ultra Short Term EURO Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,06% (31 de diciembre de 2020: 0,00%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto
Clases USD con cobertura						
16.980.414 USD	14.162.830 €	19/07/2021	Citibank NA	2	150.605	0,02
17.236.467 USD	14.373.632 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	155.640	0,02
16.726.975 USD	13.965.378 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	134.424	0,02
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					451.914	0,06

Contratos de futuros 0,01% (31 de diciembre de 2020: 0,01%)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto
61	Euro-BTP Future September 2021	56.120	0,01
(42)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2021	29.960	0,00
(264)	Euro-Schatz Future September 2021	5.280	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de futuros [*]		91.360	0,01

Contratos de swap sobre inflación (0,06%) (31 de diciembre de 2020: 0,03%)

Importe notional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar) [#]	Tipo fijo	Tipo variable	Plusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto	
EUR	16.280.000	29/03/2024	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	0,98%	CPTFEMU	170.872	0,02
EUR	3.000.000	11/02/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,26%	CPTFEMU	127.761	0,02
EUR	2.500.000	12/02/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,26%	CPTFEMU	108.722	0,02
EUR	4.000.000	21/06/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,52%	CPTFEMU	11.717	0,00
EUR	1.600.000	15/02/2022	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	0,99%	CPTFEMU	4.492	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de swap sobre inflación[∞]						423.564	0,06	

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

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

¹Swap liquidada centralmente.

	Valor razonable EUR	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	661.671.270	93,04

Neuberger Berman Ultra Short Term EURO Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,00%) (31 de diciembre de 2020: (0,34%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto
Clases CHF con cobertura						
233.371 €	257.550 CHF	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	(1.604)	(0,00)
Clases USD con cobertura						
25.778 €	31.316 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(620)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(2.224)	(0,00)

Contratos de futuros (0,04%) (31 de diciembre de 2020: (0,06%))

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto
(149)	Euro-BOBL Future September 2021	(13.410)	(0,00)
(92)	Euro-Bund Future September 2021	(88.880)	(0,01)
(284)	Euro-OAT Future September 2021	(165.570)	(0,02)
185	Euro-Bund Future July 2021	(23.612)	(0,01)
Minusvalía latente total sobre contratos de futuros [*]		(291.472)	(0,04)

Contratos de swap sobre inflación (0,03%) (31 de diciembre de 2020: (0,01%))

Importe notional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar) [#]	Tipo fijo	Tipo variable	Minusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto	
EUR	16.280.000	29/03/2024	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	1,40%	CPTFEMU	(212.162)	(0,03)
Minusvalía latente total sobre contratos de swap sobre inflación[∞]						(212.162)	(0,03)	

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

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

¹Swap liquidada centralmente.

Contratos de credit default swap (0,23%) (31 de diciembre de 2020: 0,00%)

Importe notional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Obligación referenciada	Valor razonable EUR	% del Patrimonio neto	
EUR	13.000.000	20/06/2026	ICE Clear U.S. ¹	Buying default protection on iTraxx Europe Crossover	(1.612.156)	(0,23)
Total valor razonable en contratos de credit default swap[∞]				(1.612.156)	(0,23)	

¹Swap liquidada centralmente.

Neuberger Berman Ultra Short Term EURO Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

	Valor razonable EUR	% del Patri- monio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(2.118.014)	(0,30)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	659.553.256	92,74
Otro activo neto	51.609.221	7,26
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	711.162.477	100,00

Análisis de la cartera	EUR	% de los Activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	506.476.391	68,90
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	154.227.501	20,98
± Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	(200.112)	(0,03)
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(951.064)	(0,13)
Total inversiones	659.553.256	89,72

Neuberger Berman Ultra Short Term EURO Bond Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste EUR
13.900.000	BPCE SA, 0.63%, 28/04/2025	14.268.919
13.000.000	UBS AG, 0.01%, 31/03/2026	12.969.548
8.238.981	French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 25/07/2031	9.556.776
9.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.01%, 11/05/2026	8.966.650
8.500.000	Wells Fargo & Co, 1.34%, 04/05/2025	8.828.668
8.000.000	Intesa Sanpaolo SpA, 2.13%, 26/05/2025	8.632.875
8.288.800	Miravet S.a r.l. Series 20019-1 Class A, 0.00%, 26/05/2065	8.292.368
7.000.000	Lloyds Banking Group Plc, 3.50%, 01/04/2026	7.890.330
7.800.000	Primrose Residential 2021-1 Series 2021-1 Class A, 0.00%, 24/03/2061	7.768.020
7.000.000	General Electric Co, 0.88%, 17/05/2025	7.207.500
6.700.000	CK Hutchison Finance 16 Ltd, 1.25%, 06/04/2023	6.870.827
6.000.000	Volkswagen Leasing GmbH, 2.63%, 15/01/2024	6.422.340
6.232.000	Santander UK Group Holdings Plc, 0.39%, 28/02/2025	6.284.803
6.200.000	Hellenic Republic, 0.75%, 18/06/2031	6.141.000
6.000.000	LKQ European Holdings BV, 3.63%, 01/04/2026	6.120.000
6.000.000	Danske Bank, 1.38%, 24/05/2023	6.085.250
5.700.000	Bank of America Corp, 0.81%, 09/05/2026	5.848.998
5.500.000	Wizz Air Finance Co BV, 1.35%, 19/01/2024	5.573.842
5.500.000	FCA Bank SpA, 0.13%, 16/11/2023	5.521.125
5.000.000	Credit Agricole SA, 1.38%, 13/03/2025	5.267.500

Neuberger Berman Ultra Short Term EURO Bond Fund (cont.)

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
5.874.831	French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 25/07/2031	6.824.689
6.200.000	Hellenic Republic, 0.75%, 18/06/2031	6.082.588
5.414.797	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.40%, 26/05/2025	5.787.657
5.000.000	Goldman Sachs Group Inc, 3.25%, 01/02/2023	5.352.500
5.000.000	Banque Internationale a Luxembourg SA, 0.00%, 03/02/2022	5.014.500
5.000.000	Deutsche Bank AG, 0.11%, 10/09/2021	5.008.850
4.000.000	Natwest Group Plc, 2.75%, 02/04/2025	4.419.200
3.919.530	Reseau Ferre de France, 2.45%, 28/02/2023	4.209.575
4.000.000	NatWest Markets Plc, 1.13%, 14/06/2023	4.104.000
4.000.000	Unione di Banche Italiane SpA, 0.75%, 17/10/2022	4.060.000
4.000.000	Bank of America Corp, 0.16%, 25/04/2024	4.028.520
3.661.785	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.55%, 21/05/2026	3.784.931
3.706.000	Hutchison Whampoa Finance 14 Ltd, 1.38%, 31/10/2021	3.746.001
3.755.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.85%, 30/07/2037	3.706.232
3.500.000	Volkswagen Bank GmbH, 0.38%, 05/07/2022	3.523.590
3.300.000	Intesa Sanpaolo SpA, 1.08%, 03/03/2023	3.374.250
3.248.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.25%, 15/03/2028	3.229.453
3.000.000	Athene Global Funding, 1.88%, 23/06/2023	3.129.300
3.000.000	UniCredit SpA, 1.00%, 18/01/2023	3.054.720
3.000.000	Societe Generale SA, 0.50%, 13/01/2023	3.036.060
2.895.000	Croatia Government International Bond, 3.88%, 30/05/2022	3.028.749
2.600.000	French Republic Government Bond OAT, 1.50%, 25/05/2031	2.961.972
3.000.000	Ford Motor Credit Co LLC, 0.00%, 07/12/2022	2.955.100
2.870.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.70%, 01/09/2051	2.868.138

Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I EUR en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 0,17%. En el mismo periodo, el índice Bloomberg Barclays US Aggregate Index (Total Return, Hedged, EUR) rindió un -2,28%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

En el primer semestre del año la pandemia por COVID-19 volvió a estar controlada en la zona euro, fruto de la aceleración de las campañas de vacunación. La rápida normalización de la economía todavía en curso propició un repunte de los activos de riesgo, como la renta variable, mientras que los precios del mercado de bonos se vieron sometidos a presión: a mediados de mayo, el bund alcanzó su nivel más bajo en un año, aunque finalizó el periodo con un aumento de 36 puntos básicos, terminando así con un rendimiento del -0,21% en el caso del bund alemán a 10 años. De hecho, la mayoría de países del euro suavizaron las restricciones sociales, con la consiguiente reapertura de los sectores de servicios. Esto se tradujo en creación de empleo y en un brusco aumento de la confianza en la actividad: los indicadores adelantados de la zona euro, como el IFO alemán, alcanzaron su nivel más alto en años. El desglose del PIB alemán del 1T mostró un inesperado crecimiento sostenible del CapEx. La producción de las fábricas de la zona euro ha vuelto a marcar sus niveles previos a la crisis, tal como reflejan los sólidos indicadores PMI de la región, que aumentaron por quinto mes consecutivo. El optimismo se extendió a los países periféricos, donde los indicadores PMI de servicios se dispararon hasta registrar un fuerte nivel de crecimiento. El PIB de Italia relativo al primer trimestre se revisó hasta situarse en territorio positivo.

En este contexto, el bajísimo nivel de rendimientos llevó a los gestores de la cartera a intentar crear una infraexposición a duración, situándose en alrededor de menos un año con respecto al índice de referencia. Nuestro enfoque consistió en gestionar activamente esta estrategia para sacar provecho de la volatilidad del mercado. Por esa razón preferimos participar a través de derivados y sus respectivas opciones. A menudo gestionamos una exposición larga a opciones de venta sobre bunds a 10 años para aprovechar la volatilidad del mercado en el contexto de una tendencia bajista. Esta apuesta activa representa la mayor contribución a la rentabilidad superior de la cartera.

Asimismo, recogimos beneficios de nuestra exposición sobreponderada a los países periféricos y los reinvertimos en valores de agencias supranacionales o del euro, por ejemplo la Unión Europea, con vencimientos largos. Nuestra previsión a principios de este año de que se dispararía el programa de emisiones de los gobiernos nos indujo a recoger beneficios, sobre todo en nuestra exposición a bonos BTP italianos. En nuestra búsqueda de rentabilidad atractiva, compramos bonos del Estado griego a 5 años.

Por el contrario, el mercado de crédito se benefició de esta mejor perspectiva económica en el primer semestre, lo que implica un riesgo de impago de las empresas bastante más bajo de lo esperado. La razón de estos movimientos tan dispares entre los tipos y el diferencial de crédito es el llamado "reflation trade": todo el aumento de los tipos favoreció a las empresas porque procedió de las expectativas de inflación, fruto del fuerte encarecimiento de las materias primas y del inminente relanzamiento del gasto público. Además, el Banco Central Europeo ("BCE") convenció a los mercados de la estabilidad que ofrecía su política monetaria ultra expansiva a pesar de la recuperación de la inflación. En este sentido, explicó que el fuerte aumento de la tasa de inflación era solo un fenómeno transitorio debido a las interrupciones de la cadena de suministro producido dentro del ciclo de producción. De este modo, el BCE continúa preocupado por las incertidumbres que persisten a largo plazo (resurgimiento de la pandemia, ayudas temporales derivadas del relanzamiento del gasto público, interrupciones de la cadena de suministro, etc.), por lo que emitió el inequívoco mensaje de que no permitirá un endurecimiento prematuro de las condiciones financieras, por ejemplo, un nuevo aumento de los rendimientos. Por lo tanto, mantuvimos nuestra exposición sobreponderada en crédito de en torno a +1 año respecto al índice de referencia, la cual generó buenos resultados. Continuamos sobreponderados en bonos con calificación BBB e infraponderados en bonos con calificación AA y A respecto al índice de referencia. Gestionamos activamente nuestras selecciones de sectores y emisores. También seguimos aumentando nuestra exposición al sector bancario, al tiempo que recogimos beneficios en bonos corporativos que habían generado una rentabilidad muy superior a la del índice. En nuestra búsqueda de rentabilidades más altas, mantuvimos nuestra diversificación en exposiciones a bonos de alta rentabilidad que representan alrededor del 15% de los activos de la cartera. Todas estas exposiciones se gestionaron de manera activa para aprovechar la volatilidad del mercado y las oportunidades ofrecidas sobre todo en el mercado primario.

Durante los próximos meses creemos que los inversores deberían estar atentos a las consecuencias a largo plazo de la recuperación del crecimiento económico mundial. Los grandes planes de rescate fiscal implantados en todo el mundo, unido a la aceleración de las campañas de vacunación, deberían favorecer el aumento de la tasa de inflación en un contexto de brusco encarecimiento de las materias primas e interrupciones en la cadena de suministro. La nueva incógnita es cuánto tiempo debería permanecer la inflación por encima de su objetivo y luego cómo reaccionará el BCE ante eso.

Así pues, la normalización de la actividad en la zona euro debería llevar al mercado a preguntarse si la compra de bonos por parte del BCE podría reajustarse a la baja después del verano. En este contexto, auguramos que la prima de riesgo por rentabilidad comenzará a aumentar desde su nivel más bajo en décadas.

Como conclusión, al cierre del año auguramos unos tipos básicos más altos, fruto del rebote más largo y fuerte de la tasa de inflación. La mayor actividad debería favorecer al mercado de crédito, especialmente reforzado por la búsqueda de rentabilidades por parte de inversores que todavía cuentan con excedentes de efectivo.

Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 EUR	A 31 de diciembre de 2020 EUR
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		11.388.944	10.721.982
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	195.267	325.215
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		255.984	4.975
Cuentas por cobrar de intermediarios		201.384	149.148
Ingresos a percibir y otros activos		67.533	111.408
Activos totales		12.109.112	11.312.728
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		62.298	9.313
Descubierto bancario	3	175	123
Gastos devengados		16.847	24.260
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		789.419	2.373
Otras cuentas por pagar		29.038	14.159
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		897.777	50.228
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		11.211.335	11.262.500

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 EUR	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 EUR
Ingresos			
Ingresos por intereses		124.446	88.595
Ingresos varios		1	–
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(77.246)	109.028
		47.201	197.623
Gastos			
Comisión de gestión	5	19.398	18.254
Comisión de administración	5	19.139	17.410
Comisión de compromiso	16	854	582
Comisión de depósito	5	5.067	4.989
Comisión del Depositario	5	277	521
Honorarios profesionales	7	22.398	16.870
Honorarios de los Consejeros	6	2.003	1.935
Costes de transacciones	7	5.093	7.237
Honorarios de auditoría	7	3.433	7.022
Reembolso de IVA		(53)	(36)
Otros gastos	7	2.585	4.620
Gastos no asumidos	5	(48.930)	(55.416)
Gastos totales		31.264	23.988
Costes financieros			
Gastos por intereses		12	8
Repartos de dividendos abonados	1	67.090	45.636
		67.102	45.644
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		(51.165)	127.991

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	EUR	EUR
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	11.262.500	10.612.092
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	(51.165)	127.991
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	11.211.335	10.740.083

Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Importe principal	Descripción de los valores	Cupón	Fecha de vencimiento	Valor razonable EUR	% del Patrimonio neto
Valores respaldados por activos 3,88% (31 de diciembre de 2020: 4,19%)					
Euro					
157.502	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC Class A	0,95%	24/02/2058	157.758	1,41
157.298	Gedesco Trade Receivables 2020-1 DAC Class A	0,60%	24/01/2026	157.472	1,40
81.381	Jepson Residential Series 2019-1 DAC Class A	1,15%	24/11/2057	81.692	0,73
37.745	Pembroke Property Finance DAC Class A	0,66%	01/06/2037	37.799	0,34
Total valores respaldados por activos **				434.721	3,88
Bonos de empresa 45,91% (31 de diciembre de 2020: 43,85%)					
Euro					
100.000	ADLER Group SA*	2,25%	14/01/2029	97.311	0,87
100.000	American Tower Corp*	0,88%	21/05/2029	100.917	0,90
100.000	Anheuser-Busch InBev SA*	2,88%	02/04/2032	121.744	1,09
100.000	Athene Global Funding*	1,13%	02/09/2025	103.876	0,93
100.000	Bayer AG*	1,00%	12/01/2036	94.208	0,84
100.000	BP Capital Markets Plc*	3,63%	29/12/2049	108.991	0,97
200.000	Commerzbank AG*	6,13%	29/12/2049	220.990	1,97
100.000	Credit Agricole SA*	0,38%	20/04/2028	99.023	0,88
100.000	Credit Logement SA*	0,60%	29/12/2049	97.804	0,87
100.000	Credit Suisse Group AG*	0,46%	16/01/2026	100.671	0,90
100.000	Dexia Credit Local SA*	0,63%	17/01/2026	103.807	0,93
100.000	Digital Dutch Finco BV*	1,25%	01/02/2031	102.316	0,91
100.000	Dufry One BV*	3,38%	15/04/2028	99.500	0,89
200.000	Electricite de France SA*	3,38%	29/12/2049	209.279	1,87
100.000	Enel Finance International NV*	0,88%	17/06/2036	99.393	0,89
100.000	ENI SpA*	2,00%	29/12/2049	100.060	0,89
98.000	European Union*	0,00%	04/07/2031	97.823	0,87
34.000	European Union*	0,70%	06/07/2051	34.437	0,31
100.000	Fastighets AB Balder*	1,25%	28/01/2028	101.217	0,90
100.000	Fidelity National Information Services Inc*	1,00%	03/12/2028	103.038	0,92
100.000	Flamingo Lux II SCA*	5,00%	31/03/2029	99.553	0,89
89.000	Goldman Sachs Group Inc*	0,01%	30/04/2024	89.061	0,79
100.000	Grupo Antolin-Irausa SA*	3,50%	30/04/2028	99.878	0,89
100.000	Intrum AB*	3,00%	15/09/2027	99.173	0,88
100.000	Islandsbanki HF*	1,13%	19/01/2024	101.457	0,90
100.000	Kutxabank SA*	1,25%	22/09/2025	106.283	0,95
100.000	La Financiere Atalian SASU*	4,00%	15/05/2024	99.605	0,89
100.000	Landsbankinn HF*	0,50%	20/05/2024	100.554	0,90
100.000	Morgan Stanley*	0,41%	29/10/2027	100.396	0,90
100.000	Nationale-Nederlanden Bank NV*	1,00%	25/09/2028	107.609	0,96

Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund (cont.)

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 EUR	% del Patrimonio neto
Bonos de empresa 45,91% (31 de diciembre de 2020: 43,85%) (cont.)					
Euro (cont.)					
200.000	Ontex Group NV*	3,50%	15/07/2026	199.995	1,78
100.000	Petroleos Mexicanos*	4,75%	26/02/2029	99.374	0,89
200.000	Picard Bondco SA**	5,38%	01/07/2027	200.000	1,78
100.000	Pinnacle Bidco Plc*	5,50%	15/02/2025	102.734	0,92
100.000	PVH Corp**	3,13%	15/12/2027	113.810	1,02
100.000	Rolls-Royce Plc*	4,63%	16/02/2026	109.325	0,97
100.000	Sappi Papier Holding GmbH*	3,63%	15/03/2028	100.259	0,89
100.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd*	1,38%	09/07/2032	104.331	0,93
100.000	TotalEnergies SE*	1,63%	29/12/2049	100.232	0,89
100.000	Traton Finance Luxembourg SA*	1,25%	24/03/2033	101.538	0,91
100.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE*	2,13%	29/12/2049	99.244	0,89
200.000	UniCredit SpA*	4,45%	29/12/2049	200.000	1,78
100.000	Vivion Investments Sarl*	3,00%	08/08/2024	99.903	0,89
100.000	Volkswagen International Finance NV*	3,88%	29/12/2049	111.265	0,99
200.000	Westpac Banking Corp*	0,38%	02/04/2026	205.613	1,83
Total bonos de empresa				5.147.597	45,91
Bonos del Estado 51,60% (31 de diciembre de 2020: 47,12%)					
Euro					
100.000	Acquirente Unico SpA*	2,80%	20/02/2026	110.745	0,99
100.000	Adif Alta Velocidad*	0,95%	30/04/2027	105.338	0,94
75.000	Autonomous Community of Madrid Spain*	2,08%	12/03/2030	85.722	0,76
36.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	2,50%	15/08/2046	56.333	0,50
87.000	Cyprus Government International Bond*	0,00%	09/02/2026	87.586	0,78
61.272	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond*	0,10%	15/04/2033	74.266	0,66
53.623	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond**	0,10%	15/04/2046	76.528	0,68
86.078	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond*	0,50%	15/04/2030	103.922	0,93
224.459	French Republic Government Bond OAT*	0,10%	01/03/2025	238.867	2,13
99.710	French Republic Government Bond OAT*	0,10%	01/03/2028	110.745	0,99
233.738	French Republic Government Bond OAT*	0,10%	25/07/2031	270.063	2,41
54.000	French Republic Government Bond OAT*	1,50%	25/05/2050	62.807	0,56
202.621	French Republic Government Bond OAT**	1,85%	25/07/2027	248.666	2,22
100.000	Hellenic Republic Government Bond*	0,00%	12/02/2026	99.855	0,89
80.000	Hellenic Republic Government Bond*	0,75%	18/06/2031	79.468	0,71
21.000	Ireland Government Bond*	0,55%	22/04/2041	20.632	0,18
44.492	Ireland Government Bond*	1,30%	15/05/2033	50.018	0,45
20.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	0,30%	15/08/2023	20.265	0,18
58.742	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	0,40%	15/05/2030	63.476	0,57

Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund (cont.)

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 EUR	% del Patrimonio neto
Bonos del Estado 51,60% (31 de diciembre de 2020: 47,12%) (cont.)					
Euro (cont.)					
28.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,60%	01/08/2031	27.425	0,24
120.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,65%	15/10/2023	122.629	1,09
58.317	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,65%	28/10/2027	61.921	0,55
83.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,85%	15/01/2027	85.883	0,77
162.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	0,90%	01/04/2031	163.921	1,46
99.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	0,95%	01/12/2031	99.851	0,89
119.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	1,35%	01/04/2030	126.054	1,12
156.691	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,40%	26/05/2025	169.319	1,51
350.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,45%	15/11/2024	368.820	3,29
128.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,45%	15/05/2025	135.499	1,21
60.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	1,45%	01/03/2036	61.859	0,55
46.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	1,50%	30/04/2045	44.710	0,40
80.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,60%	01/06/2026	85.838	0,77
25.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,70%	01/09/2051	24.227	0,22
100.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	1,85%	01/07/2025	107.507	0,96
145.886	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	2,60%	15/09/2023	159.297	1,42
125.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	3,00%	01/08/2029	149.046	1,33
44.042	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	3,10%	15/09/2026	53.880	0,48
150.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	4,00%	01/02/2037	207.010	1,85
75.000	Kingdom of Belgium Government Bond*	1,45%	22/06/2037	86.556	0,77
51.200	Kingdom of Belgium Government Bond*	1,60%	22/06/2047	60.475	0,54
157.000	Netherlands Government Bond*	4,00%	15/01/2037	251.948	2,25
69.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT**	0,30%	17/10/2031	68.365	0,61
20.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*	0,48%	18/10/2030	20.393	0,18
14.750	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*	4,10%	15/02/2045	23.884	0,21
33.000	Republic of Austria Government Bond*	0,70%	20/04/2071	31.504	0,28
100.000	Republic of Latvia Government Bond*	0,00%	24/01/2029	99.977	0,89
52.000	Romanian Government International Bond**	2,88%	26/05/2028	58.134	0,52
78.000	Romanian Government International Bond*	2,88%	11/03/2029	86.488	0,77
72.000	Romanian Government International Bond*	3,62%	26/05/2030	83.400	0,74
137.000	Romanian Government International Bond*	3,88%	29/10/2035	161.260	1,44
53.000	Slovenia Government Bond*	0,13%	01/07/2031	52.999	0,47
57.648	SNCF Reseau*	2,45%	28/02/2023	61.170	0,55
80.000	Spain Government Bond*	0,50%	31/10/2031	80.146	0,72
83.000	Spain Government Bond*	0,85%	30/07/2037	81.743	0,73
112.000	Spain Government Bond*	1,45%	31/10/2027	122.561	1,09
21.000	Spain Government Bond*	2,90%	31/10/2046	28.370	0,25

Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund (cont.)

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 EUR	% del Patrimonio neto
Bonos del Estado 51,60% (31 de diciembre de 2020: 47,12%) (cont.)					
Euro (cont.)					
71.000	Spain Government Bond ¹	4,20%	31/01/2037	106.081	0,95
Total bonos del Estado				5.785.452	51,60
Total inversiones				11.367.770	101,39

Contratos de futuros 0,03% (31 de diciembre de 2020: 0,01%)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto	
5	Euro-BOBL Future September 2021	400	0,00	
1	Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2021	3.020	0,03	
Plusvalía latente total sobre contratos de futuros ±			3.420	0,03

Contratos de swap sobre inflación (0,15%) (31 de diciembre de 2020: 0,03%)

Importe notional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar) [#]	Tipo fijo	Tipo variable	Plusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto	
EUR	720.000	29/03/2024	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	0,98%	FRCPXTOB	7.557	0,07
EUR	100.000	12/02/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,26%	CPTFEMU	4.349	0,04
EUR	100.000	11/02/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,26%	CPTFEMU	4.259	0,04
EUR	100.000	21/06/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,52%	CPTFEMU	293	0,00
EUR	200.000	15/02/2022	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	0,99%	CPTFEMU	561	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de swaps sobre inflación[∞]						17.019	0,15	

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

(Pagar) - El Fondo paga un tipo variable y recibe un tipo fijo.

¹ Swap liquidada centralmente.

Contratos de swap de tipos de interés 0,01% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)

Importe notional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar) [#]	Tipo fijo	Tipo variable	Plusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto	
EUR	96.164	23/02/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	0,00%	6M EURIBOR	735	0,01
Plusvalía latente total sobre contratos de swap de tipos de interés[∞]						735	0,01	

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

(Pagar) - El Fondo paga un tipo variable y recibe un tipo fijo.

¹ Swap liquidada centralmente.

				Valor razonable EUR	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados				11.388.944	101,58

Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de futuros (0,09%) (31 de diciembre de 2020: (0,04%))

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto
(2)	Euro-BTP Future September 2021	(1.740)	(0,02)
(5)	Euro-Bund Future September 2021	(4.120)	(0,04)
(4)	Euro-OAT Future September 2021	(1.980)	(0,02)
20	Euro-Bund Put Option on Future July 2021, Strike Price EUR 169	(1.033)	(0,01)
5	Euro-Bund Put Option on Future July 2021, Strike Price EUR 171	(638)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de futuros±		(9.511)	(0,09)

Contratos de swap sobre inflación (0,08%) (31 de diciembre de 2020: (0,03%))

Importe nocional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar)#	Tipo fijo	Tipo variable	Minusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto	
EUR	720.000	29/03/2024	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	1,40%	CPTFEMU	(9.383)	(0,08)
Minusvalía latente total sobre contratos de swap sobre inflación[∞]							(9.383)	(0,08)

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

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

¹Swap liquidada centralmente.

Contratos de credit default swap (0,38%) (31 de diciembre de 2020: (0,00%))

Importe nocional	Fecha de vencimiento	Contraparte	Obligación referenciada	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto	
EUR	350.000	20/06/2026	ICE Clear U.S. ¹	Buying default protection on iTraxx Europe Crossover	(43.404)	(0,38)
Minusvalía latente total sobre contratos de credit default swap [∞]					(43.404)	(0,38)

	Valor razonable EUR	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(62.298)	(0,55)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	11.326.646	101,03
Otro pasivo neto	(115.311)	(1,03)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	11.211.335	100,00

Análisis de la cartera	EUR	% de los Activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	8.665.798	71,57
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	2.701.972	22,31
± Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	(6.091)	(0,05)
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(35.033)	(0,29)
Total inversiones	11.326.646	93,54

Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste EUR
418.272	French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 25/07/2031	487.662
453.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.90%, 01/04/2031	469.442
250.000	Intesa Sanpaolo SpA, 1.35%, 24/02/2031	245.140
200.000	Unione di Banche Italiane SpA, 5.88%, 29/12/2049	216.000
208.174	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.55%, 21/05/2026	214.748
200.000	Commerzbank AG, 6.13%, 29/12/2049	214.500
191.620	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.40%, 26/05/2025	206.104
200.000	Autostrade per l'Italia, 2.00%, 04/12/2028	204.861
200.000	TotalEnergies SE, 1.63%, 29/12/2049	200.900
200.000	Deutsche Bank AG, 4.63%, 29/12/2049	200.006
200.000	Morgan Stanley, 0.41%, 29/10/2027	200.000
200.000	Ontex Group NV, 3.50%, 15/07/2026	200.000
200.000	Picard Bondco SA, 5.38%, 01/07/2027	200.000
200.000	UniCredit SpA, 4.45%, 29/12/2049	200.000
200.000	JPMorgan Chase & Co, 0.60%, 17/02/2033	200.000
200.000	American Tower Corp, 0.88%, 21/05/2029	199.846
200.000	UBS AG, 0.50%, 31/03/2031	199.262
200.000	BNP Paribas SA, 0.25%, 13/04/2027	198.814
200.000	Societe Generale SA, 1.13%, 30/06/2031	198.790
200.000	Credit Suisse Group AG, 0.63%, 18/01/2033	198.120
200.000	Abertis Finance BV, 2.63%, 29/12/2049	197.192
200.000	Verizon Communications Inc, 1.13%, 19/09/2035	196.916
200.000	Enel Finance International NV, 0.88%, 17/06/2036	196.122
179.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.35%, 01/04/2030	193.254
168.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.25%, 15/03/2028	167.362

Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund (cont.)

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
418.160	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.40%, 26/05/2025	446.614
369.023	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.55%, 21/05/2026	383.832
291.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.90%, 01/04/2031	294.769
250.000	Intesa Sanpaolo SpA, 1.35%, 24/02/2031	249.200
189.391	Spain Government Bond, 1.00%, 30/11/2030	229.316
200.000	Intesa Sanpaolo SpA, 6.25%, 29/12/2049	219.750
189.081	French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 25/07/2031	219.021
200.000	Unione di Banche Italiane SpA, 5.88%, 29/12/2049	216.320
200.000	Autostrade per l'Italia, 2.00%, 04/12/2028	208.825
200.000	Deutsche Bank AG, 4.63%, 29/12/2049	206.100
200.000	Societe Generale SA, 1.13%, 30/06/2031	199.340
200.000	BNP Paribas SA, 0.25%, 13/04/2027	199.077
200.000	JPMorgan Chase & Co, 0.60%, 17/02/2033	198.435
200.000	Credit Suisse Group AG, 0.63%, 18/01/2033	198.095
200.000	UBS AG, 0.50%, 31/03/2031	197.988
200.000	Abertis Finance BV, 2.63%, 29/12/2049	196.425
200.000	Verizon Communications Inc, 1.13%, 19/09/2035	195.207
168.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.25%, 15/03/2028	167.659
150.000	European Union, 0.00%, 02/06/2028	153.717
150.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.65%, 15/10/2023	153.285
139.551	French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 01/03/2026	152.719

Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I EUR en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 2,15%. Durante el mismo periodo, el ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (Total Return, EUR) (el "Índice") registró una rentabilidad del -0,34%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

En el primer semestre de 2021, la pandemia por COVID-19 volvió a estar controlada en la zona euro, fruto de la aceleración de las campañas de vacunación. La rápida normalización de la economía todavía en curso propició un repunte de los activos de riesgo, como la renta variable, mientras que los precios del mercado de bonos se vieron sometidos a presión: a mediados de mayo, el bund alcanzó su nivel más bajo en un año, aunque finalizó el periodo con un aumento de 36 puntos básicos, terminando así con un rendimiento del -0,21% en el caso del bund alemán a 10 años. De hecho, la mayoría de países del euro suavizaron las restricciones sociales, con la consiguiente reapertura de los sectores de servicios. Esto se tradujo en creación de empleo y en un brusco aumento de la confianza en la actividad: los indicadores adelantados de la zona euro, como el IFO alemán, alcanzaron su nivel más alto en años. El desglose del PIB alemán del 1T mostró un inesperado crecimiento sostenible del Capex. La producción de las fábricas de la zona euro ha vuelto a marcar sus niveles previos a la crisis, tal como reflejan los sólidos indicadores PMI de la región, que aumentaron por quinto mes consecutivo. El optimismo se extendió a los países periféricos, donde los indicadores PMI de servicios se dispararon hasta registrar un fuerte nivel de crecimiento. El PIB de Italia relativo al primer trimestre se revisó hasta situarse en territorio positivo.

Durante el semestre cerrado a 30 de junio de 2021, la Cartera se posicionó en corto en duración en países centrales con sesgo hacia el pronunciamiento de la curva de tipos (la buena tendencia era el pronunciamiento en 5/30 años) debido a la amplia oferta de deuda pública en el tramo largo.

Luego, el aumento de los rendimientos nos llevó a recomprar duración paso a paso mediante la compra de valores supranacionales y bonos emitidos por los gobiernos de Francia y Alemania desde febrero hasta final de marzo, periodo en el recogimos beneficios en nuestra estrategia sobre el pronunciamiento de la curva de tipos canjeando la posición corta en vencimientos a 30 años por una posición corta en vencimientos a 10 años. Luego, durante el segundo trimestre, el bajísimo nivel de rendimientos nos llevó a centrarnos en nuestra posición corta en duración en países centrales. Nuestro enfoque consistió en gestionar activamente esta estrategia para sacar provecho de la volatilidad del mercado, cosa que pudimos hacer en numerosas ocasiones (posiciones NFP, IPC de EE. UU, reunión del FOMC). Por esa razón, preferimos participar a través de derivados y sus respectivas opciones para aprovechar la volatilidad del mercado en el contexto de una tendencia bajista. Cabe estimar que un tercio de la rentabilidad de la Cartera en el primer semestre se debe a nuestra exposición corta en países centrales y semicentrales.

En deuda pública, durante el primer trimestre redujimos drásticamente la exposición a la Península Ibérica, especialmente Portugal. Nuestra principal exposición a deuda pública es Italia, donde Mario Draghi puede formar un gobierno de "unión nacional" compuesto por las principales fuerzas políticas y tecnócratas. Draghi, al ser responsable de la relación con la Unión Europea, constituye una garantía para los socios europeos de que los fondos de recuperación de la región se gastarán de manera eficiente. Luego, a principios del segundo trimestre, recomparamos la posición en España frente a Portugal después de ampliarse 10 pb. Hemos participado en muchos emisores primarios por la prima que ofrecen algunos (Italia 50y, Andorra 10y), así como en nuevas emisiones de UE NGEN (10Y y 30Y) lanzadas para financiar la recuperación de Europa tras la COVID-19 y sus consecuencias. Nos gustan estos valores supranacionales con calificación AAA porque podrían representar una alternativa de inversión a los países semicentrales e incluso a los países centrales a medio plazo. Nos decantamos por los países que más deberían beneficiarse de las subvenciones y préstamos asociados al fondo de recuperación europea.

Mantuvimos nuestra exposición larga a crédito en aprox. +1 año, nuestra exposición absoluta a duración en Alta Rentabilidad ("HY") y +1,8 años en Grado de Inversión ("crédito IG"). Continuamos expuestos al segmento con calificación BBB. Gestionamos activamente nuestras selecciones de sectores y emisores. También seguimos aumentando nuestra exposición al sector bancario, al tiempo que recogimos beneficios en bonos corporativos que habían generado una rentabilidad superior. En nuestra búsqueda de rendimientos más altos, mantuvimos nuestra diversificación en exposiciones a bonos de alta rentabilidad (HY) que representan alrededor del 20% de los activos de la Cartera. Todas estas exposiciones se gestionaron de manera activa para aprovechar la volatilidad del mercado y las oportunidades ofrecidas sobre todo en el mercado primario. Un tercio de la rentabilidad de la Cartera se atribuye a la exposición a crédito.

Durante el primer trimestre reforzamos nuestras posiciones en títulos vinculados a la inflación (de la zona euro y de EE. UU., "TIPS"). La inflación subyacente en Europa se movió inesperadamente al alza en enero tras un formidable repunte de las expectativas de inflación y, por otro lado, los precios del barril Brent han seguido subiendo debido a los recortes de producción que habían prometido realizar los miembros de la OPEP+ y a la mayor demanda de petróleo global. El deseo de obtener protección frente a la inflación fue elevado en marzo tras la consolidación experimentada en febrero. Al invertir en swaps de inflación participamos activamente para generar alfa en vencimientos a 10 años, donde surgieron algunas oportunidades de la volatilidad en tipos reales. El segundo trimestre resultó más volátil para nuestras posiciones en títulos vinculados a la inflación (TIPS de la zona euro y EE. UU). Las expectativas de inflación comenzaron a sufrir vaivenes con la publicación del IPC estadounidense a mediados de mayo. Desde entonces, aún con fundamentales favorables, hemos adoptado un enfoque oportunista y flexible en swaps de inflación o bonos de caja para generar una rentabilidad adicional. Estimamos que un tercio de la rentabilidad de la Cartera se atribuye a la exposición a la tasa de inflación implícita. La inflación, que la Reserva Federal estadounidense considera transitoria y poco relevante a juicio del Banco Central Europeo (BCE), va a permanecer alta durante los próximos seis meses; de ahí que mantengamos nuestro optimismo respecto a esta clase de activos ante el compromiso del BCE de impedir que los rendimientos reales suban demasiado.

Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (cont.)

Informe del Gestor de inversiones (cont.)

Debido a la reapertura de la actividad en Estados Unidos, al auge del mercado inmobiliario y a los cuellos de botella que presentan algunas cadenas de suministro (coches de ocasión, por ejemplo), el IPC de EE. UU. se mantendrá por encima del 4% en el transcurso de los próximos meses, lo cual favorece nuestra exposición a TIPS estadounidenses vinculados a la tasa de inflación implícita con vencimientos de entre 7 y 10 años, apuntando a tasas de inflación implícita más altas en los próximos meses.

Durante los próximos meses creemos que los inversores deberían estar atentos a las consecuencias a largo plazo de la recuperación del crecimiento económico mundial. Los grandes planes de rescate fiscal implantados en todo el mundo, unido a la aceleración de las campañas de vacunación, deberían favorecer el aumento de la tasa de inflación en un contexto de brusco encarecimiento de las materias primas e interrupciones en la cadena de suministro. La nueva incógnita es cuánto tiempo debería permanecer la inflación por encima de su objetivo y luego cómo reaccionará el BCE ante eso.

Así pues, la normalización de la actividad en la zona euro debería llevar al mercado a preguntarse si la compra de bonos por parte del BCE podría reajustarse a la baja después del verano. En este contexto, auguramos que la prima de riesgo por rentabilidad comenzará a aumentar desde su nivel más bajo en décadas.

Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 EUR	A 31 de diciembre de 2020 EUR
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		46.704.785	41.832.865
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	3.027.253	2.814.734
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		629.400	21.484
Cuentas por cobrar de intermediarios		996.860	686.359
Ingresos a percibir y otros activos		217.518	307.405
Activos totales		51.575.816	45.662.847
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		369.902	623.382
Descubierto bancario	3	1.084	1.123
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		–	7.629
Gastos devengados		37.002	38.688
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		2.843.946	–
Otras cuentas por pagar		84.656	39.122
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		3.336.590	709.944
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		48.239.226	44.952.903

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 EUR	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 EUR
Ingresos			
Ingresos por intereses		520.560	547.058
Ingresos por dividendos		–	285
Ingresos por préstamo de valores	15	808	–
Ingresos varios		22	–
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		1.056.102	(3.122.008)
		1.577.492	(2.574.665)
Gastos			
Comisión de gestión	5	57.858	74.610
Comisión de administración	5	39.170	56.212
Comisión de compromiso	16	4.512	2.177
Comisión de depósito	5	5.819	5.065
Comisión del Depositario	5	1.162	3.355
Honorarios profesionales	7	34.283	21.934
Honorarios de los Consejeros	6	1.995	1.935
Costes de transacciones	7	18.541	32.697
Honorarios de auditoría	7	3.704	7.266
Reembolso de IVA		(216)	(213)
Otros gastos	7	13.205	7.449
Gastos no asumidos	5	(68.406)	(65.291)
Gastos totales		111.627	147.196
Costes financieros			
Gastos por intereses		981	1.219
Repartos de dividendos abonados	1	71.782	58.343
		72.763	59.562
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		1.393.102	(2.781.423)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 EUR	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 EUR
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	44.952.903	81.049.402
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	1.393.102	(2.781.423)
Suscripciones	4.226.220	5.241.482
Reembolsos	(2.332.999)	(22.834.177)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	48.239.226	60.675.284

T

Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (cont.)

Cartera de inversiones

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Importe principal	Descripción de los valores	Cupón	Fecha de vencimiento	Valor razonable EUR	% del Patrimonio neto
Valores respaldados por activos (ABS) 7,08% (31 de diciembre de 2020: 8,55%)					
Euro					
748.038	European Residential Loan Securitisation 2018-1 DAC Class A	1,45%	24/03/2061	749.121	1,55
787.511	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC Class A	0,95%	24/02/2058	788.791	1,64
301.818	Futura S.r.l. Series 2019-1 Class A	2,47%	31/07/2044	303.058	0,63
925.281	Gedesco Trade Receivables 2020-1 DAC Class A	0,64%	24/01/2026	926.304	1,92
300.000	Jepson Residential Series 2019-1 DAC Class C	0,99%	24/11/2057	301.418	0,62
118.896	Pembroke Property Finance DAC Class A	0,66%	01/06/2037	119.067	0,25
227.672	Pepper Residential Securities Trust No 25 Series 25X Class A1	0,70%	12/03/2061	228.020	0,47
Total valores respaldados por activos **				3.415.779	7,08
Bonos de empresa 36,78% (31 de diciembre de 2020: 44,62%)					
Euro					
100.000	Accor SA*	2,63%	29/12/2049	98.129	0,20
300.000	ADLER Group SA*	2,25%	14/01/2029	291.932	0,61
350.000	American Tower Corp*	0,88%	21/05/2029	353.210	0,73
300.000	Anheuser-Busch InBev SA*	2,88%	02/04/2032	365.231	0,76
200.000	Aroundtown SA*	3,38%	29/12/2049	208.250	0,43
400.000	Athene Global Funding*	1,13%	02/09/2025	415.502	0,86
100.000	Atrium European Real Estate Ltd*	3,63%	29/12/2049	98.153	0,20
400.000	Bayer AG*	1,00%	12/01/2036	376.834	0,78
400.000	BP Capital Markets Plc*	3,63%	29/12/2049	435.964	0,90
200.000	CDP Reti SpA*	1,88%	29/05/2022	203.682	0,42
200.000	Commerzbank AG*	6,13%	29/12/2049	220.990	0,46
400.000	Credit Agricole SA*	0,38%	20/04/2028	396.094	0,82
250.000	Credit Logement SA*	0,60%	29/12/2049	244.511	0,51
200.000	Credit Suisse AG*	0,25%	05/01/2026	200.728	0,42
200.000	Credit Suisse Group AG*	0,46%	16/01/2026	201.341	0,42
400.000	Digital Dutch Finco BV*	1,25%	01/02/2031	409.263	0,85
100.000	Dufry One BV*	3,38%	15/04/2028	99.500	0,21
200.000	easyJet FinCo BV*	1,88%	03/03/2028	200.482	0,42
400.000	Electricite de France SA*	3,38%	29/12/2049	418.558	0,87
350.000	Enel Finance International NV*	0,88%	17/06/2036	347.875	0,72
200.000	Energizer Gamma Acquisition BV**	3,50%	30/06/2029	199.566	0,41
300.000	ENI SpA*	2,00%	29/12/2049	300.180	0,62
411.000	European Union*	0,00%	04/07/2031	410.257	0,85
144.000	European Union*	0,70%	06/07/2051	145.852	0,30
400.000	Fastighets AB Balder*	1,25%	28/01/2028	404.868	0,84
200.000	FCA Bank SpA*	0,50%	13/09/2024	202.860	0,42
300.000	Fidelity National Information Services Inc*	1,00%	03/12/2028	309.113	0,64

Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (cont.)

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 EUR	% del Patrimonio neto
Bonos de empresa 36,78% (31 de diciembre de 2020: 44,62%) (cont.)					
Euro (cont.)					
312.000	Goldman Sachs Group Inc*	0,01%	30/04/2024	312.213	0,65
200.000	Grupo Antolin-Irausa SA*	3,50%	30/04/2028	199.756	0,41
300.000	Heimstaden Bostad AB†	3,38%	29/12/2049	311.094	0,64
200.000	Intesa Sanpaolo SpA†	1,00%	22/07/2022	202.714	0,42
500.000	Intesa Sanpaolo SpA†	3,75%	29/12/2049	499.293	1,03
250.000	Intrum AB†	3,00%	15/09/2027	247.934	0,51
400.000	Islandsbanki HF*	1,13%	19/01/2024	405.828	0,84
400.000	La Financiere Atalian SASU†	4,00%	15/05/2024	398.420	0,83
400.000	Landsbankinn HF*	0,50%	20/05/2024	402.216	0,83
400.000	Morgan Stanley†	0,41%	29/10/2027	401.583	0,83
300.000	Ontex Group NV†	3,50%	15/07/2026	299.992	0,62
300.000	PCF GmbH†	4,75%	15/04/2026	306.820	0,64
300.000	Petroleos Mexicanos†	4,75%	26/02/2029	298.123	0,62
200.000	Pinnacle Bidco Plc†	5,50%	15/02/2025	205.468	0,43
150.000	Platin 1426 GmbH**	5,38%	15/06/2023	151.354	0,31
400.000	PVH Corp**	3,13%	15/12/2027	455.240	0,94
200.000	RCI Banque SA†	0,00%	12/01/2023	200.732	0,42
200.000	Repsol International Finance BV†	2,50%	29/12/2049	201.499	0,42
200.000	Rolls-Royce Plc†	4,63%	16/02/2026	218.650	0,45
200.000	Ryanair DAC†	0,88%	25/05/2026	200.874	0,42
200.000	Sappi Papier Holding GmbH†	3,63%	15/03/2028	200.519	0,42
300.000	SGL Carbon SE†	4,63%	30/09/2024	307.180	0,64
200.000	SoftBank Group Corp†	5,00%	15/04/2028	224.364	0,47
400.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd†	1,38%	09/07/2032	417.323	0,87
200.000	TotalEnergies SE†	1,63%	29/12/2049	200.464	0,42
300.000	Traton Finance Luxembourg SA†	1,25%	24/03/2033	304.614	0,63
300.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE†	2,13%	29/12/2049	297.732	0,62
200.000	UniCredit SpA**	3,88%	29/12/2049	191.875	0,40
400.000	UniCredit SpA†	4,45%	29/12/2049	400.000	0,83
300.000	Veolia Environnement SA†	2,50%	29/12/2049	302.263	0,63
200.000	Vivion Investments Sarl†	3,00%	08/08/2024	199.806	0,41
300.000	Vodafone Group Plc†	3,00%	27/08/2080	308.871	0,64
400.000	Volkswagen International Finance NV†	3,88%	29/12/2049	445.060	0,92
250.000	Westpac Banking Corp†	0,38%	02/04/2026	257.017	0,53
200.000	Wizz Air Finance Co BV†	1,35%	19/01/2024	204.441	0,42
Total bonos de empresa				17.740.257	36,78

Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (cont.)

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 EUR	% del Patrimonio neto
Bonos del Estado 52,41% (31 de diciembre de 2020: 39,45%)					
Euro					
210.000	Acquirente Unico SpA*	2,80%	20/02/2026	232.564	0,48
300.000	Adif Alta Velocidad*	0,95%	30/04/2027	316.014	0,66
100.000	Adif Alta Velocidad*	1,88%	28/01/2025	107.657	0,22
269.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	0,00%	15/08/2050	249.860	0,52
330.672	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale*	1,50%	25/07/2021	332.130	0,69
375.000	Croatia Government International Bond**	2,75%	27/01/2030	433.796	0,90
350.000	Cyprus Government International Bond*	0,00%	09/02/2026	352.355	0,73
178.710	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond*	0,10%	15/04/2033	216.608	0,45
194.075	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond**	0,10%	15/04/2046	276.975	0,57
251.779	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond*	0,50%	15/04/2030	303.973	0,63
1.151.206	French Republic Government Bond OAT*	0,10%	01/03/2025	1.225.102	2,54
1.391.743	French Republic Government Bond OAT*	0,10%	01/03/2028	1.545.766	3,20
1.263.988	French Republic Government Bond OAT*	0,10%	25/07/2031	1.460.426	3,03
136.156	French Republic Government Bond OAT*	0,10%	25/07/2036	162.680	0,34
661.364	French Republic Government Bond OAT**	1,85%	25/07/2027	811.656	1,68
482.000	Hellenic Republic Government Bond*	0,00%	12/02/2026	481.301	1,00
320.000	Hellenic Republic Government Bond*	0,75%	18/06/2031	317.871	0,66
35.000	Ireland Government Bond*	0,55%	22/04/2041	34.387	0,07
357.130	Ireland Government Bond*	1,30%	15/05/2033	401.486	0,83
2.200.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT*	0,00%	14/06/2022	2.210.933	4,58
634.900	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,40%	11/04/2024	655.580	1,36
195.808	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	0,40%	15/05/2030	211.587	0,44
113.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,60%	01/08/2031	110.677	0,23
191.039	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,65%	28/10/2027	202.844	0,42
440.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,85%	15/01/2027	455.283	0,94
623.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	0,90%	01/04/2031	630.389	1,31
403.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	0,95%	01/12/2031	406.464	0,84
602.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	1,35%	01/04/2030	637.683	1,32
414.473	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,40%	26/05/2025	447.877	0,93
229.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,45%	15/05/2025	242.416	0,50
66.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	1,50%	30/04/2045	64.149	0,13
445.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,60%	01/06/2026	477.473	0,99
103.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,70%	01/09/2051	99.816	0,21
560.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	1,85%	01/07/2025	602.039	1,25
187.459	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	3,10%	15/09/2026	229.337	0,48
255.000	Kingdom of Belgium Government Bond*	1,60%	22/06/2047	301.194	0,62
341.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT**	0,30%	17/10/2031	337.864	0,70
730.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*	2,88%	15/10/2025	833.879	1,73

Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (cont.)

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 EUR	% del Patrimonio neto
Bonos del Estado 52,41% (31 de diciembre de 2020: 39,45%) (cont.)					
Euro (cont.)					
280.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT**	2,88%	21/07/2026	325.624	0,67
87.400	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*	4,10%	15/02/2045	141.526	0,29
159.000	Republic of Latvia Government Bond*	0,00%	24/01/2029	158.963	0,33
225.000	Romanian Government International Bond*	2,88%	11/03/2029	249.485	0,52
374.000	Romanian Government International Bond*	3,62%	26/05/2030	433.216	0,90
485.000	Romanian Government International Bond*	3,88%	29/10/2035	570.884	1,18
221.000	Slovenia Government Bond*	0,13%	01/07/2031	220.998	0,46
288.242	SNCF Reseau*	2,45%	28/02/2023	305.849	0,63
433.000	Spain Government Bond*	0,50%	31/10/2031	433.791	0,90
344.000	Spain Government Bond*	0,85%	30/07/2037	338.791	0,70
135.000	Spain Government Bond*	1,40%	30/04/2028	147.545	0,31
342.000	Spain Government Bond*	1,45%	31/10/2027	374.250	0,78
376.765	Spain Government Inflation Linked Bond*	0,65%	30/11/2027	427.145	0,89
186.000	State of North Rhine-Westphalia Germany*	1,45%	16/02/2043	220.194	0,46
Total euro				22.768.352	47,20
Dólar estadounidense					
1.384.938	United States Treasury Inflation Indexed Bonds*	0,13%	15/01/2031	1.286.318	2,66
1.299.192	United States Treasury Inflation Indexed Bonds*	0,50%	15/01/2028	1.228.949	2,55
Total dólar estadounidense				2.515.267	5,21
Total bonos del Estado				25.283.619	52,41
Total inversiones				46.439.655	96,27

Contratos de divisas a plazo 0,31% (31 de diciembre de 2020: 0,41%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto
717.281 USD	595.797 €	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	8.827	0,02
1.673.857 USD	1.392.527 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	3	18.430	0,03
Clases USD con cobertura						
4.758.423 USD	3.968.851 €	19/07/2021	Citibank NA	1	42.204	0,09
4.758.423 USD	3.969.054 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	42.001	0,08
167.718 USD	137.909 €	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	3.466	0,01
4.687.402 USD	3.913.519 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	37.670	0,08
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					152.598	0,31

Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de futuros 0,01% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto
3	Euro-Bund Future September 2021	3.060	0,01
(13)	Euro-Schatz Future September 2021	260	0,00
(2)	United Kingdom Long Gilt Future September 2021	93	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de futuros ±		3.413	0,01

Contratos de swap sobre inflación (0,17%) (31 de diciembre de 2020: 0,03%)

Importe nominal	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar) [#]	Tipo fijo	Tipo variable	Plusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto	
EUR	3.000.000	29/03/2024	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	0,98%	FRCPXTOB	31.488	0,07
EUR	300.000	12/02/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,26%	CPTFEMU	13.047	0,03
EUR	300.000	11/02/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,26%	CPTFEMU	12.776	0,03
EUR	500.000	15/03/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,42%	CPTFEMU	12.115	0,02
EUR	500.000	15/03/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,46%	CPTFEMU	10.082	0,02
EUR	400.000	15/02/2022	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	0,99%	CPTFEMU	1.123	0,00
EUR	350.000	21/06/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,52%	CPTFEMU	1.025	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de swaps sobre inflación[∞]						81.656	0,17	

Contratos de swap de tipos de interés 0,06% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)

Importe nominal	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar) [#]	Tipo fijo	Tipo variable	Plusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto	
EUR	3.596.378	23/02/2031	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	0,00%	6M EURIBOR	27.463	0,06
Plusvalía latente total sobre contratos de swap de tipos de interés[∞]						27.463	0,06	

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

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

¹ Swap liquidada centralmente.

	Valor razonable EUR	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	46.704.785	96,82

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,10%) (31 de diciembre de 2020: (1,13%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto
3.177.899 €	3.810.212 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(33.874)	(0,07)
418.115 €	504.567 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(7.204)	(0,01)
789.348 €	946.490 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	(8.484)	(0,02)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(49.562)	(0,10)

Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de futuros (0,22%) (31 de diciembre de 2020: (0,13%))

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto
(18)	Euro-BOBL Future September 2021	(1.620)	(0,00)
(1)	Euro-BTP Future September 2021	(870)	(0,00)
(18)	Euro-Bund Future September 2021	(14.570)	(0,03)
42	Euro-Bund Put Option on Future July 2021, Strike Price EUR 169	(2.168)	(0,00)
20	Euro-Bund Put Option on Future July 2021, Strike Price EUR 171	(2.553)	(0,01)
(12)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future September 2021	(23.040)	(0,05)
(51)	Euro-OAT Future September 2021	(30.400)	(0,06)
(11)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2021	(4.567)	(0,01)
(13)	US Treasury 10-Year Ultra Future September 2021	(22.623)	(0,05)
(7)	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2021	(415)	(0,00)
(1)	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2021	(2.925)	(0,01)
Minusvalía latente total sobre contratos de futuros±		(105.751)	(0,22)

Contratos de swap sobre inflación (0,08%) (31 de diciembre de 2020: (0,04%))

Importe nominal	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar)#	Tipo fijo	Tipo variable	Minusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto	
EUR	500.000	15/03/2024	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	1,02%	FRCPXTOB	(1.239)	(0,00)
EUR	3.000.000	29/03/2024	LCH Clearnet Ltd ¹	(Pagar)	1,40%	CPTFEMU	(39.096)	(0,08)
Minusvalía latente total sobre contratos de swap sobre inflación∞						(40.335)	(0,08)	

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

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

¹Swap liquidada centralmente.

Contratos de swap de tipos de interés (0,02%) (31 de diciembre de 2020: (0,09%))

Importe nominal	Fecha de vencimiento	Contraparte	Recibir/(Pagar)#	Tipo fijo	Tipo variable	Minusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto	
EUR	100.000	11/01/2029	LCH Clearnet Ltd ¹	Recibir	0,82%	6M EURIBOR	(6.838)	(0,02)
Minusvalía latente total sobre contratos de swap de tipos de interés∞						(6.838)	(0,02)	

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

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

¹Swap liquidada centralmente.

Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de credit default swap (0,35%) (31 de diciembre de 2020: (0,00%))

Importe nominal	Fecha de vencimiento	Contraparte	Obligación referenciada	Valores razonables EUR	% del Patrimonio neto	
EUR	1.350.000	20/06/2026	ICE Clear U.S. ¹	Buying default protection on iTraxx Europe Crossover	(167.416)	(0,35)
Total valor razonable en contratos de credit default swap ∞				(167.416)	(0,35)	

¹Swap liquidada centralmente.

	Valor razonable EUR	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(369.902)	(0,77)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	46.334.883	96,05
Otro activo neto	1.904.343	3,95
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	48.239.226	100,00

Análisis de la cartera	EUR	% de los Activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	36.918.623	71,58
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	9.521.032	18,46
± Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	(102.338)	(0,20)
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(2.434)	(0,00)
Total inversiones	46.334.883	89,84

Neuberger Berman EURO Bond Absolute Return Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste EUR
2.349.167	French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 25/07/2031	2.739.289
2.200.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT, 0.00%, 14/06/2022	2.210.479
1.610.257	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0.13%, 15/01/2031	1.487.182
1.092.560	French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 01/03/2028	1.216.270
1.125.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.90%, 01/04/2031	1.168.950
1.038.168	French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 01/03/2025	1.106.223
1.000.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT, 0.00%, 30/09/2021	1.002.385
1.000.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT, 0.00%, 30/06/2021	1.001.534
1.000.000	Credit Suisse Group AG, 0.63%, 18/01/2033	990.600
974.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.30%, 17/10/2031	956.231
919.000	Spain Government Bond, 0.10%, 30/04/2031	917.214
801.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.35%, 01/04/2030	866.659
3.500.000	Republic of Poland Government Bond, 1.25%, 25/10/2030	774.644
634.286	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, 0.50%, 15/04/2030	768.260
659.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.60%, 01/06/2026	708.068
700.000	TotalEnergies SE, 1.63%, 29/12/2049	703.600
700.000	JPMorgan Chase & Co, 0.60%, 17/02/2033	700.000
700.000	Morgan Stanley, 0.41%, 29/10/2027	700.000
700.000	American Tower Corp, 0.88%, 21/05/2029	699.461
700.000	UBS AG, 0.50%, 31/03/2031	697.417

Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas (cont.)

20 ventas de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Producto EUR
1.977.066	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0.13%, 15/04/2025	1.782.749
1.112.147	French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 25/07/2031	1.287.339
1.149.634	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.55%, 21/05/2026	1.194.632
5.000.000	Republic of Poland Government Bond, 1.25%, 25/10/2030	1.096.382
1.000.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT, 0.00%, 30/09/2021	1.001.490
1.000.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT, 0.00%, 30/06/2021	1.001.304
948.000	Spain Government Bond, 0.80%, 30/07/2027	999.594
1.000.000	Credit Suisse Group AG, 0.63%, 18/01/2033	990.475
848.247	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.40%, 26/05/2025	906.619
919.000	Spain Government Bond, 0.10%, 30/04/2031	898.752
803.498	French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 01/03/2026	879.289
730.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.70%, 15/10/2027	775.349
592.027	Spain Government Bond, 1.00%, 30/11/2030	716.481
713.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.90%, 01/04/2031	710.367
700.000	Societe Generale SA, 1.13%, 30/06/2031	697.433
700.000	BNP Paribas SA, 0.25%, 13/04/2027	696.641
700.000	JPMorgan Chase & Co, 0.60%, 17/02/2033	693.593
700.000	UBS AG, 0.50%, 31/03/2031	692.958
700.000	Verizon Communications Inc, 1.13%, 19/09/2035	684.426
684.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.25%, 15/03/2028	682.611

Neuberger Berman Absolute Alpha Fund

Balance

	Nota	A 31 de diciembre de 2020* USD
Activo circulante		
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	3
Ingresos a percibir y otros activos		37.713
Activos totales		37.716
Pasivo circulante		
Descubierto bancario	3	7.638
Gastos devengados		9.150
Otras cuentas por pagar		20.928
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		37.716
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		–

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Absolute Alpha Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 USD
Ingresos		
Ingresos por intereses		6.619
Ingresos por dividendos		238.137
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(2.433.485)
		(2.188.729)
Gastos		
Comisión de gestión	5	423.741
Comisión de distribución	5	1.069
Comisión de administración	5	25.016
Comisión de compromiso	16	2.260
Comisión de depósito	5	5.435
Comisión del Depositario	5	963
Honorarios profesionales	7	18.829
Honorarios de los Consejeros	6	2.164
Costes de transacciones	7	22.013
Honorarios de auditoría	7	6.410
Reembolso de IVA		(137)
Otros gastos	7	90.366
Gastos no asumidos	5	(30.313)
Gastos totales		567.816
Gastos por intereses		201
		201
Impuestos retenidos en origen		88.149
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		(2.844.895)

*La Cartera se liquidó el 10 de agosto de 2020.

Los ingresos y gastos se derivaron exclusivamente de actividades interrumpidas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Absolute Alpha Fund (cont.)

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

		Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
		USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo		39.853.427
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		(2.844.895)
Suscripciones	5	2.600.918
Reembolsos	5	(4.002.515)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo		35.606.935

*La Cartera se liquidó el 10 de agosto de 2020.

Neuberger Berman Multi-Style Premia Fund*

Informe del Gestor de inversiones

Desde el 1 de enero de 2021 hasta el cierre de la Cartera el 24 de febrero de 2021, la rentabilidad total de la Clase de Acumulación USD I fue del 0,09%. En el mismo período, el índice ICE BofA US Dollar 3-month Deposit Offered Rate Constant Maturity (rentabilidad total en USD) (el "Índice") rindió un 0,04%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Los mercados se movieron al alza durante el periodo analizado tras los ingentes estímulos fiscales y las medidas adoptadas para la administración generalizada de vacunas, lo que infundió optimismo sobre la idea de que la economía mundial no tardaría en recuperarse con fuerza. Estas perspectivas favorables arrastraron al alza las expectativas de inflación, lo cual provocó un brusco aumento de los rendimientos de los bonos globales, a raíz de lo cual los valores del Tesoro estadounidense registraron uno de sus peores trimestres en cuatro décadas. Esto afectó a la estrategia de tipos al arrojar pérdidas tanto el carry en bonos como la posición corta en volatilidad de los bonos. Los tipos estadounidenses a largo plazo fueron el mayor lastre para la rentabilidad después de que el Consejo de la Reserva Federal de EE. UU ("Fed") se mostrase dispuesto a permitir una pronunciación del tramo largo como signo de confianza en la recuperación económica. No obstante, las posiciones cortas en bonos de la zona euro y Japón contrarrestaron parcialmente las pérdidas, al ser menos severo su deterioro tras la postura más deflacionaria que mantuvieron tanto el Banco Central Europeo como el Banco de Japón. La renta variable arrancó el trimestre con flojos resultados, aunque el estilo "value" batió a su homólogo "growth" por uno de los márgenes más amplios registrados desde principios de la década 2000.

El brusco aumento de los rendimientos contribuyó a generar ganancias en exposiciones cíclicas, especialmente en bancos. En cambio, el aumento de las tasas de descuento afectó negativamente a ciertos nombres de crecimiento caros, lo cual permitió que las posiciones cortas en tecnología produjeran resultados superiores. La exposición corta en volatilidad de la renta variable registró buenos resultados durante el periodo y viene generando ganancias de manera sistemática desde la fuerte corrección que experimentó el pasado marzo. Los niveles de volatilidad implícita se mantuvieron a un nivel atractivamente alto en el área de títulos individuales, procediendo las ganancias principalmente de títulos asociados a la recuperación cíclica en bancos, energía y venta minorista. La estrategia de divisas se vio perjudicada por el deterioro de las divisas de mercados emergentes, afectadas a su vez por el aumento de los rendimientos estadounidenses. La estrategia en materias primas arrojó resultados dispares al experimentar el producto un amplio repunte en el periodo. La carne de porcino magra fue la materia prima que mejor se comportó ante la escasa oferta y la fuerte demanda procedente de China, factores que impulsaron los precios a máximos plurianuales; sin embargo, esto quedó contrarrestado por las posiciones cortas en crudo WTI y azúcar, que repuntaron con la mejor perspectiva de crecimiento y la escasez de suministros.

*La Cartera se liquidó el 24 de febrero de 2021.

Neuberger Berman Multi-Style Premia Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021* USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		–	3.154.759
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	59.326	3.532.079
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		15	6.409
Cuentas por cobrar de intermediarios		–	3.011.337
Ingresos a percibir y otros activos		–	51.406
Activos totales		59.341	9.755.990
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		–	159.545
Gastos devengados		36.199	54.345
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		15	2.204
Otras cuentas por pagar		23.127	15.237
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		59.341	231.331
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		–	9.524.659

Neuberger Berman Multi-Style Premia Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Periodo finalizado el 30 de junio de 2021*	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
		USD	USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		113	10.889
Ingresos por dividendos		53	60.689
Ingresos por préstamo de valores	15	5	–
Ingresos varios		44.130	–
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		16.409	(3.392.160)
		60.710	(3.320.582)
Gastos			
Comisión de gestión	5	6.161	35.333
Comisión de administración	5	37.209	57.186
Comisión de compromiso	16	669	870
Comisión de depósito	5	2.869	5.630
Comisión del Depositario	5	67	346
Honorarios profesionales	7	17.128	17.793
Honorarios de los Consejeros	6	1.835	2.232
Costes de transacciones	7	11.726	33.602
Honorarios de auditoría	7	15.620	6.341
Reembolso de IVA		(39)	(46)
Otros gastos	7	–	75.418
Gastos no asumidos	5	(63.630)	(112.563)
Gastos totales		29.615	122.142
Repartos de dividendos abonados	1	–	87.388
		–	87.388
Impuestos retenidos en origen		594	21.438
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		30.501	(3.551.550)

*La Cartera se liquidó el 24 de febrero de 2021.

Todos los beneficios y pérdidas proceden exclusivamente de operaciones interrumpidas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Multi-Style Premia Fund (cont.)

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

	Periodo finalizado el 30 de junio de 2021*	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	9.524.659	16.393.854
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	30.501	(3.551.550)
Suscripciones	5	385.675
Reembolsos	5	(2.288.524)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	–	10.939.455

*La Cartera se liquidó el 24 de febrero de 2021.

Neuberger Berman Multi-Style Premia Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

En el período no se produjeron compras.

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

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
4.927.228	Weser Capital Ltd, 0.00%, 01/03/2029	250.303
4.927.228	Alphabeta Access Products Ltd, 0.00%, 01/03/2029	250.303
764	Rio Tinto Plc	59.910
672	Wolters Kluwer NV	57.485
1.291	NN Group NV	56.898
1.925	Koninklijke Ahold Delhaize NV	55.961
110	ASML Holding NV	54.948
1.900	ITOCHU Corp	54.649
424	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	54.395
1.431	British American Tobacco Plc	54.249
1.800	Ono Pharmaceutical Co Ltd	53.602
50	Hermes International	53.403
700	Toyota Motor Corp	53.200
589	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	50.573
475	UCB SA	50.173
983	Deutsche Post AG	48.537
400	Rinnai Corp	46.503
567	Brenntag AG	44.981
1.300	Taisei Corp	43.759
274	Cofinimmo SA	41.778
800	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	41.459
236	Koninklijke DSM NV	40.982
4.337	Tate & Lyle Plc	39.893
700	Azbil Corp	39.430
1.300	KDDI Corp	39.181
400	Daito Trust Construction Co Ltd	37.007
400	Nitto Denko Corp	35.529
1.100	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	33.774
960	Bunzl Plc	32.915
500	Sugi Holdings Co Ltd	32.883
1.400	Tokyo Gas Co Ltd	32.068
169	SEB SA	30.872
4.980	Ashmore Group Plc	30.250

Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I EUR en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 0,52%. En el mismo periodo, el índice de referencia, el ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government (rentabilidad total en EUR) (el "Índice"), rindió un -0,34%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

A lo largo del primer semestre de 2021, las divisas con mejor comportamiento fueron el dólar canadiense y la libra esterlina. Por el extremo contrario destacaron el yen japonés y el franco suizo. La Cartera generó una rentabilidad positiva en el periodo. La infraponderación en el franco suizo y la sobreponderación en el dólar canadiense fueron las posiciones que mejor se comportaron, mientras que las sobreponderaciones respecto al Índice en el yen japonés y el real brasileño lastraron la rentabilidad relativa.

Los datos económicos se deterioraron de forma generalizada durante el periodo, tanto en términos absolutos como en relación con las expectativas. Sin embargo, el aumento de las presiones inflacionistas hizo que las rentabilidades se elevaran en el tramo corto de la curva durante el periodo analizado, lo que dio a EE. UU. una ventaja de rentabilidad con respecto a otras grandes economías además de producir un repunte del dólar estadounidense, a pesar del amplio consenso que apuntaba a una bajada del billete verde a comienzos de año.

Por otra parte, las excelentes expectativas para el PIB nominal hicieron que los precios de las materias primas continuasen subiendo, en consonancia con las monedas de exportación de estos productos, y en detrimento de monedas de financiación tradicionales como el yen japonés y el franco suizo. La aparición de la variante dominante Delta generó preocupación por el posible aplazamiento de la plena reapertura de las economías hasta que las tasas de vacunación sean notablemente más elevadas.

Por lo que respecta a la evolución de la reapertura, el Reino Unido se situó a la cabeza de las principales economías en la distribución de vacunas y se espera que reabra antes que otras. Esto, unido a la desaparición de la incertidumbre asociada al Brexit, benefició a la libra esterlina.

La Cartera cerró el primer semestre del año con sobreponderaciones centrales en el yen japonés y la corona noruega, y con infraponderaciones en el dólar estadounidense, el franco suizo y el dólar canadiense.

De cara al futuro, los participantes del mercado estarán atentos a cualquier indicio que les lleve a determinar si las actuales presiones inflacionistas son temporales o persistentes y cómo responderán probablemente los bancos centrales. Si las autoridades de los bancos centrales continúan "detrás de la curva" y mantienen los tipos de interés reales en terreno firmemente negativo, los ánimos a favor del riesgo deberían persistir y las divisas de países exportadores de materias primas se beneficiarán a costa del dólar estadounidense y las tradicionales divisas "refugio".

Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 EUR	A 31 de diciembre de 2020 EUR
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		32.647.263	32.177.254
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	912.648	128.927
Cuentas a percibir por acciones emitidas		247.999	–
Ingresos a percibir y otros activos		227.224	327.954
Activos totales		34.035.134	32.634.135
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		1.816.619	6.303.252
Descubierto bancario	3	384	237
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		11.484	–
Adeudado a los intermediarios		227.675	–
Gastos devengados		1.224	3.268
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		196	–
Otras cuentas por pagar		6.674	5.862
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		2.064.256	6.312.619
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		31.970.878	26.321.516

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 EUR	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020 EUR
Ingresos			
Ingresos por intereses		182.916	137.089
Ingresos varios		4.008	–
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		897.369	(1.254.817)
		1.084.293	(1.117.728)
Gastos			
Comisión de gestión	5	25.700	20.359
Comisión de distribución	5	82	34
Comisión de administración	5	26.870	19.220
Comisión de compromiso	16	1.911	–
Comisión de depósito	5	5.062	4.463
Comisión del Depositario	5	675	626
Honorarios profesionales	7	26.164	3.896
Honorarios de los Consejeros	6	2.261	1.202
Costes de transacciones	7	9.374	3.566
Honorarios de auditoría	7	6.231	7.264
Reembolso de IVA		(119)	(94)
Otros gastos	7	2.015	1.497
Gastos no asumidos	5	(58.956)	(24.090)
Gastos totales		47.270	37.943
Costes financieros			
Gastos por intereses		190	300
Repartos de dividendos abonados	1	103	–
		293	300
Impuestos retenidos en origen		–	3.370
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		1.036.730	(1.159.341)

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Semestre finalizado el 30 de junio de 2020
	EUR	EUR
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	26.321.516	19.484.586
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	1.036.730	(1.159.341)
Suscripciones	11.195.709	9.041.879
Reembolsos	(6.583.077)	(994.032)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	31.970.878	26.373.092

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund (cont.)

Cartera de inversiones

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Importe principal	Descripción de los valores	Cupón	Fecha de vencimiento	Valor razonable EUR	% del Patrimonio neto
Bonos del Tesoro 15,38% (31 de diciembre de 2020: 13,34%)					
Euro					
1.000.000	European Stability Mechanism Treasury Bill	0,00%	23/09/2021	1.001.328	3,13
1.000.000	European Stability Mechanism Treasury Bill	0,00%	21/10/2021	1.001.776	3,13
700.000	European Stability Mechanism Treasury Bill	0,00%	11/11/2021	701.466	2,20
1.000.000	European Stability Mechanism Treasury Bill	0,00%	12/05/2022	1.005.023	3,14
1.200.000	European Stability Mechanism Treasury Bill	0,00%	16/06/2022	1.206.703	3,78
Total bonos del Tesoro **				4.916.296	15,38
Bonos de empresa 73,02% (31 de diciembre de 2020: 88,64%)					
Euro					
1.200.000	ANZ New Zealand Int'l Ltd*	0,63%	27/01/2022	1.207.822	3,78
1.300.000	AXA Bank Europe SCF*	0,13%	14/03/2022	1.305.972	4,08
1.000.000	Bank of Nova Scotia*	0,13%	13/01/2022	1.003.440	3,14
1.100.000	Bank of Scotland Plc*	4,50%	13/07/2021	1.101.672	3,45
400.000	Belfius Bank SA*	0,25%	10/03/2022	402.127	1,26
900.000	BNP Paribas Home Loan SFH SA*	0,25%	02/09/2021	901.245	2,82
1.000.000	BPCE SFH SA*	3,75%	13/09/2021	1.008.661	3,15
1.100.000	Caisse de Refinancement de l'Habitat SA*	3,60%	13/09/2021	1.109.173	3,47
500.000	Cie de Financement Foncier SA*	0,63%	12/11/2021	502.080	1,57
1.200.000	CIF Euromortgage SA*	4,13%	19/01/2022	1.230.739	3,85
1.100.000	Credit Agricole Home Loan SFH SA*	0,38%	21/10/2021	1.103.123	3,45
1.000.000	Credit Mutuel Home Loan SFH SA*	0,50%	21/01/2022	1.005.808	3,15
600.000	Danske Bank A/S*	0,13%	14/02/2022	602.437	1,88
1.000.000	HSBC SFH France SA*	0,38%	11/03/2022	1.006.164	3,15
800.000	ING Bank NV**	3,38%	10/01/2022	816.580	2,55
900.000	Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale*	0,20%	22/04/2022	905.009	2,83
1.000.000	National Australia Bank Ltd*	0,25%	28/03/2022	1.005.568	3,15
400.000	Nationwide Building Society*	0,75%	29/10/2021	401.683	1,26
1.158.000	Santander UK Plc*	0,25%	09/08/2021	1.158.903	3,62
700.000	Societe Generale SFH SA*	4,00%	18/01/2022	717.538	2,24
500.000	Sparkasse KoelnBonn*	0,38%	03/06/2022	504.100	1,58
1.150.000	Stadshypotek AB*	0,63%	10/11/2021	1.154.876	3,61
1.200.000	Swedbank Hypotek AB*	0,38%	11/03/2022	1.207.597	3,78
950.000	UBS AG**	4,00%	08/04/2022	983.103	3,07
1.000.000	Westpac Banking Corp*	0,75%	22/07/2021	1.000.691	3,13
Total bonos de empresa				23.346.111	73,02

Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund (cont.)

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 EUR	% del Patrimonio neto
Bonos del Estado 7,30% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)					
Euro					
200.000	Caisse Francaise de Financement Local	0,50%	13/04/2022	201.606	0,63
1.000.000	Caisse Francaise de Financement Local	4,25%	26/01/2022	1.027.427	3,22
1.100.000	UNEDIC ASSEO	0,30%	04/11/2021	1.103.324	3,45
Total bonos del Estado *				2.332.357	7,30
Total inversiones				30.594.764	95,70

Contratos de divisas a plazo 6,42% (31 de diciembre de 2020: 20,27%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto
4.420.258 BRL	771.168 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	91.182	0,29
1.560.851 BRL	289.001 USD	19/07/2021	UBS AG	1	18.128	0,06
5.237.042 CAD	4.169.907 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	49.962	0,16
2.026.434 CAD	1.617.043 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	16.358	0,05
660.153 CAD	529.743 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	2	2.835	0,01
742.757 CAD	594.603 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	4.393	0,01
44.236.028 CZK	2.040.861 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	13.179	0,04
540.501 £	745.162 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	1.307	0,00
220.799.054 HUF	734.930 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	9.195	0,03
92.379.949 HUF	310.409 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	1.384	0,00
69.075.122 HUF	229.147 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	3.525	0,01
28.716.914 MXN	1.411.712 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	23.200	0,07
19.667.786 MXN	973.130 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	10.604	0,03
7.684.762 NOK	889.529 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	3.023	0,01
208.411.382 RUB	2.722.367 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	104.409	0,33
35.156.467 RUB	467.537 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	10.610	0,03
20.656.183 RUB	274.224 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	6.637	0,02
24.192.841 RUB	313.483 USD	19/07/2021	UBS AG	1	14.257	0,04
1.315.753 USD	1.201.523 CHF	19/07/2021	BNP Paribas	2	12.893	0,04
1.159.889 USD	823.807 £	19/07/2021	BNP Paribas	1	18.362	0,06
1.666.310 USD	2.344.023 NZD	19/07/2021	BNP Paribas	1	23.985	0,08
1.147.165 USD	9.477.256 NOK	19/07/2021	BNP Paribas	1	38.546	0,12
1.160.706 USD	125.196.038 ¥	19/07/2021	BNP Paribas	1	27.442	0,09
2.389.536 USD	50.969.445 CZK	19/07/2021	BNP Paribas	3	16.867	0,05
2.297.153 USD	19.398.625 SEK	19/07/2021	BNP Paribas	2	24.026	0,08
1.520.125 USD	1.881.679 CAD	19/07/2021	BNP Paribas	1	483	0,00
1.167.387 USD	127.246.835 ¥	19/07/2021	Citibank NA	1	17.496	0,05
3.992.301 USD	3.265.214 €	19/07/2021	Citibank NA	2	100.048	0,31

Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 6,42% (31 de diciembre de 2020: 20,27%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto
793.744 USD	1.025.809 AUD	19/07/2021	Citibank NA	1	19.853	0,06
7.390.910 USD	8.949.891 CAD	19/07/2021	Citibank NA	6	137.751	0,43
1.865.006 USD	15.580.323 SEK	19/07/2021	Citibank NA	2	36.164	0,11
2.354.167 USD	1.659.993 £	19/07/2021	Citibank NA	2	51.297	0,16
458.645 USD	420.930 CHF	19/07/2021	Citibank NA	1	2.575	0,01
450.060 USD	369.218 €	19/07/2021	Deutsche Bank AG	1	10.155	0,03
2.759.452 USD	23.020.864 NOK	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	70.797	0,22
598.716 USD	2.262.861 PLN	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	3.596	0,01
5.171.628 USD	6.362.445 CAD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	28.348	0,09
3.607.019 USD	390.345.005 ¥	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	75.520	0,24
1.420.774 USD	1.946.316 NZD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	51.259	0,16
6.268.245 USD	5.701.090 CHF	19/07/2021	Goldman Sachs International	6	82.373	0,26
590.684 USD	657.221.854 KRW	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	7.661	0,02
861.479 USD	712.511 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	13.662	0,04
4.454.557 USD	5.787.675 AUD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	91.955	0,29
1.315.668 USD	11.069.753 SEK	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	17.762	0,06
4.607.309 USD	6.480.557 NZD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	5	66.677	0,21
2.410.264 USD	1.992.456 €	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	39.247	0,12
4.412.654 USD	484.942.104 ¥	19/07/2021	Standard Chartered Bank	2	36.081	0,11
2.930.179 USD	2.657.839 CHF	19/07/2021	Standard Chartered Bank	2	45.089	0,14
3.683.667 USD	30.695.850 SEK	19/07/2021	Standard Chartered Bank	3	79.082	0,25
767.106 USD	990.386 AUD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	19.817	0,06
330.699 USD	2.803.039 SEK	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	2.433	0,01
1.250.638 USD	136.677.796 ¥	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	16.036	0,05
250.675 USD	322.561 AUD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	7.158	0,02
1.222.469 USD	1.500.989 CAD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	8.719	0,03
9.150 USD	77.464 TRY	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	264	0,00
823.212 USD	6.866.604 NOK	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	21.227	0,07
2.721.918 USD	2.478.703 CHF	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	7	32.973	0,10
290.696 USD	328.050.261 KRW	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	332	0,00
865.131 USD	618.811 £	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	8.625	0,03
1.411.666 USD	1.168.581 €	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	21.365	0,07
1.290.850 USD	1.795.074 NZD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	30.821	0,10
17.623.385 USD	16.197.248 CHF	19/07/2021	UBS AG	1	77.920	0,24
1.464.885 ZAR	99.720 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	2.234	0,01

Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 6,42% (31 de diciembre de 2020: 20,27%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto
Clases GBP con cobertura						
1.790 £	2.066 €	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	19	0,00
166.393 £	191.839 €	19/07/2021	UBS AG	1	1.931	0,01
1.101 £	1.276 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	6	0,00
Clases SEK con cobertura						
2.628.108 €	26.652.817 SEK	19/07/2021	Westpac Banking Corp	10	653	0,00
382.276 SEK	37.359 €	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	326	0,00
41.398.156 SEK	4.064.406 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	24	16.657	0,05
Clases USD con cobertura						
249.978 €	296.541 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	12	0,00
187.644 USD	155.186 €	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	2.986	0,01
27.850.241 USD	23.332.371 €	19/07/2021	UBS AG	1	143.653	0,45
323.188 USD	267.335 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	5.092	0,02
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					2.052.499	6,42
					Valor razonable EUR	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados					32.647.263	102,12

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (5,68%) (31 de diciembre de 2020: (23,95%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto
2.815.813 AUD	2.180.876 USD	19/07/2021	BNP Paribas	2	(56.244)	(0,18)
1.764.683 AUD	1.366.913 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(35.373)	(0,11)
6.910.099 AUD	5.322.277 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	4	(113.018)	(0,35)
3.317.127 AUD	2.567.798 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(65.119)	(0,20)
513.219 CAD	424.989 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(8.884)	(0,03)
1.002.818 CHF	1.096.671 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(9.508)	(0,03)
303.064 CHF	338.414 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(8.762)	(0,03)
1.783.220 CHF	1.988.166 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(48.986)	(0,15)
2.980.316 CHF	3.238.475 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	2	(10.752)	(0,03)
1.038.150 CHF	1.136.822 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(11.118)	(0,04)
12.722.294 CZK	593.088 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	(1.382)	(0,01)
3.159.117 €	3.797.918 USD	19/07/2021	BNP Paribas	3	(42.292)	(0,13)
3.615.092 €	4.399.899 USD	19/07/2021	Citibank NA	4	(93.750)	(0,29)
3.393.160 €	4.119.027 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	4	(78.924)	(0,25)

Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (5,68%) (31 de diciembre de 2020: (23,95%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto
1.312.295 €	1.573.413 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	2	(13.995)	(0,04)
974.448 €	1.183.243 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(22.952)	(0,07)
972.968 €	1.355.737 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(9.747)	(0,03)
1.526.506 €	2.140.342 USD	19/07/2021	Citibank NA	2	(26.506)	(0,08)
729.385 €	1.012.472 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(4.056)	(0,01)
3.763.972 €	5.232.615 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	4	(27.493)	(0,09)
76.821.492 ¥	695.713 USD	19/07/2021	BNP Paribas	2	(2.924)	(0,01)
519.298.308 ¥	4.759.706 USD	19/07/2021	Citibank NA	3	(67.663)	(0,21)
29.299.256 ¥	268.199 USD	19/07/2021	Deutsche Bank AG	1	(3.524)	(0,01)
428.246.193 ¥	3.949.917 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	(76.672)	(0,24)
2.203.490.534 ¥	20.221.197 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	4	(307.992)	(0,96)
361.716.882 ¥	3.336.531 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	7	(64.968)	(0,20)
982.107.921 KRW	875.944 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(5.771)	(0,02)
13.267.815 NOK	1.563.536 USD	19/07/2021	BNP Paribas	2	(18.177)	(0,06)
29.816.886 NOK	3.597.180 USD	19/07/2021	Citibank NA	3	(111.175)	(0,35)
4.264.659 NOK	511.152 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(13.080)	(0,04)
61.173.580 NOK	7.264.312 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	4	(130.467)	(0,41)
492.637 NZD	352.762 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(7.197)	(0,02)
4.326.755 NZD	3.112.130 USD	19/07/2021	Citibank NA	2	(74.907)	(0,23)
1.404.157 NZD	1.002.200 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(17.755)	(0,06)
773.022 NZD	555.211 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(12.705)	(0,04)
2.021.998 PLN	540.941 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(8.232)	(0,03)
10.649.917 SEK	1.274.889 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(24.775)	(0,08)
11.044.968 SEK	1.327.987 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(30.589)	(0,10)
28.562.869 SEK	3.377.430 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(31.214)	(0,10)
1.238.681 USD	17.739.949 ZAR	19/07/2021	BNP Paribas	1	(869)	(0,00)
626.863 USD	3.405.306 BRL	19/07/2021	BNP Paribas	1	(42.626)	(0,13)
1.116.146 USD	22.297.802 MXN	19/07/2021	Citibank NA	1	(1.160)	(0,00)
312.914 USD	388.256 CAD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(524)	(0,00)
645.872 USD	13.895.901 CZK	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(115)	(0,00)
1.149.275 USD	85.671.592 RUB	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(17.468)	(0,06)
1.413.603 USD	12.109.989 SEK	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	(2.233)	(0,01)
1.746.265 USD	1.267.570 £	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(4.137)	(0,01)
9.528.922 ZAR	689.894 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(20.221)	(0,06)
Clases GBP con cobertura						
1.017 €	877 £	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(4)	(0,00)
1.339 €	1.156 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(7)	(0,00)

Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (5,68%) (31 de diciembre de 2020: (23,95%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente EUR	% del Patrimonio neto
Clases SEK con cobertura						
7 €	76 SEK	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	(0)	(0,00)
66.642.654 SEK	6.585.861 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	38	(16.179)	(0,05)
Clases USD con cobertura						
120.248 €	146.112 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(2.916)	(0,01)
117.147 €	139.527 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(466)	(0,00)
303.152 €	370.368 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	8	(9.046)	(0,03)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo [∞]					(1.816.619)	(5,68)
					Valor razonable EUR	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados					(1.816.619)	(5,68)
					Valor razonable EUR	% del Patrimonio neto
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados					30.830.644	96,44
Otro activo neto					1.140.234	3,56
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables					31.970.878	100,00
Análisis de la cartera					EUR	% de los Activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial					23.878.785	70,16
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado					6.715.979	19,73
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC					235.880	0,69
Total inversiones					30.830.644	90,58

Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste EUR
1.500.000	AXA Bank Europe SCF, 0.13%, 14/03/2022	1.509.090
1.500.000	German Treasury Bill, 0.00%, 28/07/2021	1.502.765
1.200.000	CIF Euromortgage SA, 4.13%, 19/01/2022	1.246.324
1.200.000	ANZ New Zealand Int'l Ltd, 0.63%, 27/01/2022	1.210.248
1.200.000	Swedbank Hypotek AB, 0.38%, 11/03/2022	1.209.912
1.200.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 16/06/2022	1.207.266
1.100.000	UNEDIC ASSEO, 0.30%, 04/11/2021	1.106.292
1.000.000	Caisse Francaise de Financement Local, 4.25%, 26/01/2022	1.039.820
1.000.000	Credit Mutuel Home Loan SFH SA, 0.50%, 21/01/2022	1.008.880
1.000.000	HSBC SFH France SA, 0.38%, 11/03/2022	1.007.080
1.000.000	National Australia Bank Ltd, 0.25%, 28/03/2022	1.006.350
1.000.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 12/05/2022	1.005.262
1.000.000	Bank of Nova Scotia, 0.13%, 13/01/2022	1.004.440
1.000.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 21/10/2021	1.002.830
1.000.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 23/09/2021	1.002.520
1.000.000	French Development Agency, 0.13%, 31/03/2021	1.000.930
950.000	UBS AG, 4.00%, 08/04/2022	985.844
900.000	Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale, 0.20%, 22/04/2022	906.102
800.000	ING Bank NV, 3.38%, 10/01/2022	830.728
700.000	Societe Generale SFH SA, 4.00%, 18/01/2022	721.193
600.000	Danske Bank A/S, 0.13%, 14/02/2022	602.658
600.000	Bank of Montreal, 0.13%, 19/04/2021	601.020
500.000	Sparkasse KoelnBonn, 0.38%, 03/06/2022	504.290
500.000	Finland Treasury Bill, 0.00%, 11/05/2021	500.054
400.000	National Australia Bank Ltd, 1.38%, 28/05/2021	402.896
400.000	Belfius Bank SA, 0.25%, 10/03/2022	402.780
300.000	Westpac Banking Corp, 0.75%, 22/07/2021	301.980

Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Total ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto EUR
1.500.000	German Treasury Bill, 0.00%, 28/07/2021	1.501.685
800.000	Cie de Financement Foncier SA, 4.88%, 25/05/2021	810.896
500.000	BNZ International Funding Ltd, 0.13%, 17/06/2021	501.020
300.000	Westpac Banking Corp, 0.75%, 22/07/2021	301.563
300.000	National Australia Bank Ltd, 1.38%, 28/05/2021	301.464
300.000	Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale, 1.13%, 27/05/2021	301.317
300.000	Credit Mutuel Home Loan SFH SA, 4.38%, 17/03/2021	300.897
200.000	BPCE SFH SA, 3.75%, 13/09/2021	202.622
200.000	AXA Bank Europe SCF, 0.13%, 14/03/2022	201.044
100.000	European Stability Mechanism Treasury Bill, 0.00%, 11/11/2021	100.249

Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund

Informe del Gestor de inversiones

Durante el periodo de seis meses finalizado el 30 de junio de 2021 (el "periodo analizado") la rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD alcanzó el 2,13%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

La interacción con los emisores sigue siendo un aspecto fundamental de la gestión del fondo y la labor en este ámbito avanza a buen ritmo, dado el interés de los analistas por comunicarse con miembros destacados de los equipos directivos para alinear los productos y servicios con los Objetivos de Desarrollo Sostenibles pertinentes para cada sector. Asimismo, no resulta extraño que los aspectos Medioambientales, Sociales y de Gobierno Corporativo ("ESG"), junto con los Objetivos de Desarrollo Sostenibles ("SDG"), se hayan vuelto especialmente relevantes para un mayor número de inversores. También entendemos que tales objetivos y el impacto global del fondo son consideraciones importantes, al igual que la rentabilidad de la inversión. Los datos indican que las empresas que "hacen lo correcto" también suelen obtener buenos resultados en el largo plazo, lo que demuestra que para la resiliencia de las empresas también es vital la forma en que sus equipos directivos integran los factores ESG y relativos a los ODS en las operaciones de sus empresas.

El mercado de alta rentabilidad global se anotó buenos resultados en el primer semestre de 2021 gracias a la exitosa campaña de vacunación contra la COVID-19, la reapertura de las economías, el sólido crecimiento del PIB y la mejora de los fundamentales del crédito. A pesar de la mejoría del entorno económico, diversos bancos centrales, entre ellos la Reserva Federal estadounidense y el BCE, reiteraron su intención de mantener una política monetaria acomodaticia además de expresar su confianza en el carácter transitorio del aumento de la inflación. Los diferenciales de crédito, que se habían ampliado al comienzo de la pandemia el pasado año, experimentaron una contracción significativa durante el periodo analizado. El mercado de alta rentabilidad también se caracterizó por la dispersión de rentabilidades entre las diferentes calidades crediticias y emisores que atravesaron dificultades o no durante el periodo, con un avance del índice ICE BofA US Distressed High Yield del 29,9%, frente al 3,1% logrado por el índice ICE BofA US Non-Distressed High Yield en el año hasta la fecha. A pesar de que la parte del mercado que atravesó dificultades experimentó un fuerte repunte partiendo de unos niveles muy bajos, muchos de los emisores que afrontan desafíos seculares todavía no satisfacen nuestros estrictos criterios para la suscripción de crédito. Durante el periodo analizado, el índice de valores acuciados (distressed), medido como porcentaje del Total US High Yield Index, se situó en apenas el 1,7%, descendiendo respecto al 4,1% registrado al final del año pasado, lo que supone el nivel más bajo visto desde octubre de 2006. Por otra parte, desde la perspectiva de la selección de títulos de crédito individuales, encontramos oportunidades de inversión atractivas en el segmento del crédito y en el universo de alta rentabilidad global.

La cifra de emisiones nuevas ha sido muy elevada en el primer semestre, dado que los emisores trataron de refinanciar a rentabilidades más bajas. En lo que va de año, la emisión bruta de bonos de alta rentabilidad de EE. UU. alcanzó los 299.100 millones de dólares —100.300 millones de dólares excluyendo refinanciaciones—, superando los 218.400 millones de dólares —94.200 millones de dólares excluyendo refinanciaciones— del mismo periodo del pasado año. En lo que va de año, el volumen de emisiones nuevas de deuda de alta rentabilidad no denominada en USD alcanzó el equivalente a 86.900 millones de dólares estadounidenses, lo que contrasta con los 43.500 millones del mismo periodo de 2020. Para poner esto en contexto, cabe señalar que el volumen de emisiones nuevas no denominadas en USD alcanzó en total el equivalente a 100.500 millones de dólares estadounidenses en el conjunto del ejercicio 2020. Las salidas de capital de fondos de alta rentabilidad del año en curso alcanzan los -13.800 millones de dólares, lo que contrasta con las entradas de capital por valor de 28.600 millones de dólares del primer semestre de 2020.

En junio de 2021, la tasa de morosidad ponderada por el valor nominal de las emisiones del mercado de alta rentabilidad de los últimos 12 meses en Estados Unidos descendió hasta el 1,87%, en 430 puntos básicos, desde el 6,17% registrado en diciembre de 2020. Por ponerlo en contexto, cabe señalar que la tasa de morosidad media a largo plazo se sitúa en el 3,5% (basada en las tasas de morosidad anuales desde 1980, según JP Morgan). Habida cuenta de la creciente proporción de mejora de las calificaciones y del descenso de las rebajas de calificación, prevemos que las tasas de impago de las emisiones del mercado de alta rentabilidad seguirán moderándose respecto de los niveles actuales.

Durante el periodo analizado, el posicionamiento en los sectores de atención sanitaria, químicos e inmobiliario y construcción de vivienda fue lo que más benefició a la rentabilidad, mientras que el posicionamiento en los sectores de suministros, medios de comunicación/cable y papel fue lo que menos contribuyó a los resultados. Por calificaciones, nuestro posicionamiento en títulos con calificaciones B y CCC e inferior fue el que más benefició a la rentabilidad, mientras que el posicionamiento en emisores con calificación BBB y superior mermó modestamente los resultados de inversión.

Los diferenciales del mercado de alta rentabilidad global se han estrechado en lo que va de año, pero creemos que las valoraciones compensan a los inversores por unas perspectivas de impago cada vez más benignas. La recuperación económica sigue su curso y suponemos que la evolución positiva del crecimiento y de la capacidad de fijación de precios reforzará los fundamentales de los emisores. El constante progreso del ritmo de vacunación, unido a la demanda reprimida de los consumidores en los segmentos de viajes, ocio y servicios, la reposición de existencias y las readmisiones de empleados por parte de las empresas, así como un Comité del Mercado Abierto Federal de EE. UU. paciente aunque vigilante deberían seguir favoreciendo a la actividad económica de aquí en adelante. A pesar de que las nuevas variantes de la COVID y la preocupación por la inflación dan lugar a episodios de volatilidad a corto plazo, creemos que nuestro análisis fundamental del crédito, con un enfoque bottom-up y centrado en la selección de títulos individuales, al tiempo que trata de evitar el deterioro del crédito y de incluir solo nuestras "mejores ideas" en las carteras, nos permite estar bien posicionados para aprovechar cualquier volatilidad.

Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		17.185.041	14.202.972
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	728.443	1.311.181
Ingresos a percibir y otros activos		264.686	228.437
Activos totales		18.178.170	15.742.590
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		8.203	128.938
Descubierto bancario	3	30	50
Gastos devengados		14.618	21.818
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		410.039	941.242
Otras cuentas por pagar		4.411	4.148
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		437.301	1.096.196
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		17.740.869	14.646.394

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Periodo finalizado el 30 de junio de 2020*
		USD	USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		384.058	365.801
Ingresos varios		1.930	396
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		26.961	(1.217.552)
		412.949	(851.355)
Gastos			
Comisión de gestión	5	45.078	45.290
Comisión de administración	5	23.165	19.821
Comisión de compromiso	16	1.115	–
Comisión de depósito	5	5.751	4.574
Comisión del Depositario	5	412	377
Honorarios profesionales	7	23.194	8.094
Honorarios de los Consejeros	6	2.628	1.077
Costes de transacciones	7	1.211	4.912
Gastos de constitución	7	–	44.800
Honorarios de auditoría	7	7.387	7.360
Reembolso de IVA		(74)	(67)
Otros gastos	7	1.553	2.726
Gastos no asumidos	5	(58.415)	(44.096)
Gastos totales		53.005	94.868
Costes financieros			
Repartos de dividendos abonados	1	265.469	149.671
		265.469	149.671
Impuestos retenidos en origen		–	3.523
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		94.475	(1.099.417)

* La Cartera comenzó a funcionar el 21 de enero de 2020, por lo que las cifras de resultados no son directamente comparables.

Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Periodo finalizado el 30 de junio de 2020*
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	14.646.394	–
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	94.475	(1.099.417)
Suscripciones	3.000.000	20.000.000
Reembolsos	–	(5.000.000)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	17.740.869	13.900.583

* La Cartera comenzó a funcionar el 21 de enero de 2020, por lo que las cifras de resultados no son directamente comparables.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund (cont.)

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 de empresa 96,40% (31 de diciembre de 2020: 96,55%)					
Euro					
100.000	Afflelou SAS*	4,25%	19/05/2026	122.055	0,69
125.000	Altice France SA*	5,88%	01/02/2027	157.266	0,89
100.000	Autostrade per l'Italia SpA*	1,88%	26/09/2029	122.188	0,69
100.000	Banijay Group SAS**	6,50%	01/03/2026	122.387	0,69
101.000	BK LC Lux Finco1 Sarl*	5,25%	30/04/2029	122.492	0,69
100.000	Casino Guichard Perrachon SA*	6,63%	15/01/2026	124.966	0,70
100.000	Chrome Holdco SASU*	5,00%	31/05/2029	121.710	0,69
100.000	CMA CGM SA*	7,50%	15/01/2026	131.813	0,74
100.000	Constellium SE*	3,13%	15/07/2029	117.726	0,66
100.000	Flamingo Lux II SCA*	5,00%	31/03/2029	117.739	0,66
100.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	6,88%	15/11/2026	138.292	0,78
150.000	Kleopatra Holdings 2 SCA*	6,50%	01/09/2026	173.001	0,98
100.000	La Financiere Atalian SASU*	4,00%	15/05/2024	118.177	0,67
100.000	Laboratoire Eimer Selas**	5,00%	01/02/2029	121.124	0,68
100.000	Maxeda DIY Holding BV**	5,88%	01/10/2026	121.564	0,69
100.000	Paprec Holding SA*	4,00%	31/03/2025	120.962	0,68
100.000	PCF GmbH*	4,75%	15/04/2026	120.962	0,68
100.000	Pinnacle Bidco Plc*	5,50%	15/02/2025	121.505	0,68
175.000	SGL Carbon SE*	4,63%	30/09/2024	212.461	1,20
100.000	SpA Holdings 3 Oy*	3,63%	04/02/2028	119.478	0,67
100.000	Telecom Italia SpA**	1,63%	18/01/2029	116.539	0,66
101.000	TI Automotive Finance Plc**	3,75%	15/04/2029	122.052	0,69
100.000	Verisure Midholding AB*	5,25%	15/02/2029	121.824	0,69
200.000	Virgin Media Finance Plc**	3,75%	15/07/2030	236.691	1,33
Total euro				3.224.974	18,18
Libra esterlina					
100.000	AA Bond Co Ltd*	6,50%	31/01/2026	143.206	0,81
100.000	Bellis Finco Plc**	4,00%	16/02/2027	138.145	0,78
100.000	Iceland Bondco Plc**	4,38%	15/05/2028	129.914	0,73
100.000	National Express Group Plc*	4,25%	29/12/2049	143.527	0,81
103.000	Premier Foods Finance Plc*	3,50%	15/10/2026	142.239	0,80
Total libra esterlina				697.031	3,93
Dólar estadounidense					
175.000	Acadia Healthcare Co Inc**	5,50%	01/07/2028	187.170	1,05
200.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	5,88%	15/02/2028	215.802	1,22

Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund (cont.)

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 96,40% (31 de diciembre de 2020: 96,55%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
45.000	Ally Financial Inc [*]	5,75%	20/11/2025	51.714	0,29
130.000	Altice France Holding SA ^{**}	6,00%	15/02/2028	129.633	0,73
60.000	American Axle & Manufacturing Inc [*]	6,88%	01/07/2028	65.615	0,37
215.000	APX Group Inc ^{**}	6,75%	15/02/2027	229.208	1,29
200.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc ^{**}	4,00%	01/09/2029	198.875	1,12
160.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc ^{**}	5,25%	15/08/2027	163.413	0,92
130.000	AssuredPartners Inc ^{**}	5,63%	15/01/2029	130.260	0,73
125.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc ^{**}	5,38%	01/03/2029	130.334	0,73
70.000	Ball Corp [*]	4,88%	15/03/2026	78.055	0,44
105.000	Beacon Roofing Supply Inc ^{**}	4,13%	15/05/2029	104.873	0,59
260.000	Carvana Co ^{**}	5,50%	15/04/2027	269.217	1,52
59.000	Cedar Fair LP ^{**}	5,25%	15/07/2029	60.899	0,34
125.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op ^{**}	6,50%	01/10/2028	134.856	0,76
65.000	Centene Corp ^{**}	5,38%	01/06/2026	67.926	0,38
75.000	CHS/Community Health Systems Inc ^{**}	4,75%	15/02/2031	75.188	0,42
90.000	CHS/Community Health Systems Inc ^{**}	6,13%	01/04/2030	91.463	0,52
125.000	CHS/Community Health Systems Inc ^{**}	6,88%	15/04/2029	131.173	0,74
160.000	Cinemark USA Inc ^{**}	5,88%	15/03/2026	168.667	0,95
125.000	Clean Harbors Inc ^{**}	5,13%	15/07/2029	136.381	0,77
160.000	Clearway Energy Operating LLC ^{**}	3,75%	15/02/2031	159.415	0,90
30.000	Clearway Energy Operating LLC ^{**}	4,75%	15/03/2028	31.506	0,18
195.000	CommScope Inc ^{**}	7,13%	01/07/2028	211.596	1,19
250.000	Constellium SE ^{**}	3,75%	15/04/2029	247.817	1,40
55.000	Core & Main LP ^{**}	6,13%	15/08/2025	56.294	0,32
50.000	Crown Cork & Seal Co Inc [*]	7,38%	15/12/2026	61.428	0,35
170.000	DaVita Inc ^{**}	4,63%	01/06/2030	174.711	0,98
125.000	Frontier Communications Holdings LLC ^{**}	5,88%	15/10/2027	134.063	0,76
75.000	Hanesbrands Inc ^{**}	4,88%	15/05/2026	81.094	0,46
135.000	HB Fuller Co [*]	4,00%	15/02/2027	140.211	0,79
80.000	HB Fuller Co [*]	4,25%	15/10/2028	82.800	0,47
155.000	HCA Inc [*]	5,88%	01/02/2029	187.627	1,06
150.000	Hill-Rom Holdings Inc ^{**}	4,38%	15/09/2027	155.762	0,88
125.000	Hilton Worldwide Finance LLC/Hilton Worldwide Finance Corp [*]	4,88%	01/04/2027	130.656	0,74
170.000	Hologic Inc ^{**}	4,63%	01/02/2028	179.131	1,01
115.000	Hughes Satellite Systems Corp ^{**}	5,25%	01/08/2026	129.051	0,73
125.000	IAA Inc ^{**}	5,50%	15/06/2027	131.465	0,74
265.000	Ingevity Corp ^{**}	4,50%	01/02/2026	270.528	1,52
130.000	Intelligent Packaging Ltd Finco Inc/Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC ^{**}	6,00%	15/09/2028	135.545	0,76

Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund (cont.)

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 96,40% (31 de diciembre de 2020: 96,55%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
200.000	IQVIA Inc**	5,00%	15/10/2026	207.536	1,17
315.000	Iron Mountain Inc**	5,25%	15/03/2028	330.293	1,86
180.000	JELD-WEN Inc**	4,88%	15/12/2027	187.420	1,06
395.000	KAR Auction Services Inc**	5,13%	01/06/2025	405.843	2,29
50.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC**	4,25%	01/07/2029	50.750	0,29
105.000	Level 3 Financing Inc**	3,75%	15/07/2029	102.244	0,58
135.000	Lions Gate Capital Holdings LLC**	5,50%	15/04/2029	142.094	0,80
130.000	Live Nation Entertainment Inc**	4,75%	15/10/2027	135.037	0,76
175.000	Masonite International Corp**	5,38%	01/02/2028	186.019	1,05
130.000	MEDNAX Inc**	6,25%	15/01/2027	138.027	0,78
160.000	Meritage Homes Corp*	5,13%	06/06/2027	179.312	1,01
100.000	Mueller Water Products Inc**	4,00%	15/06/2029	102.887	0,58
210.000	Nexstar Broadcasting Inc**	4,75%	01/11/2028	216.037	1,22
205.000	NextEra Energy Operating Partners LP**	4,50%	15/09/2027	222.251	1,25
125.000	Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co**	5,63%	01/10/2028	132.176	0,74
95.000	Nokia OYJ*	4,38%	12/06/2027	105.220	0,59
165.000	Novelis Corp**	5,88%	30/09/2026	171.848	0,97
185.000	Nuance Communications Inc**	5,63%	15/12/2026	193.259	1,09
235.000	OneMain Finance Corp*	3,50%	15/01/2027	237.056	1,34
200.000	Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV**	5,13%	30/04/2031	206.290	1,16
123.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc/Ortho-Clinical Diagnostics S.A.**	7,25%	01/02/2028	134.593	0,76
140.000	Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp**	5,00%	15/08/2027	145.162	0,82
160.000	Pattern Energy Operations LP/Pattern Energy Operations Inc**	4,50%	15/08/2028	166.032	0,94
255.000	PQ Corp**	5,75%	15/12/2025	262.767	1,48
180.000	Presidio Holdings Inc**	8,25%	01/02/2028	196.411	1,11
130.000	Prestige Brands Inc**	5,13%	15/01/2028	138.271	0,78
125.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	6,25%	15/01/2028	133.127	0,75
245.000	RBS Global Inc/Rexnord LLC**	4,88%	15/12/2025	250.696	1,41
330.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	5,75%	15/01/2029	345.441	1,95
155.000	Ritchie Bros Auctioneers Inc**	5,38%	15/01/2025	159.896	0,90
125.000	SBA Communications Corp**	3,88%	15/02/2027	128.672	0,73
105.000	Sensata Technologies Inc**	4,38%	15/02/2030	110.800	0,62
25.000	Starwood Property Trust Inc**	3,63%	15/07/2026	25.219	0,14
100.000	Taylor Morrison Communities Inc**	5,13%	01/08/2030	108.657	0,61
225.000	Team Health Holdings Inc**	6,38%	01/02/2025	214.454	1,21
180.000	Tenet Healthcare Corp**	6,13%	01/10/2028	192.537	1,08
90.000	Tenet Healthcare Corp*	6,75%	15/06/2023	98.325	0,55
215.000	TerraForm Power Operating LLC**	5,00%	31/01/2028	228.285	1,29

Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund (cont.)

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 96,40% (31 de diciembre de 2020: 96,55%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
200.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC**	6,50%	15/02/2029	200.779	1,13
125.000	Univar Solutions USA Inc**	5,13%	01/12/2027	131.814	0,74
130.000	US Foods Inc**	6,25%	15/04/2025	138.125	0,78
155.000	Valvoline Inc**	4,25%	15/02/2030	160.236	0,90
200.000	Vmed O2 UK Financing I Plc**	4,75%	15/07/2031	203.500	1,15
130.000	Zayo Group Holdings Inc**	6,13%	01/03/2028	132.943	0,75
Total dólar estadounidense				13.179.763	74,29
Total bonos de empresa				17.101.768	96,40
Préstamos a plazo 0,22% (31 de diciembre de 2020: 0,42%)					
Dólar estadounidense					
40.000	Solenis Holdings LLC	4,14%	26/06/2025	40.043	0,22
Total préstamos a plazo †				40.043	0,22
Total inversiones				17.141.811	96,62

Contratos de divisas a plazo 0,25% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
97.656 €	83.800 £	19/07/2021	Citibank NA	1	80	0,00
86.886 £	100.957 €	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	267	0,00
4.094.122 USD	3.414.944 €	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	42.883	0,25
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					43.230	0,25

				Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados				17.185.041	96,87

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,05%) (31 de diciembre de 2020: (0,88%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
535.953 €	466.097 £	19/07/2021	Citibank NA	1	(8.107)	(0,05)
13.845 €	11.958 £	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(96)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					(8.203)	(0,05)

Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund (cont.)

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	(8.203)	(0,05)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	17.176.838	96,82
Otro activo neto	564.031	3,18
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	17.740.869	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	4.231.608	23,28
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	12.870.160	70,80
† Otros valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario	40.043	0,22
∞ Instrumentos financieros derivados OTC	35.027	0,19
Total inversiones	17.176.838	94,49

Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
330.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp, 5.75%, 15/01/2029	327.175
260.000	Carvana Co, 5.50%, 15/04/2027	266.482
250.000	Constellium SE, 3.75%, 15/04/2029	250.000
235.000	OneMain Finance Corp, 3.50%, 15/01/2027	235.000
215.000	APX Group Inc, 6.75%, 15/02/2027	230.256
230.000	Clearway Energy Operating LLC, 3.75%, 15/02/2031	230.000
190.000	MEDNAX Inc, 6.25%, 15/01/2027	203.771
225.000	Team Health Holdings Inc, 6.38%, 01/02/2025	201.563
200.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC, 6.50%, 15/02/2029	200.250
200.000	Vmed O2 UK Financing I Plc, 4.75%, 15/07/2031	200.000
200.000	Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV, 5.13%, 30/04/2031	200.000
200.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 4.00%, 01/09/2029	200.000
180.000	Presidio Holdings Inc, 8.25%, 01/02/2028	196.650
150.000	CANPACK US LLC, 2.38%, 01/11/2027	186.986
150.000	Rexel SA, 2.75%, 15/06/2026	186.622
150.000	Kleopatra Holdings 2 SCA, 6.50%, 01/09/2026	175.789
170.000	DaVita Inc, 4.63%, 01/06/2030	174.250
160.000	Cinemark USA Inc, 5.88%, 15/03/2026	165.800
103.000	Premier Foods Finance Plc, 3.50%, 15/10/2026	145.858
100.000	AA Bond Co Ltd, 6.50%, 31/01/2026	145.787
100.000	National Express Group Plc, 4.25%, 29/12/2049	144.619
100.000	Bellis Finco Plc, 4.00%, 16/02/2027	140.639
100.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc, 6.88%, 15/11/2026	137.323
130.000	Intelligent Packaging Ltd Finco Inc/Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC, 6.00%, 15/09/2028	135.564
100.000	Iceland Bondco Plc, 4.38%, 15/05/2028	135.212
135.000	Lions Gate Capital Holdings LLC, 5.50%, 15/04/2029	134.916
125.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op, 6.50%, 01/10/2028	134.063
130.000	Zayo Group Holdings Inc, 6.13%, 01/03/2028	133.926
125.000	Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co, 5.63%, 01/10/2028	133.281
125.000	Frontier Communications Holdings LLC, 5.88%, 15/10/2027	133.179
125.000	American Axle & Manufacturing Inc, 6.88%, 01/07/2028	132.500
100.000	CMA CGM SA, 7.50%, 15/01/2026	132.455
130.000	AssuredPartners Inc, 5.63%, 15/01/2029	132.237
125.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc, 6.25%, 15/01/2028	132.031

Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund (cont.)

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
130.000	Live Nation Entertainment Inc, 4.75%, 15/10/2027	131.820
125.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc, 5.38%, 01/03/2029	130.492
130.000	Altice France Holding SA, 6.00%, 15/02/2028	130.285
125.000	CHS/Community Health Systems Inc, 6.88%, 15/04/2029	129.275
100.000	Casino Guichard Perrachon SA, 6.63%, 15/01/2026	128.537
120.000	CommScope Inc, 7.13%, 01/07/2028	128.510
120.000	Acadia Healthcare Co Inc, 5.50%, 01/07/2028	127.908
100.000	Maxeda DIY Holding BV, 5.88%, 01/10/2026	125.243
100.000	Verisure Midholding AB, 5.25%, 15/02/2029	124.810
101.000	BK LC Lux Finco1 Sarl, 5.25%, 30/04/2029	124.778
100.000	Banijay Group SAS, 6.50%, 01/03/2026	123.993
100.000	Pinnacle Bidco Plc, 5.50%, 15/02/2025	122.839
100.000	Laboratoire Eimer Selas, 5.00%, 01/02/2029	122.839
101.000	TI Automotive Finance Plc, 3.75%, 15/04/2029	122.720
100.000	Afflelou SAS, 4.25%, 19/05/2026	122.571
100.000	SpA Holdings 3 Oy, 3.63%, 04/02/2028	122.359
100.000	Autostrade per l'Italia SpA, 1.88%, 26/09/2029	122.149
120.000	Ingevity Corp, 4.50%, 01/02/2026	122.099
100.000	Constellium SE, 3.13%, 15/07/2029	121.450
100.000	PCF GmbH, 4.75%, 15/04/2026	121.143
100.000	Chrome Holdco SASU, 5.00%, 31/05/2029	120.760
100.000	Telecom Italia SpA, 1.63%, 18/01/2029	120.380
100.000	Flamingo Lux II SCA, 5.00%, 31/03/2029	120.267
100.000	Virgin Media Finance Plc, 3.75%, 15/07/2030	120.028
100.000	Faurecia SE, 2.38%, 15/06/2029	119.045
100.000	Altice France SA, 4.75%, 15/01/2028	117.140
100.000	La Financiere Atalian SASU, 4.00%, 15/05/2024	117.130

Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund (cont.)

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
275.000	Performance Food Group Inc, 5.50%, 15/10/2027	287.018
165.000	Marks & Spencer Plc, 4.50%, 10/07/2027	247.111
185.000	Smurfit Kappa Acquisitions ULC, 2.88%, 15/01/2026	244.915
190.000	Darling Global Finance BV, 3.63%, 15/05/2026	232.778
165.000	Solvay Finance SACA, 5.87%, 29/12/2049	232.671
220.000	Clearway Energy Operating LLC, 5.00%, 15/09/2026	228.525
220.000	Core & Main LP, 6.13%, 15/08/2025	225.612
215.000	Mueller Water Products Inc, 5.50%, 15/06/2026	221.343
165.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH, 6.00%, 30/07/2026	206.001
150.000	Volvo Car AB, 2.50%, 07/10/2027	194.047
190.000	NortonLifeLock Inc, 5.00%, 15/04/2025	192.432
150.000	Rexel SA, 2.75%, 15/06/2026	185.205
150.000	Avantor Funding Inc, 2.63%, 01/11/2025	183.638
150.000	CANPACK US LLC, 2.38%, 01/11/2027	183.448
170.000	Intelsat Jackson Holdings SA, 8.00%, 15/02/2024	176.163
160.000	Clean Harbors Inc, 5.13%, 15/07/2029	171.200
140.000	Kraft Heinz Foods Co, 4.88%, 01/10/2049	161.427
130.000	Crown Cork & Seal Co Inc, 7.38%, 15/12/2026	158.024
150.000	IAA Inc, 5.50%, 15/06/2027	157.500
150.000	Univar Solutions USA Inc, 5.13%, 01/12/2027	157.500
100.000	Co-Operative Group Ltd, 5.13%, 17/05/2024	150.570
100.000	National Express Group Plc, 4.25%, 29/12/2049	147.127
125.000	US Foods Inc, 6.25%, 15/04/2025	133.410
125.000	Acadia Healthcare Co Inc, 5.50%, 01/07/2028	132.171
125.000	Avantor Funding Inc, 4.63%, 15/07/2028	131.094
125.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC, 4.63%, 15/01/2027	129.950
100.000	LKQ European Holdings BV, 4.13%, 01/04/2028	129.450
100.000	SPIE SA, 2.63%, 18/06/2026	125.253
100.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl, 3.50%, 01/03/2028	124.895
100.000	Faurecia SA, 2.38%, 15/06/2029	123.260
100.000	Grifols SA, 2.25%, 15/11/2027	122.479
100.000	SGL Carbon SE, 4.63%, 30/09/2024	122.309
100.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2.63%, 29/12/2049	121.080
100.000	Altice Finco SA, 4.75%, 15/01/2028	119.159
100.000	VZ Vendor Financing II BV, 2.88%, 15/01/2029	118.601
100.000	Elis SA, 1.63%, 03/04/2028	118.452
105.000	Jaguar Holding Co II/PPD Development LP, 5.00%, 15/06/2028	115.106
95.000	CIT Group Inc, 5.25%, 07/03/2025	107.825
110.000	Valvoline Inc, 3.63%, 15/06/2031	107.800

Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund (cont.)

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
95.000	Prestige Brands Inc, 5.13%, 15/01/2028	99.631
95.000	Ingevity Corp, 3.88%, 01/11/2028	95.238
90.000	Host Hotels & Resorts LP, 3.50%, 15/09/2030	92.759
75.000	MSCI Inc, 5.38%, 15/05/2027	80.063

Neuberger Berman 5G Connectivity Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 6,00%. Durante el mismo periodo, el índice de referencia, el MSCI All-Country World Index (ACWI) (Total Return, Net of Tax, USD) (el "Índice"), rindió un 12,30%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Los mercados de renta variable internacionales empezaron el año con fuerza, movidos principalmente por el sentimiento favorable que infundieron los estímulos económicos adicionales y el incremento del gasto en infraestructuras. Sin embargo, a mediados de febrero, se volvieron volátiles debido al aumento del rendimiento del Tesoro estadounidense a 10 años, el debate sobre la inflación, la escasez mundial de chips y la preocupación por las variantes de la COVID-19, lo que provocó una marcada rotación del mercado desde activos de crecimiento hacia los de valor entre marzo y mayo. Tras la fuerte oleada de ventas del sector tecnológico, las acciones tecnológicas de crecimiento empezaron por fin a comportarse mejor que las acciones de valor cíclicas a finales de mayo, ante el desplome de los tipos y el optimismo acerca de la fortaleza de la recuperación económica.

La Cartera quedó rezagada con respecto a su índice de referencia en el periodo analizado, debido a dos factores: 1) el repunte de la inflación provocado por la recuperación económica en un contexto de continuas restricciones de la oferta y distorsiones en el mercado laboral, agravadas por el temor a un endurecimiento de la política monetaria; y 2) la relativa infraponderación en grandes valores tecnológicos, que tiene por defecto una mayor exposición al sector de Internet chino, bien posicionado a largo plazo, pero afectado temporalmente por el exceso de regulación.

La Cartera invierte en los principales sectores que contribuyen a facilitar el 5G o que se benefician de esta tecnología. Se agrupan en tres categorías distintas: 1) infraestructuras de redes, 2) dispositivos de internet de las cosas ("IoT") y 3) aplicaciones y servicios. En este periodo, Network Infrastructure se comportó de forma excelente gracias a las sólidas tendencias del gasto global en semiconductores. Los dispositivos del Internet de las Cosas (IoT) también se comportaron bien por la fuerte demanda de smartphones con tecnología 5G. Aplicaciones y servicios lastraron la rentabilidad, ya que las acciones de alto crecimiento, principalmente las de Internet orientadas al cliente, quedaron rezagadas en el contexto de rotación del crecimiento al valor.

Aunque es probable que la volatilidad del mercado continúe en la segunda mitad de 2021, seguimos siendo optimistas sobre los fundamentales que respaldan los beneficios, alentados por el mayor despliegue de la red 5G, la adopción de smartphones con tecnología 5G y el surgimiento de aplicaciones de nueva generación que se benefician de la proliferación del 5G. De cara al futuro, prevemos que el próximo despliegue del 5G en EE. UU. sea un factor de estímulo clave. Las valoraciones de las empresas clave que hacen posible la "infraestructura de red 5G" y los "dispositivos conectados" nos parecen especialmente atractivas. También consideramos que las tendencias del 5G y la transformación digital están permitiendo que la industria de semiconductores sea secularmente más fuerte durante más tiempo.

Neuberger Berman 5G Connectivity Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		2.531.294.622	1.364.404.449
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	111.812.069	46.741.952
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		30.607.297	26.878.504
Cuentas a percibir por acciones emitidas		16.098.048	14.376.480
Ingresos a percibir y otros activos		536.373	488.156
Activos totales		2.690.348.409	1.452.889.541
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		4.129.358	592.167
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		7.742.490	989.069
Gastos devengados		3.096.251	1.814.895
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		41.303.221	25.315.386
Otras cuentas por pagar		10.685	856
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		56.282.005	28.712.373
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		2.634.066.404	1.424.177.168

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman 5G Connectivity Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 USD	Periodo finalizado el 30 de junio de 2020* USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		1.830	44
Ingresos por dividendos		4.575.359	120.364
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		106.163.351	4.273.878
		110.740.540	4.394.286
Gastos			
Comisión de gestión	5	15.563.397	104.279
Comisión de distribución	5	865.525	14.794
Comisión de administración	5	763.010	9.776
Comisión de compromiso	16	44.001	–
Comisión de depósito	5	52.629	1.368
Comisión del Depositario	5	54.725	385
Honorarios profesionales	7	72.073	10.021
Honorarios de los Consejeros	6	2.068	1.205
Costes de transacciones	7	2.091.072	30.315
Gastos de constitución	7	10.739	48.118
Honorarios de auditoría	7	9.219	4.338
Reembolso de IVA		(8.226)	(18)
Otros gastos	7	53.160	3.457
Gastos no asumidos	5	–	(20.830)
Gastos totales		19.573.392	207.208
Impuestos retenidos en origen		984.009	10.367
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		90.183.139	4.176.711

* La Cartera comenzó a funcionar el 8 de abril de 2020, por lo que las cifras de resultados no son directamente comparables.

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman 5G Connectivity Fund (cont.)

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

		Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Periodo finalizado el 30 de junio de 2020*
		USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo		1.424.177.168	–
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		90.183.139	4.176.711
Suscripciones	5	1.441.791.026	90.619.369
Reembolsos	5	(322.084.929)	(588.969)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo		2.634.066.404	94.207.111

* La Cartera comenzó a funcionar el 8 de abril de 2020, por lo que las cifras de resultados no son directamente comparables.

Neuberger Berman 5G Connectivity Fund (cont.)

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 96,04% (31 de diciembre de 2020: 95,39%)			
Yuan renminbi chino			
1.086.282	Maxscend Microelectronics Co Ltd Class A	90.371.480	3,43
Total yuan renminbi chino		90.371.480	3,43
Euro			
610.264	Cellnex Telecom SA	38.877.812	1,48
Total euro		38.877.812	1,48
Dólar de Hong Kong			
1.014.700	JD.com Inc Class A	39.904.116	1,51
1.990.200	Kuaishou Technology Class B	49.922.540	1,90
526.800	Tencent Holdings Ltd	39.615.908	1,50
Total dólar de Hong Kong		129.442.564	4,91
Yen japonés			
805.800	Advantest Corp	72.673.736	2,76
1.153.700	Murata Manufacturing Co Ltd	88.167.253	3,35
1.326.809	Taiyo Yuden Co Ltd	65.629.169	2,49
Total yen japonés		226.470.158	8,60
Nuevo dólar taiwanés			
1.994.300	MediaTek Inc	68.856.585	2,62
1.791.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	38.246.568	1,45
19.124.000	United Microelectronics Corp	36.446.277	1,38
Total nuevo dólar taiwanés		143.549.430	5,45
Won de Corea del Sur			
448.847	Samsung Electronics Co Ltd	32.164.412	1,22
465.301	SK Hynix Inc	52.680.263	2,00
Total won de Corea del Sur		84.844.675	3,22
Dólar estadounidense			
280.728	Activision Blizzard Inc	26.792.680	1,02
958.688	Advanced Micro Devices Inc	90.049.564	3,42
120.276	Alibaba Group Holding Ltd ADR	27.276.191	1,04
11.231	Amazon.com Inc	38.636.437	1,47
500.710	Analog Devices Inc	86.202.234	3,27
526.465	Cadence Design Systems Inc	72.030.941	2,73

Neuberger Berman 5G Connectivity Fund (cont.)

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 96,04% (31 de diciembre de 2020: 95,39%) (cont.)			
Dólar estadounidense (cont.)			
471.871	Chegg Inc	39.217.199	1,49
151.334	CrowdStrike Holdings Inc Class A	38.031.748	1,44
75.422	DexCom Inc	32.205.194	1,22
373.556	Entegris Inc	45.936.181	1,74
620.977	Farfetch Ltd Class A	31.272.402	1,19
2.083.753	Flex Ltd	37.236.666	1,41
55.950	HubSpot Inc	32.603.184	1,24
997.640	II-VI Inc	72.418.688	2,75
679.769	Keysight Technologies Inc	104.963.131	3,99
101.285	Lam Research Corp	65.906.149	2,50
648.490	LifeStance Health Group Inc	18.066.931	0,69
1.589.192	Marvell Technology Inc	92.697.569	3,52
133.580	Masimo Corp	32.386.471	1,23
99.322	Microsoft Corp	26.906.330	1,02
213.243	Monolithic Power Systems Inc	79.635.598	3,02
9.625.769	Nokia OYJ ADR	51.209.091	1,94
260.870	Omniceil Inc	39.508.761	1,50
186.346	Pinduoduo Inc ADR	23.669.669	0,90
337.660	Pinterest Inc Class A	26.658.257	1,01
404.887	Qorvo Inc	79.216.142	3,01
185.154	QUALCOMM Inc	26.464.061	1,01
59.327	ServiceNow Inc	32.603.153	1,24
1.223.057	Snap Inc Class A	83.339.104	3,16
5.328.798	Telefonaktiebolaget LM Ericsson ADR	67.036.279	2,55
535.389	T-Mobile US Inc	77.540.389	2,94
1.448.075	Vertiv Holdings Co Class A	39.532.448	1,50
613.237	Zendesk Inc	88.514.629	3,36
176.084	Zscaler Inc	38.044.709	1,44
4.936.476	Zynga Inc Class A	52.474.740	1,99
	Total dólar estadounidense	1.816.282.920	68,95
	Total valores de renta variable *	2.529.839.039	96,04
	Total inversiones	2.529.839.039	96,04

Neuberger Berman 5G Connectivity Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,06% (31 de diciembre de 2020: 0,41%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases AUD con cobertura						
260.964 AUD	195.708 USD	19/07/2021	UBS AG	1	228	0,00
244.639 AUD	183.550 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	129	0,00
2.017.797 USD	2.616.330 AUD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	53.420	0,00
551.641 USD	711.334 AUD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	2	17.561	0,00
1.122.677 USD	1.451.595 AUD	19/07/2021	UBS AG	2	32.799	0,00
2.849.625 USD	3.664.641 AUD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	32	98.160	0,01
Clases CNY con cobertura						
3.386.976 CNY	513.867 USD	19/07/2021	UBS AG	6	9.696	0,00
398.775 CNY	60.971 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	6	672	0,00
5.724 USD	36.664 CNY	19/07/2021	UBS AG	1	57	0,00
30.453 USD	196.279 CNY	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	112	0,00
Clases EUR con cobertura						
1.304.955 €	1.547.197 USD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	906	0,00
34 €	41 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
2.175.221 USD	1.792.393 €	19/07/2021	BNP Paribas	1	48.857	0,00
13.854.376 USD	11.403.879 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	325.647	0,01
15.591.481 USD	12.970.028 €	19/07/2021	UBS AG	4	204.789	0,01
14.515.176 USD	12.004.169 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	42	274.305	0,01
Clases GBP con cobertura						
910.814 £	1.252.059 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	6.248	0,00
18.875.419 £	25.978.652 USD	19/07/2021	UBS AG	2	98.095	0,01
763.587 £	1.053.430 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	8	1.481	0,00
1.051.349 USD	742.879 £	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	25.048	0,00
718.972 USD	512.426 £	19/07/2021	UBS AG	3	11.046	0,00
5.098.045 USD	3.640.695 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	22	68.356	0,00
Clases HKD con cobertura						
127.581.784 HKD	16.412.992 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	16.188	0,00
7.177.643 HKD	922.447 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	1.845	0,00
1.773.509 HKD	228.205 USD	19/07/2021	UBS AG	2	177	0,00
6.316.136 HKD	812.979 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	9	374	0,00
1.182.469 USD	9.177.749 HKD	19/07/2021	UBS AG	7	615	0,00
253.835 USD	1.970.806 HKD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	12	47	0,00
Clases SGD con cobertura						
616.773 SGD	458.749 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	72	0,00
2.057.290 SGD	1.529.450 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	8	982	0,00
8.604.151 USD	11.469.556 SGD	19/07/2021	Goldman Sachs International	5	71.874	0,01
711.138 USD	943.508 SGD	19/07/2021	Standard Chartered Bank	1	9.257	0,00

Neuberger Berman 5G Connectivity Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,06% (31 de diciembre de 2020: 0,41%) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases SGD con cobertura (cont.)						
533.054 USD	709.549 SGD	19/07/2021	UBS AG	1	5.216	0,00
7.346.609 USD	9.779.835 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	53	71.324	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					1.455.583	0,06
					Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados					2.531.294.622	96,10

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,16%) (31 de diciembre de 2020: (0,04%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases AUD con cobertura						
5.622.730 AUD	4.323.348 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	8	(101.723)	(0,00)
380.197 AUD	291.949 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(6.491)	(0,00)
38.518.034 AUD	29.421.536 USD	19/07/2021	UBS AG	5	(501.660)	(0,02)
5.827.296 AUD	4.492.322 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	39	(117.107)	(0,01)
162.193 USD	216.033 AUD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(8)	(0,00)
Clases CNY con cobertura						
249.088 CNY	38.719 USD	19/07/2021	UBS AG	4	(215)	(0,00)
1.254.875 CNY	194.677 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	7	(697)	(0,00)
40.368 USD	262.645 CNY	19/07/2021	UBS AG	6	(231)	(0,00)
31.367 USD	204.679 CNY	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	(272)	(0,00)
Clases EUR con cobertura						
2.683.961 €	3.248.154 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(64.098)	(0,00)
30.673.708 €	37.050.277 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	10	(661.233)	(0,03)
1.956.950 €	2.336.596 USD	19/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(15.014)	(0,00)
180.597.350 €	215.724.792 USD	19/07/2021	UBS AG	7	(1.477.303)	(0,06)
50.594.249 €	60.688.357 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	80	(667.038)	(0,03)
4.472 USD	3.770 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	(0)	(0,00)
Clases GBP con cobertura						
457.892 £	643.116 USD	19/07/2021	Citibank NA	2	(10.530)	(0,00)
641.952 £	903.070 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	3	(16.202)	(0,00)
134.285 £	185.556 USD	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(38)	(0,00)
1.434.224 £	2.006.821 USD	19/07/2021	UBS AG	5	(25.413)	(0,00)
3.764.481 £	5.292.959 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	31	(92.257)	(0,00)
324.661 USD	235.578 £	19/07/2021	Westpac Banking Corp	6	(796)	(0,00)

Neuberger Berman 5G Connectivity Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo (0,16%) (31 de diciembre de 2020: (0,04%)) (cont.)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases HKD con cobertura						
869.203 HKD	111.980 USD	19/07/2021	BNP Paribas	1	(49)	(0,00)
1.858.278 HKD	239.515 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(218)	(0,00)
1.994.607 HKD	257.110 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(257)	(0,00)
1.774.739 HKD	228.654 USD	19/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(114)	(0,00)
16.378.918 HKD	2.110.125 USD	19/07/2021	UBS AG	8	(951)	(0,00)
7.048.567 HKD	908.155 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	12	(486)	(0,00)
2.182.051 USD	16.950.330 HKD	19/07/2021	UBS AG	4	(706)	(0,00)
147.019 USD	1.141.726 HKD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	(5)	(0,00)
Clases SGD con cobertura						
14.819.295 SGD	11.120.528 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	10	(96.360)	(0,00)
92.009.274 SGD	68.603.678 USD	19/07/2021	UBS AG	2	(157.382)	(0,01)
16.808.853 SGD	12.618.649 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	56	(114.433)	(0,00)
122.002 USD	164.098 SGD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	4	(71)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					(4.129.358)	(0,16)

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(4.129.358)	(0,16)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	2.527.165.264	95,94
Otro activo neto	106.901.140	4,06
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	2.634.066.404	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	2.529.839.039	94,03
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	(2.673.775)	(0,10)
Total inversiones	2.527.165.264	93,93

Neuberger Berman 5G Connectivity Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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 período 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 período. Como mínimo, se presentan las 20 compras y las 20 ventas más importantes, siempre que se disponga de dicha información.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
2.574.600	Kuaishou Technology Class B	98.263.011
1.386.000	Snap Inc Class A	85.497.264
1.018.186	II-VI Inc	78.338.346
977.265	Pinterest Inc Class A	75.210.236
552.791	Cadence Design Systems Inc	73.750.422
2.499.504	NAURA Technology Group Co Class A	71.712.473
805.800	Advantest Corp	71.237.760
169.838	Monolithic Power Systems Inc	62.363.192
143.166	HubSpot Inc	60.603.590
1.219.474	Marvell Technology Group Ltd	59.095.092
649.200	Murata Manufacturing Co Ltd	57.867.874
1.607.000	MediaTek Inc	52.806.599
357.208	Keysight Technologies Inc	51.514.828
399.122	T-Mobile US Inc	51.382.302
1.055.700	Taiyo Yuden Co Ltd	51.282.443
580.439	Advanced Micro Devices Inc	50.520.703
831.744	Farfetch Ltd Class A	49.986.237
346.000	Zendesk Inc	49.468.717
10.066.917	Nokia OYJ ADR	47.206.302
403.529	SK Hynix Inc	47.185.829
2.236.232	Vertiv Holdings Co Class A	46.155.960
745.337	Cellnex Telecom SA	43.304.902
77.312	Lam Research Corp	42.903.043
306.422	Omniceil Inc	42.529.678
283.863	Pinduoduo Inc ADR	42.145.738
493.711	Maxscend Microelectronics Co Ltd Class A	41.736.591
3.810.534	Zynga Inc Class A	40.871.411
373.556	Entegris Inc	40.202.393
225.761	Qorvo Inc	39.789.660
855.350	JD.com Inc Class A	38.601.228
2.909.381	Telefonaktiebolaget LM Ericsson ADR	37.481.867
19.124.000	United Microelectronics Corp	36.321.481
227.988	Analog Devices Inc	35.579.827
158.508	CrowdStrike Holdings Inc Class A	32.261.152
160.554	Zscaler Inc	30.299.300
328.663	Chegg Inc	29.631.983

Neuberger Berman 5G Connectivity Fund (cont.)

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
121.997	Masimo Corp	28.947.741
74.067	DexCom Inc	27.571.263
8.017	Amazon.com Inc	26.763.181
258.090	Lumentum Holdings Inc	24.551.046
267.500	Tencent Holdings Ltd	22.870.330

Neuberger Berman 5G Connectivity Fund (cont.)

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
2.499.504	NAURA Technology Group Co Class A	71.881.696
621.417	Lumentum Holdings Inc	49.672.168
352.558	Bandwidth Inc Class A	47.323.470
87.216	HubSpot Inc	46.587.919
1.053.700	JD.com Inc Class A	45.645.820
577.811	II-VI Inc	42.326.483
639.605	Pinterest Inc Class A	41.321.590
168.199	Universal Display Corp	37.580.589
660.418	Cellnex Telecom SA	36.602.771
57.955	Lam Research Corp	36.099.876
87.762	DexCom Inc	35.820.004
957.000	MediaTek Inc	34.721.220
329.115	Maxscend Microelectronics Co Ltd Class A	33.789.507
68.353	Adobe Inc	32.963.376
274.365	SK Hynix Inc	32.035.400
648.926	Farfetch Ltd Class A	31.577.659
205.392	iRhythm Technologies Inc	30.610.608
1.995.500	Win Semiconductors Corp	27.906.931
5.542.090	Nokia OYJ ADR	25.305.908
471.700	Taiyo Yuden Co Ltd	24.896.653
176.093	T-Mobile US Inc	23.416.290
42.569	ServiceNow Inc	22.965.117
9.199	Booking Holdings Inc	21.590.839
89.516	Microsoft Corp	20.980.491
181.963	Acacia Communications Inc	20.779.820
83.120	Okta Inc	18.785.766
788.157	Vertiv Holdings Co Class A	17.307.294
137.197	Assurant Inc	17.015.836
68.700	Alibaba Group Holding Ltd ADR	16.816.393
67.679	Masimo Corp	16.651.332
70.340	CrowdStrike Holdings Inc Class A	15.929.714
939.954	Switch Inc Class A	15.720.422
584.400	Kuaishou Technology Class B	15.434.777
1.478.407	Zynga Inc Class A	15.412.340
283.844	Marvell Technology Inc	15.193.543
56.039	Wix.com Ltd	13.858.348
75.001	Qorvo Inc	13.763.698
59.697	Atlassian Corp Plc Class A	13.598.734

Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I JPY en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 11,94%. En el mismo periodo, el MSCI Japan Small Cap Net Index (USD Total Return, Net of Tax) (el "Índice") registró una rentabilidad del 10,14%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso.)

Durante la primera mitad de 2021, los valores japoneses de pequeña capitalización asistieron a un entorno de mercado volátil ante las expectativas de los inversores sobre una recuperación económica global tras la administración de las vacunas contra la COVID-19 y la subida de los tipos de interés estadounidenses, factores que provocaron recogidas de beneficios de las empresas de crecimiento, así como una rotación hacia las acciones de valor que habían quedado rezagadas durante la mayor parte de 2020. Durante la segunda mitad, el retraso en el arranque de la distribución de vacunas contra la COVID-19 en Japón suscitó inquietud en torno a las perspectivas de la economía y el gasto de los consumidores, lo que hizo que los valores japoneses de pequeña capitalización se comportaran peor que sus homólogos de mercados desarrollados de EE. UU. y Europa. El anuncio de la Reserva Federal estadounidense a mediados de junio de que podría plantearse normalizar su programa de expansión cuantitativa ya a principios de 2023 afectó temporalmente al ánimo de los inversores.

Durante el periodo analizado, la Cartera batió al índice de referencia gracias especialmente a la selección de valores en sectores como tecnología de la información y servicios de comunicaciones, dos áreas en las que estamos más sobreponderados con respecto al índice. Esto ayudó a contrarrestar el efecto negativo de la asignación sectorial resultante de nuestra infraponderación en bienes inmobiliarios y la sobreponderación en atención sanitaria.

Durante la temporada de publicación de resultados de mayo las empresas japonesas anunciaron unas previsiones prudentes para todo el año, a causa de las incertidumbres asociadas al impacto de la COVID-19. Sin embargo, muchos equipos directivos señalaron también la posibilidad de una recuperación en el segundo semestre, dependiendo de la rapidez de la administración de las vacunas, que se ha acelerado sobre todo a finales de junio. A pesar del difícil contexto macroeconómico, nuestro equipo ha seguido encontrando oportunidades de inversión a largo plazo en empresas japonesas de pequeña capitalización con unos sólidos fundamentales empresariales y oportunidades de crecimiento atractivas que están gestionadas por equipos directivos dispuestos a atender a accionistas minoritarios como nosotros para liberar valor y lograr un crecimiento sostenible.

Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 JPY	A 31 de diciembre de 2020 JPY
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		3.922.049.400	739.400.200
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	15.391.306	1.695.768
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		53.537.835	18.842.469
Ingresos a percibir y otros activos		3.784.599	3.044.589
Activos totales		3.994.763.140	762.983.026
Pasivo circulante			
Descubierto bancario	3	11.758	5.689
Gastos devengados		1.571.973	3.216.044
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		–	19.888.793
Otras cuentas por pagar		1.213.319	936.126
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		2.797.050	24.046.652
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		3.991.966.090	738.936.374

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021 JPY	Periodo finalizado el 30 de junio de 2020* JPY
Ingresos			
Ingresos por dividendos		10.726.106	658.982
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		211.071.116	53.492.682
		221.797.222	54.151.664
Gastos			
Comisión de gestión	5	6.168.117	609.702
Comisión de administración	5	1.537.157	330.086
Comisión de compromiso	16	56.920	–
Comisión de depósito	5	496.040	86.093
Comisión del Depositario	5	68.138	3.589
Honorarios profesionales	7	1.934.130	627.788
Honorarios de los Consejeros	6	223.871	73.402
Costes de transacciones	7	3.121.777	462.511
Gastos de constitución	7	–	4.645.761
Honorarios de auditoría	7	618.119	303.555
Reembolso de IVA		(3.505)	–
Otros gastos	7	275.407	226.316
Gastos no asumidos	5	(3.432.198)	(1.800.015)
Gastos totales		11.063.973	5.568.788
Costes financieros			
Gastos por intereses		77.196	–
		77.196	–
Impuestos retenidos en origen		1.608.917	98.848
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		209.047.136	48.484.028

* La Cartera comenzó a funcionar el 12 de mayo de 2020, por lo que las cifras de resultados no son directamente comparables.

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Periodo finalizado el 30 de junio de 2020*
	JPY	JPY
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	738.936.374	–
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	209.047.136	48.484.028
Suscripciones	3.044.698.235	500.000.000
Reembolsos	(715.655)	–
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	3.991.966.090	548.484.028

* La Cartera comenzó a funcionar el 12 de mayo de 2020, por lo que las cifras de resultados no son directamente comparables.

Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (cont.)

Cartera de inversiones

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Número de acciones	Descripción de los valores	Valor razonable JPY	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 98,25% (31 de diciembre de 2020: 100,06%)			
Yen japonés			
4.500	Aidma Holdings Inc	15.817.500	0,40
150.000	Amada Co Ltd	168.450.000	4,22
16.000	Appier Group Inc	25.264.000	0,63
7.300	As One Corp	105.923.000	2,65
14.000	Asahi Intecc Co Ltd	37.184.000	0,93
16.700	Asics Corp	46.960.400	1,18
1.800	BayCurrent Consulting Inc	71.820.000	1,80
14.500	BML Inc	54.955.000	1,38
14.000	Comture Corp	33.194.000	0,83
50.000	Daibiru Corp	70.100.000	1,76
13.200	Daiseki Co Ltd	65.868.000	1,65
92.000	Daiwa Industries Ltd	95.220.000	2,39
24.300	Direct Marketing MiX Inc	100.237.500	2,51
3.200	Edulab Inc	17.760.000	0,45
35.000	eGuarantee Inc	82.215.000	2,06
16.200	Elecom Co Ltd	33.728.400	0,85
3.990	Fast Fitness Japan Inc	17.994.900	0,45
6.200	Fuji Soft Inc	34.534.000	0,87
7.600	Fujimi Inc	38.456.000	0,96
1.300	GMO Financial Gate Inc	28.158.000	0,71
3.000	Harmonic Drive Systems Inc	18.360.000	0,46
18.600	Heiwa Real Estate Co Ltd	77.934.000	1,95
12.000	HPC Systems Inc	47.640.000	1,19
74.000	Ichikoh Industries Ltd	53.576.000	1,34
6.100	IR Japan Holdings Ltd	85.339.000	2,14
33.000	Japan Elevator Service Holdings Co Ltd	85.206.000	2,13
7.500	JMDC Inc	41.550.000	1,04
15.800	JSR Corp	53.088.000	1,33
4.400	Justsystems Corp	28.776.000	0,72
33.100	Kansai Paint Co Ltd	93.706.100	2,35
23.100	KeePer Technical Laboratory Co Ltd	66.990.000	1,68
3.100	Kimura Kohki Co Ltd	8.258.400	0,21
37.400	MCJ Co Ltd	46.338.600	1,16
13.100	Menicon Co Ltd	102.180.000	2,56
25.000	MISUMI Group Inc	94.000.000	2,35
64.000	Musashi Seimitsu Industry Co Ltd	158.336.000	3,97
6.000	Nabtesco Corp	25.200.000	0,63

Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Número de Acciones	Descripción de los valores	Valor razonable JPY	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 98,25% (31 de diciembre de 2020: 100,06%) (cont.)			
Yen japonés (cont.)			
20.400	NEC Networks & System Integration Corp	35.802.000	0,90
10.000	Nihon M&A Center Inc	28.810.000	0,72
21.500	Okinawa Cellular Telephone Co	110.295.000	2,76
4.200	Otsuka Corp	24.486.000	0,61
26.000	Plus Alpha Consulting Co Ltd	73.372.000	1,84
16.100	PR Times Inc	58.684.500	1,47
2.500	Premier Anti-Aging Co Ltd	36.050.000	0,90
195.000	Ricoh Co Ltd	243.165.000	6,09
10.000	Sakai Moving Service Co Ltd	57.600.000	1,44
3.000	Sansan Inc	29.400.000	0,74
17.000	SB Technology Corp	52.105.000	1,31
6.000	Scroll Corp	5.262.000	0,13
31.800	Shinnihonseiyaku Co Ltd	70.850.400	1,77
7.600	SHO-BOND Holdings Co Ltd	35.150.000	0,88
30.000	Shoei Co Ltd	125.850.000	3,15
14.900	Snow Peak Inc	50.064.000	1,25
30.000	TKC Corp	100.950.000	2,53
11.100	Tokyo Century Corp	66.267.000	1,66
136.800	Tokyu Fudosan Holdings Corp	91.382.400	2,29
21.000	ValueCommerce Co Ltd	68.040.000	1,70
1.200	WealthNavi Inc	4.842.000	0,12
37.100	Welbe Inc	53.535.300	1,34
17.000	Yamaha Corp	102.510.000	2,57
19.700	Yokogawa Electric Corp	32.702.000	0,82
16.000	Zenkoku Hosho Co Ltd	76.400.000	1,91
18.700	Zuken Inc	58.157.000	1,46
	Total valores de renta variable *	3.922.049.400	98,25
	Total inversiones	3.922.049.400	98,25

Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

	Valor razonable JPY	% del Patri- monio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados	3.922.049.400	98,25
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	3.922.049.400	98,25
Otro activo neto	69.916.690	1,75
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	3.991.966.090	100,00
Análisis de la cartera	JPY	Activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	3.922.049.400	98,18
Total inversiones	3.922.049.400	98,18

Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste JPY
176.800	Ricoh Co Ltd	202.972.249
133.000	Amada Co Ltd	163.177.310
57.500	Musashi Seimitsu Industry Co Ltd	119.358.280
26.600	Shoei Co Ltd	118.614.995
21.200	Okinawa Cellular Telephone Co	109.374.649
45.000	Plus Alpha Consulting Co Ltd	103.500.000
16.400	Yamaha Corp	100.667.138
25.100	TKC Corp	95.042.179
9.800	Rorze Corp	84.148.677
6.000	As One Corp	83.578.012
74.000	Daiwa Industries Ltd	82.312.607
27.100	Kansai Paint Co Ltd	79.146.891
114.800	Tokyu Fudosan Holdings Corp	74.387.406
21.800	MISUMI Group Inc	73.529.282
10.900	Menicon Co Ltd	72.273.850
13.700	Zenkoku Hosho Co Ltd	69.360.836
20.000	Direct Marketing MiX Inc	68.542.784
4.800	IR Japan Holdings Ltd	67.842.248
16.900	Heiwa Real Estate Co Ltd	65.487.020
27.500	Shinnihonseiyaku Co Ltd	63.134.720
8.800	Tokyo Century Corp	62.986.980
29.000	eGuarantee Inc	62.199.243
43.700	Daibiru Corp	61.343.893
16.000	BML Inc	60.492.148
25.500	Japan Elevator Service Holdings Co Ltd	60.222.698
16.000	ValueCommerce Co Ltd	58.068.748
13.200	Daiseki Co Ltd	55.482.754
15.800	JSR Corp	54.561.289
2.100	BayCurrent Consulting Inc	53.568.297
23.100	KeePer Technical Laboratory Co Ltd	53.365.441
14.900	Snow Peak Inc	53.185.380
10.000	Visional Inc	50.000.000
32.800	Welbe Inc	49.745.433
25.000	NEC Networks & System Integration Corp	48.469.136
9.000	Sakai Moving Service Co Ltd	47.502.031
14.000	SB Technology Corp	46.820.248

Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste JPY
45.200	MCJ Co Ltd	45.559.842
14.800	Zuken Inc	42.904.865
57.000	Ichikoh Industries Ltd	42.511.197
12.100	PR Times Inc	42.055.232
20.300	Yokogawa Electric Corp	42.038.497
7.900	Jeol Ltd	39.958.095
16.000	Takuma Co Ltd	38.388.754
7.600	Fujimi Inc	38.356.778

Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (cont.)

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
10.300	Rorze Corp	97.470.678
10.000	Visional Inc	62.847.198
19.000	Plus Alpha Consulting Co Ltd	53.580.699
9.400	Jeol Ltd	51.509.717
16.000	Takuma Co Ltd	28.583.170
2.500	CyberTrust Japan Co Ltd	25.752.000
6.500	BML Inc	23.430.548
10.000	Coconala Inc	23.214.292
12.500	NEC Networks & System Integration Corp	22.517.517
9.600	Yokogawa Electric Corp	18.235.387
2.100	Coly Inc	17.911.386
3.500	Okinawa Cellular Telephone Co	17.216.685
11.800	Ricoh Co Ltd	15.690.023
15.800	MCJ Co Ltd	15.310.112
2.700	Fast Fitness Japan Inc	13.062.170
300	SK Kaken Co Ltd	11.482.857
300	BayCurrent Consulting Inc	10.931.250
700	Premier Anti-Aging Co Ltd	10.761.999
1.400	Yamaha Corp	9.182.681
1.400	Harmonic Drive Systems Inc	8.916.615
3.300	Shinnihonseiyaku Co Ltd	8.887.742
4.000	TKP Corp	8.781.334
400	GMO Financial Gate Inc	8.486.000
7.000	Scroll Corp	8.381.797
5.400	QD Laser Inc	7.885.886
1.500	Azbil Corp	7.530.827
5.700	Daibiru Corp	7.071.499

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund

Informe del Gestor de inversiones

Durante el periodo de seis meses finalizado el 30 de junio de 2021 (el "periodo analizado") la rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD alcanzó el 3,44%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Durante el periodo analizado, los diferenciales de crédito en emisiones con grado de inversión¹ ("IG") y sin grado de inversión² se estrecharon en 14 pb y 64 pb, respectivamente. Las principales causas de este estrechamiento fueron la fuerte demanda continuada de valores con rentabilidad excedente, los sólidos beneficios empresariales y la mejoría de los fundamentales. Las rentabilidades de la deuda pública de mercados desarrollados se movieron al alza en el periodo analizado: la rentabilidad del bono estadounidense a 10 años aumentó 56 pb; la del bono japonés a 10 años, 4 pb; la del bono británico a 10 años, 52 pb; y la del bono alemán a 10 años, 36 pb.

En este contexto, la cartera generó una rentabilidad positiva durante el periodo. Las asignaciones a deuda de alta rentabilidad de Estados Unidos fueron las que más contribuyeron a los resultados; por subsectores, los que más nos favorecieron fueron las exposiciones a energía, ocio y atención sanitaria. Las asignaciones a bonos corporativos de mercados emergentes, a deuda de alta rentabilidad europea y a crédito europeo con grado de inversión (IG) contribuyeron en menor medida a la rentabilidad. Por el contrario, la asignación al crédito con grado de inversión estadounidense lastró la rentabilidad del periodo, debido sobre todo a la exposición a los subsectores de telecomunicaciones, energía y tecnología.

Creemos probable que la volatilidad del mercado aumente en el segundo semestre del año. Prevemos una retirada gradual de estímulos y un giro de política de la Reserva Federal (la "Fed") y del BCE en el segundo semestre de 2021, lo cual obligará a los mercados a adaptarse a una política monetaria menos acomodaticia incluso con una comunicación y previsión perfectas de los bancos centrales. En segundo lugar, es probable que los mercados se muestren más reactivos a los datos económicos reales. Un avance significativo, tanto al alza como a la baja, del crecimiento y la inflación probablemente afectaría a la trayectoria de la política de los bancos centrales.

Por otra parte, se ha reducido la probabilidad de unos resultados económicos de "cola derecha". De la reunión de la Fed celebrada en junio se desprende que no es deseable permanecer mucho tiempo con tasas de inflación superiores al 3,5%. Por consiguiente, invertir durante periodos prolongados de inflación notablemente superior al 2% probablemente no tenga sentido, dado que la Fed ha definido su umbral de tolerancia de aumento de la inflación, incluso en el contexto de su nuevo marco del objetivo de inflación media. Cuando la Fed comience finalmente a subir los tipos, puede que el ritmo sea más fuerte de lo que se espera actualmente, dependiendo del nivel y de la evolución de la inflación.

Aunque el cambio de tono de la Fed fue el principal acontecimiento en los mercados de renta fija en el primer semestre del año, el segundo semestre debería representar una especie de punto de inflexión para la zona euro a medida que se normaliza la actividad. Los sectores de servicios europeos han reabierto gradualmente a medida que se ha ido controlando la pandemia. Desde julio, el Euro Recovery Fund comenzará a repartir "becas" a países específicos para financiar el gasto en activos fijos durante los próximos trimestres. Además, el BCE ha introducido un nuevo mecanismo de flexibilidad en su programa de compras de bonos, que debería permitirle iniciar sin contratiempos la retirada gradual del Programa de Compras de Emergencia frente a la Pandemia ("PEPP").

Prevemos un entorno constante en el que los tipos de interés se moverán de manera dentro de una banda, con un sesgo alcista en respuesta a una recuperación económica mundial duradera. También es importante destacar que, en nuestra opinión, los detonantes subyacentes de los estrechos diferenciales de crédito, el fuerte crecimiento económico y las bajas tasas de impago probablemente no se vean demasiado afectados por la evolución del panorama de los bancos centrales.

¹ Categoría de inversión: Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporate Index

² Sin grado de inversión: Bloomberg Barclays Global High Yield Corporate Index

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		568.220.042	583.405.806
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	24.675.983	21.734.879
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		1.759.319	93.147
Cuentas a percibir por acciones emitidas		88.931	—
Cuentas por cobrar de intermediarios		11.331.725	572.255
Ingresos a percibir y otros activos		8.504.717	8.114.464
Activos totales		614.580.717	613.920.551
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		4.250.406	3.693.752
Descubierto bancario	3	933	427
Cuentas a pagar por acciones reembolsadas		1.949.640	—
Gastos devengados		152.549	225.896
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		7.214.298	315.000
Otras cuentas por pagar		75.793	40.376
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		13.643.619	4.275.451
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		600.937.098	609.645.100

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Periodo finalizado el 30 de junio de 2020*
		USD	USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		14.549.205	1.045.732
Ingresos por dividendos		5.608	–
Ingresos por préstamo de valores	15	8.219	–
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		11.431.017	(701.344)
		25.994.049	344.388
Gastos			
Comisión de gestión	5	873.635	64.958
Comisión de distribución	5	728	–
Comisión de administración	5	187.076	24.728
Comisión de compromiso	16	28.297	–
Comisión de depósito	5	7.428	1.464
Comisión del Depositario	5	14.683	1.229
Honorarios profesionales	7	31.886	4.097
Honorarios de los Consejeros	6	2.137	423
Costes de transacciones	7	17.978	1.835
Gastos de constitución	7	–	44.222
Honorarios de auditoría	7	8.061	1.945
Reembolso de IVA		(2.777)	–
Otros gastos	7	3.475	1.488
Gastos totales		1.172.607	146.389
Costes financieros			
Repartos de dividendos abonados	1	1.779	–
		1.779	–
Impuestos retenidos en origen		165.233	52.057
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		24.654.430	145.942

* La Cartera comenzó a funcionar el 1 de junio de 2020, por lo que las cifras de resultados no son directamente comparables.

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Periodo finalizado el 30 de junio de 2020*
	USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	609.645.100	–
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	24.654.430	145.942
Suscripciones	44.981.270	311.683.569
Reembolsos	(78.343.702)	(4.998.272)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	600.937.098	306.831.239

* La Cartera comenzó a funcionar el 1 de junio de 2020, por lo que las cifras de resultados no son directamente comparables.

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund (cont.)

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 Tesoro 1,83% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)					
Dólar estadounidense					
11.000.000	United States Treasury Bill	0,00%	19/08/2021	10.999.401	1,83
Total bonos del Tesoro **				10.999.401	1,83
Valores respaldados por activos 1,57% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)					
Dólar estadounidense					
1.500.000	Annisa CLO Ltd Series 2016-2X Class DR	3,19%	20/07/2031	1.505.318	0,25
1.950.000	CIFC Funding Ltd Series 2018-1X Class D	2,84%	18/04/2031	1.928.141	0,32
500.000	CIFC Funding Ltd Series 2018-2X Class C	3,04%	20/04/2031	498.609	0,08
500.000	Octagon Investment Partners 35 Ltd Series 2018-1X Class C	2,79%	20/01/2031	493.981	0,08
2.000.000	TCW CLO Ltd Series 2018-1X Class D	3,09%	25/04/2031	1.989.071	0,33
3.000.000	Trinitas CLO XII Ltd Series 2020-12X Class D	4,18%	25/04/2033	3.034.123	0,51
Total valores respaldados por activos **				9.449.243	1,57
Bonos de empresa 88,08% (31 de diciembre de 2020: 89,62%)					
Euro					
500.000	Accor SA*	2,63%	29/12/2049	579.692	0,10
225.000	Afflelou SAS*	4,25%	19/05/2026	274.623	0,05
698.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl*	3,63%	01/06/2028	820.631	0,14
1.010.000	Altice Finco SA*	4,75%	15/01/2028	1.172.983	0,19
343.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc*	3,00%	01/09/2029	405.854	0,07
925.000	Atrium European Real Estate Ltd*	3,63%	29/12/2049	1.073.647	0,18
2.379.000	Banjay Group SAS**	6,50%	01/03/2026	2.911.592	0,48
750.000	Brunello Bidco SpA*	3,50%	15/02/2028	888.977	0,15
600.000	Casino Guichard Perrachon SA**	3,58%	07/02/2025	692.847	0,11
2.253.000	Casino Guichard Perrachon SA*	6,63%	15/01/2026	2.815.482	0,47
359.000	Cedacri Mergesco SpA*	4,63%	15/05/2028	428.931	0,07
1.098.000	Centurion Bidco SpA*	5,88%	30/09/2026	1.359.081	0,23
919.000	CeramTec BondCo GmbH**	5,25%	15/12/2025	1.107.928	0,18
409.000	Chrome Holdco SASU*	5,00%	31/05/2029	497.796	0,08
2.124.000	CMA CGM SA*	7,50%	15/01/2026	2.799.712	0,47
760.000	doValue SpA**	5,00%	04/08/2025	943.561	0,16
1.024.000	Dufry One BV**	2,00%	15/02/2027	1.144.476	0,19
499.000	Dufry One BV*	3,38%	15/04/2028	587.226	0,10
2.567.000	eG Global Finance Plc*	6,25%	30/10/2025	3.125.790	0,52
289.000	Energizer Gamma Acquisition BV**	3,50%	30/06/2029	341.133	0,06
4.450.000	Fastighets AB Balder*	2,87%	02/06/2081	5.227.543	0,87
1.312.000	Flamingo Lux II SCA*	5,00%	31/03/2029	1.544.736	0,26
503.000	Foncia Management SASU**	3,38%	31/03/2028	592.744	0,10

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund (cont.)

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 88,08% (31 de diciembre de 2020: 89,62%) (cont.)					
Euro (cont.)					
356.000	Grupo Antolin-Irausa SA*	3,50%	30/04/2028	420.873	0,07
1.530.000	House of HR**	7,50%	15/01/2027	1.931.476	0,32
394.000	International Design Group SpA*	4,25%	15/05/2026	471.870	0,08
1.500.000	Intrum AB*	3,00%	15/09/2027	1.755.172	0,29
900.000	IPD 3 BV*	5,50%	01/12/2025	1.109.680	0,18
1.415.000	Kleopatra Holdings 2 SCA*	6,50%	01/09/2026	1.631.980	0,27
1.592.000	La Financiere Atalian SASU*	4,00%	15/05/2024	1.881.372	0,31
2.295.000	Laboratoire Eimer Selas**	5,00%	01/02/2029	2.779.802	0,46
440.000	LeasePlan Corp NV*	7,38%	29/12/2049	583.107	0,10
1.160.000	Loxam SAS*	5,75%	15/07/2027	1.436.172	0,24
1.501.000	Maxeda DIY Holding BV**	5,88%	01/10/2026	1.824.668	0,30
1.201.000	Modulaire Global Finance Plc**	6,50%	15/02/2023	1.457.451	0,24
986.000	Motion Bondco DAC*	4,50%	15/11/2027	1.138.097	0,19
482.000	NH Hotel Group SA*	4,00%	02/07/2026	572.104	0,09
390.000	Nobel Bidco BV**	3,13%	15/06/2028	462.453	0,08
535.000	Ontex Group NV*	3,50%	15/07/2026	633.938	0,11
1.931.000	Paprec Holding SA*	4,00%	31/03/2025	2.335.772	0,39
1.248.000	PCF GmbH*	4,75%	15/04/2026	1.509.607	0,25
291.000	Picard Bondco SA**	5,38%	01/07/2027	345.097	0,06
1.502.000	Pinnacle Bidco Plc*	5,50%	15/02/2025	1.825.006	0,30
750.000	Platin 1426 GmbH**	5,38%	15/06/2023	897.554	0,15
739.000	PLT VII Finance Sarl**	4,63%	05/01/2026	904.454	0,15
472.000	Sazka Group AS**	3,88%	15/02/2027	563.898	0,09
466.000	Sofima Holding SpA*	3,75%	15/01/2028	554.846	0,09
748.000	SpA Holdings 3 Oy*	3,63%	04/02/2028	893.692	0,15
1.487.851	Summer BidCo BV**	9,00%	15/11/2025	1.808.553	0,30
1.500.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	1,63%	15/10/2028	1.566.337	0,26
999.000	TI Automotive Finance Plc**	3,75%	15/04/2029	1.207.228	0,20
3.100.000	Veolia Environnement SA*	2,50%	29/12/2049	3.694.083	0,61
1.501.000	Verisure Midholding AB*	5,25%	15/02/2029	1.828.580	0,30
654.000	Vertical Holdco GmbH**	6,63%	15/07/2028	825.919	0,14
1.000.000	Victoria Plc**	3,75%	15/03/2028	1.203.648	0,20
1.600.000	Vivion Investments Sarl*	3,50%	01/11/2025	1.920.583	0,32
2.702.000	Volkswagen International Finance NV*	4,63%	29/12/2049	3.643.009	0,61
500.000	Wintershall Dea Finance 2 BV*	3,00%	29/12/2049	584.797	0,10
Total euro				79.539.863	13,23

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund (cont.)

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 88,08% (31 de diciembre de 2020: 89,62%) (cont.)					
Libra esterlina					
1.000.000	AA Bond Co Ltd*	6,50%	31/01/2026	1.432.066	0,24
656.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl*	4,88%	01/06/2028	898.379	0,15
1.873.000	CPUK Finance Ltd**	6,50%	28/08/2026	2.739.458	0,46
631.000	Deuce Finco Plc**	5,50%	15/06/2027	871.545	0,14
1.300.000	Encore Capital Group Inc*	4,25%	01/06/2028	1.799.701	0,30
1.200.000	Iceland Bondco Plc**	4,38%	15/05/2028	1.558.967	0,26
514.000	Premier Foods Finance Plc*	3,50%	15/10/2026	709.813	0,12
1.329.000	RAC Bond Co Plc*	5,00%	06/11/2022	1.836.193	0,30
Total libra esterlina				11.846.122	1,97
Dólar estadounidense					
1.000.000	ABJA Investment Co Pte Ltd*	5,45%	24/01/2028	1.071.990	0,18
900.000	Adani Electricity Mumbai Ltd*	3,95%	12/02/2030	900.711	0,15
1.000.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd**	4,38%	03/07/2029	1.049.990	0,18
2.000.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust*	4,63%	15/10/2027	2.241.723	0,37
2.811.445	Air Canada 2020-2 Class A Pass Through Trust**	5,25%	01/04/2029	3.055.955	0,51
2.000.000	Air Lease Corp*	4,63%	01/10/2028	2.256.956	0,38
700.000	Akbank TAS**	6,80%	06/02/2026	737.953	0,12
1.921.612	Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust**	4,80%	15/08/2027	2.131.146	0,35
200.000	Alfa SAB de CV**	6,88%	25/03/2044	264.606	0,04
1.763.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	6,75%	15/10/2027	1.855.081	0,31
1.735.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp**	6,00%	01/06/2029	1.761.216	0,29
2.000.000	Altria Group Inc*	4,25%	09/08/2042	2.096.806	0,35
2.070.000	American Airlines Group Inc**	5,00%	01/06/2022	2.075.216	0,35
4.905.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,75%	20/04/2029	5.309.662	0,88
1.000.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc*	4,44%	06/10/2048	1.200.442	0,20
4.595.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	5,75%	15/01/2028	4.841.660	0,81
873.000	Arabian Centres Sukuk II Ltd*	5,63%	07/10/2026	929.335	0,15
9.650.000	AssuredPartners Inc**	5,63%	15/01/2029	9.669.300	1,61
4.307.000	AT&T Inc**	3,65%	15/09/2059	4.374.272	0,73
1.000.000	AT&T Inc*	4,50%	09/03/2048	1.181.539	0,20
200.000	Atento Luxco 1 SA**	8,00%	10/02/2026	217.587	0,04
480.000	Azul Investments LLP**	7,25%	15/06/2026	471.562	0,08
200.000	B2W Digital Lux Sarl**	4,38%	20/12/2030	200.677	0,03
425.000	Banco Davivienda SA**	6,65%	29/12/2049	446.966	0,07
500.000	Banco de Bogota SA*	6,25%	12/05/2026	548.143	0,09
4.400.000	Bank of America Corp**	5,13%	29/12/2049	4.688.750	0,78
800.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	5,00%	27/07/2027	889.272	0,15

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund (cont.)

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 88,08% (31 de diciembre de 2020: 89,62%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
500.000	BBK BSC*	5,50%	09/07/2024	530.423	0,09
2.000.000	Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp**	7,63%	15/12/2025	2.170.000	0,36
750.000	BOC Aviation Ltd*	3,00%	11/09/2029	771.031	0,13
4.500.000	Boeing Co*	5,81%	01/05/2050	6.069.786	1,01
1.000.000	BP Capital Markets Plc*	4,88%	29/12/2049	1.100.500	0,18
1.000.000	Braskem Idesa SAPI*	7,45%	15/11/2029	1.063.320	0,18
750.000	BRF SA**	4,88%	24/01/2030	788.539	0,13
2.095.000	Buckeye Partners LP**	5,85%	15/11/2043	2.088.233	0,35
2.930.000	Cablevision Lightpath LLC**	5,63%	15/09/2028	2.990.065	0,50
2.560.000	Caesars Entertainment Inc**	8,13%	01/07/2027	2.850.432	0,47
5.650.000	Calpine Corp**	4,63%	01/02/2029	5.570.589	0,93
3.100.000	Capital One Financial Corp**	3,93%	29/12/2049	3.113.035	0,52
7.145.000	Carnival Corp**	5,75%	01/03/2027	7.493.319	1,25
2.585.000	Cars.com Inc**	6,38%	01/11/2028	2.760.547	0,46
2.500.000	Carvana Co**	5,88%	01/10/2028	2.633.975	0,44
726.000	CAS Capital No 1 Ltd*	4,00%	29/12/2049	728.904	0,12
248.000	Cemex SAB de CV**	5,13%	29/12/2049	256.296	0,04
223.000	Champion Path Holdings Ltd*	4,50%	27/01/2026	231.387	0,04
316.000	Champion Path Holdings Ltd*	4,85%	27/01/2028	329.854	0,06
4.800.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	5,75%	01/04/2048	6.119.908	1,02
500.000	China Evergrande Group*	8,25%	23/03/2022	426.488	0,07
3.805.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,13%	01/04/2030	3.866.831	0,64
4.050.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,88%	15/04/2029	4.250.009	0,71
2.205.000	CHS/Community Health Systems Inc**	8,00%	15/12/2027	2.456.050	0,41
4.130.000	Cinemark USA Inc**	5,25%	15/07/2028	4.238.412	0,71
5.500.000	Citigroup Inc**	5,00%	29/12/2049	5.770.050	0,96
1.695.000	Clarivate Science Holdings Corp**	4,88%	30/06/2029	1.741.612	0,29
200.000	CMB International Leasing Management Ltd*	1,88%	12/08/2025	198.296	0,03
252.000	CMB International Leasing Management Ltd*	2,75%	12/08/2030	248.383	0,04
4.065.000	CommScope Inc**	7,13%	01/07/2028	4.410.972	0,73
4.190.000	CommScope Technologies LLC**	5,00%	15/03/2027	4.294.750	0,71
1.090.000	Comstock Resources Inc**	5,88%	15/01/2030	1.113.162	0,19
2.553.000	Comstock Resources Inc**	6,75%	01/03/2029	2.722.723	0,45
3.155.000	Cornerstone Building Brands Inc**	6,13%	15/01/2029	3.390.174	0,56
200.000	Cosan SA**	5,50%	20/09/2029	216.100	0,04
750.000	Country Garden Holdings Co Ltd*	7,25%	08/04/2026	833.722	0,14
5.140.000	CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**	5,50%	15/06/2031	5.362.254	0,89
4.885.000	CSC Holdings LLC**	5,75%	15/01/2030	5.080.400	0,85

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund (cont.)

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 88,08% (31 de diciembre de 2020: 89,62%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
1.217.000	CSN Inova Ventures**	6,75%	28/01/2028	1.347.523	0,22
1.158.000	CSN Resources SA**	4,63%	10/06/2031	1.184.472	0,20
550.000	CSN Resources SA**	7,63%	17/04/2026	593.830	0,10
1.925.000	Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC**	8,00%	01/02/2028	2.081.628	0,35
3.200.000	Dell International LLC/EMC Corp*	6,20%	15/07/2030	4.118.214	0,69
4.800.000	Discover Financial Services**	5,50%	29/12/2049	5.159.808	0,86
3.825.000	Discovery Communications LLC**	4,00%	15/09/2055	4.056.054	0,68
2.710.000	DISH DBS Corp**	7,38%	01/07/2028	2.919.700	0,49
550.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank*	4,13%	30/06/2028	550.286	0,09
750.000	Embraer Netherlands Finance BV*	6,95%	17/01/2028	859.688	0,15
600.000	Emirates NBD Bank PJSC*	4,25%	29/12/2049	619.086	0,10
300.000	Empresas Publicas de Medellin ESP**	4,38%	15/02/2031	296.975	0,05
2.045.000	Endure Digital Inc**	6,00%	15/02/2029	2.027.423	0,34
341.773	Energean Israel Finance Ltd*	4,88%	30/03/2026	349.857	0,06
2.300.000	Energy Transfer LP*	6,13%	15/12/2045	2.936.499	0,49
496.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd*	3,38%	12/05/2026	506.192	0,08
1.500.000	Enterprise Products Operating LLC*	4,85%	15/03/2044	1.837.058	0,31
1.170.000	Envision Healthcare Corp**	8,75%	15/10/2026	822.065	0,14
3.655.000	EPR Properties**	4,95%	15/04/2028	3.951.186	0,66
8.285.000	EQM Midstream Partners LP**	4,75%	15/01/2031	8.547.552	1,42
1.510.000	FirstEnergy Corp*	5,35%	15/07/2047	1.814.647	0,30
3.915.000	Ford Motor Co*	7,40%	01/11/2046	5.155.663	0,86
1.500.000	Franshion Brilliant Ltd*	4,25%	23/07/2029	1.494.273	0,25
4.590.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,88%	15/10/2027	4.922.775	0,82
835.000	FS Luxembourg Sarl**	10,00%	15/12/2025	935.238	0,16
403.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,63%	31/03/2036	394.677	0,07
1.820.000	Garda World Security Corp**	6,00%	01/06/2029	1.808.725	0,30
5.705.000	Garda World Security Corp**	9,50%	01/11/2027	6.329.926	1,05
800.000	Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA*	5,15%	11/02/2026	899.425	0,15
491.000	GC Treasury Center Co Ltd*	2,98%	18/03/2031	502.610	0,08
5.100.000	General Motors Co*	5,00%	01/04/2035	6.175.518	1,03
1.855.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	8,00%	15/01/2027	1.951.228	0,32
200.000	Geopark Ltd**	5,50%	17/01/2027	202.252	0,03
3.481.800	Global Aircraft Leasing Co Ltd**	6,50%	15/09/2024	3.503.648	0,58
5.400.000	Goldman Sachs Group Inc**	4,95%	29/12/2049	5.785.344	0,96
1.905.000	Graham Packaging Co Inc**	7,13%	15/08/2028	2.057.991	0,34
388.987	Guara Norte Sarl**	5,20%	15/06/2034	406.024	0,07
1.905.000	Harvest Midstream I LP**	7,50%	01/09/2028	2.072.640	0,35

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund (cont.)

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 88,08% (31 de diciembre de 2020: 89,62%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
3.600.000	HCA Inc*	5,25%	15/06/2049	4.597.680	0,77
3.696.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	6,00%	01/02/2031	3.922.380	0,65
1.000.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	3,38%	24/02/2030	688.240	0,11
1.000.000	Huarong Finance II Co Ltd*	5,50%	16/01/2025	742.570	0,12
750.000	Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru**	6,38%	01/06/2028	792.188	0,13
466.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT*	3,40%	09/06/2031	473.262	0,08
2.080.000	Intelligent Packaging Ltd Finco Inc/Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC**	6,00%	15/09/2028	2.168.722	0,36
350.000	Investment Energy Resources Ltd*	6,25%	26/04/2029	379.313	0,06
4.370.000	Iron Mountain Inc**	5,63%	15/07/2032	4.693.686	0,78
1.480.000	ITT Holdings LLC**	6,50%	01/08/2029	1.509.600	0,25
850.000	JBS Finance Luxembourg Sarl**	3,63%	15/01/2032	850.587	0,14
500.000	JBS USA Food Co*	7,00%	15/01/2026	531.378	0,09
278.000	JMH Co Ltd*	2,50%	09/04/2031	281.576	0,05
5.500.000	JPMorgan Chase & Co**	5,00%	29/12/2049	5.816.662	0,97
575.000	JSW Hydro Energy Ltd*	4,13%	18/05/2031	584.166	0,10
400.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	10,50%	15/01/2025	375.727	0,06
548.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	10,88%	23/07/2023	547.244	0,09
600.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	11,25%	16/04/2025	566.827	0,09
250.000	Kaisa Group Holdings Ltd*	11,70%	11/11/2025	236.054	0,04
2.000.000	Kinder Morgan Energy Partners LP*	5,50%	01/03/2044	2.513.022	0,42
200.000	Klabn Austria GmbH**	3,20%	12/01/2031	196.844	0,03
500.000	KOC Holding AS*	5,25%	15/03/2023	515.018	0,09
400.000	Kosmos Energy Ltd*	7,13%	04/04/2026	397.806	0,07
1.058.000	Krung Thai Bank PCL*	4,40%	29/12/2049	1.071.193	0,18
700.000	Leviathan Bond Ltd*	6,75%	30/06/2030	788.367	0,13
2.260.000	Lions Gate Capital Holdings LLC**	5,50%	15/04/2029	2.378.752	0,40
1.575.000	Lumen Technologies Inc**	5,38%	15/06/2029	1.600.594	0,27
838.000	MARB BondCo Plc*	3,95%	29/01/2031	809.047	0,13
2.180.000	Matador Resources Co**	5,88%	15/09/2026	2.248.343	0,37
800.000	Medco Bell Pte Ltd*	6,38%	30/01/2027	826.272	0,14
800.000	MEGlobal Canada ULC*	5,88%	18/05/2030	989.106	0,16
204.000	Meituan*	3,05%	28/10/2030	202.055	0,03
800.000	Melco Resorts Finance Ltd**	5,63%	17/07/2027	837.112	0,14
200.000	MercadoLibre Inc**	3,13%	14/01/2031	196.600	0,03
1.000.000	Metinvest BV*	8,50%	23/04/2026	1.141.862	0,19
1.250.000	MHP SE*	7,75%	10/05/2024	1.360.696	0,23
1.200.000	Millicom International Cellular SA**	4,50%	27/04/2031	1.243.650	0,20
500.000	Minera Mexico SA de CV**	4,50%	26/01/2050	561.090	0,09

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund (cont.)

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 88,08% (31 de diciembre de 2020: 89,62%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
603.000	Mizrahi Tefahot Bank Ltd*	3,08%	07/04/2031	609.030	0,10
828.000	Movida Europe SA**	5,25%	08/02/2031	838.367	0,14
3.925.000	MPH Acquisition Holdings LLC**	5,75%	01/11/2028	3.949.472	0,66
1.500.000	MPLX LP*	5,50%	15/02/2049	1.945.890	0,32
880.000	Natura Cosméticos SA**	4,13%	03/05/2028	903.100	0,15
4.000.000	Natwest Group Plc*	3,03%	28/11/2035	4.011.400	0,67
2.000.000	NCL Finance Ltd**	6,13%	15/03/2028	2.101.820	0,35
741.000	Nemak SAB de CV**	3,63%	28/06/2031	746.150	0,12
7.210.000	New Fortress Energy Inc**	6,50%	30/09/2026	7.376.190	1,23
400.000	Nexa Resources SA**	5,38%	04/05/2027	430.692	0,07
202.000	OCP SA*	3,75%	23/06/2031	204.475	0,03
284.000	OQ SAOC*	5,13%	06/05/2028	286.182	0,05
300.000	Orbia Advance Corp SAB de CV*	5,88%	17/09/2044	365.108	0,06
1.764.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc/Ortho-Clinical Diagnostics SA**	7,25%	01/02/2028	1.930.257	0,32
272.000	Oryx Funding Ltd*	5,80%	03/02/2031	286.935	0,05
750.000	Oztel Holdings SPC Ltd*	6,63%	24/04/2028	830.523	0,14
1.625.000	Periama Holdings LLC*	5,95%	19/04/2026	1.759.367	0,29
635.000	Petrobras Global Finance BV*	5,50%	10/06/2051	636.016	0,11
2.208.000	Petrobras Global Finance BV*	5,60%	03/01/2031	2.475.720	0,41
668.000	Petroleos del Peru SA*	5,63%	19/06/2047	712.923	0,12
2.000.000	Petroleos Mexicanos*	6,50%	23/01/2029	2.061.000	0,34
471.000	Petrorio Luxembourg Sarl**	6,13%	09/06/2026	482.422	0,08
1.955.000	PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp**	7,75%	15/02/2029	2.157.831	0,36
2.690.000	Pilgrim's Pride Corp**	4,25%	15/04/2031	2.790.875	0,46
2.000.000	Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp**	3,55%	15/12/2029	2.108.109	0,35
1.500.000	Power Finance Corp Ltd*	4,50%	18/06/2029	1.602.975	0,27
2.520.000	Presidio Holdings Inc**	8,25%	01/02/2028	2.749.748	0,46
2.550.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	6,25%	15/01/2028	2.715.801	0,45
1.000.000	Qatar Petroleum*	2,25%	12/07/2031	989.370	0,16
499.000	Qatar Petroleum Development Co*	3,13%	12/07/2041	497.159	0,08
3.590.000	Radiate Holdco LLC/Radiate Finance Inc**	6,50%	15/09/2028	3.776.698	0,63
7.650.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	5,75%	15/01/2029	8.007.943	1,33
500.000	Rede D'or Finance Sarl**	4,50%	22/01/2030	513.938	0,09
3.500.000	Reynolds American Inc*	5,85%	15/08/2045	4.292.297	0,71
341.000	RKPF Overseas 2020 A Ltd*	5,20%	12/01/2026	343.303	0,06
3.195.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	5,50%	01/04/2028	3.350.117	0,56
5.130.000	Royal Caribbean Cruises Ltd*	7,50%	15/10/2027	5.961.086	0,99
750.000	Rumo Luxembourg Sarl**	5,25%	10/01/2028	803.738	0,13

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund (cont.)

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 88,08% (31 de diciembre de 2020: 89,62%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
1.400.000	Saka Energi Indonesia PT*	4,45%	05/05/2024	1.331.036	0,22
750.000	Sands China Ltd*	5,40%	08/08/2028	871.642	0,15
1.374.000	Sasol Financing USA LLC*	4,38%	18/09/2026	1.423.814	0,24
750.000	Sasol Financing USA LLC*	5,88%	27/03/2024	802.886	0,13
1.000.000	Sasol Financing USA LLC*	6,50%	27/09/2028	1.128.460	0,19
4.275.000	Scientific Games International Inc**	7,00%	15/05/2028	4.677.705	0,78
600.000	SEPLAT Energy Plc*	7,75%	01/04/2026	627.303	0,10
2.802.000	Service Properties Trust**	3,95%	15/01/2028	2.649.263	0,44
933.000	Service Properties Trust**	4,95%	15/02/2027	931.269	0,16
532.000	Shriram Transport Finance Co Ltd*	4,40%	13/03/2024	534.527	0,09
500.000	Shriram Transport Finance Co Ltd*	5,10%	16/07/2023	509.000	0,08
1.402.000	SierraCol Energy Andina LLC**	6,00%	15/06/2028	1.420.857	0,24
423.000	Simpar Europe SA**	5,20%	26/01/2031	434.793	0,07
530.000	SK Hynix Inc*	2,38%	19/01/2031	517.171	0,09
800.000	Southern Copper Corp*	6,75%	16/04/2040	1.142.408	0,19
1.008.000	State Agency of Roads of Ukraine*	6,25%	24/06/2028	1.009.860	0,17
535.000	StoneCo Ltd**	3,95%	16/06/2028	534.476	0,09
500.000	Studio City Finance Ltd*	6,50%	15/01/2028	536.853	0,09
530.000	Summer BC Bidco B LLC**	5,50%	31/10/2026	539.508	0,09
522.000	Sunac China Holdings Ltd*	6,50%	26/01/2026	503.194	0,08
3.500.000	Sunac China Holdings Ltd*	7,00%	09/07/2025	3.444.184	0,57
1.900.000	Suzano Austria GmbH*	5,00%	15/01/2030	2.155.075	0,36
2.520.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00%	31/12/2030	2.626.621	0,44
2.175.000	Team Health Holdings Inc**	6,38%	01/02/2025	2.073.058	0,35
3.145.000	Tenet Healthcare Corp**	6,13%	01/10/2028	3.360.401	0,56
200.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd*	3,75%	18/06/2050	191.539	0,03
1.000.000	T-Mobile USA Inc*	4,50%	15/04/2050	1.191.983	0,20
1.410.000	TMS International Corp**	6,25%	15/04/2029	1.482.263	0,25
332.000	Total Play Telecomunicaciones SA de CV**	7,50%	12/11/2025	352.386	0,06
529.000	Tullow Oil Plc*	10,25%	15/05/2026	556.505	0,09
1.000.000	Türkiye Petrol Rafinerileri AS*	4,50%	18/10/2024	1.001.801	0,17
677.000	Türkiye Vakıflar Bankası TAO*	6,50%	08/01/2026	691.988	0,12
500.000	Ultrapar International SA*	5,25%	06/06/2029	539.058	0,09
1.300.000	Unigel Luxembourg SA*	8,75%	01/10/2026	1.411.228	0,23
7.390.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC**	6,50%	15/02/2029	7.418.784	1,23
500.000	Usiminas International Sarl**	5,88%	18/07/2026	542.835	0,09
500.000	Vale Overseas Ltd*	8,25%	17/01/2034	731.250	0,12
853.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	8,95%	11/03/2025	839.092	0,14

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund (cont.)

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 88,08% (31 de diciembre de 2020: 89,62%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
1.032.000	Vedanta Resources Ltd*	7,13%	31/05/2023	957.706	0,16
1.160.000	Vistra Operations Co LLC**	4,38%	01/05/2029	1.167.250	0,19
345.000	Volcan Compania Minera SAA*	4,38%	11/02/2026	342.678	0,06
500.000	Votorantim Cimentos International SA**	7,25%	05/04/2041	680.140	0,11
750.000	VTR Finance NV**	6,38%	15/07/2028	797.689	0,13
200.000	West China Cement Ltd*	4,95%	08/07/2026	202.750	0,03
2.985.000	White Capital Buyer LLC**	6,88%	15/10/2028	3.198.830	0,53
200.000	Wynn Macau Ltd*	5,63%	26/08/2028	209.126	0,03
1.000.000	XP Inc**	3,25%	01/07/2026	990.000	0,16
500.000	YPF SA*	8,50%	23/03/2025	446.878	0,07
750.000	YPF SA*	8,50%	28/07/2025	594.563	0,10
450.000	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd*	3,13%	16/07/2025	450.563	0,08
Total dólar estadounidense				437.940.314	72,88
Total bonos de empresa				529.326.299	88,08
Bonos del Estado 2,27% (31 de diciembre de 2020: 1,12%)					
Euro					
968.000	Ivory Coast Government International Bond	6,63%	22/03/2048	1.200.659	0,20
1.050.000	Ivory Coast Government International Bond	6,88%	17/10/2040	1.357.639	0,23
904.000	Republic of Cameroon International Bond	5,95%	07/07/2032	1.072.054	0,18
529.000	Senegal Government International Bond	5,38%	08/06/2037	619.531	0,10
Total euro				4.249.883	0,71
Dólar estadounidense					
500.000	Angolan Government International Bond	8,25%	09/05/2028	521.159	0,09
436.000	Dominican Republic International Bond	5,30%	21/01/2041	436.004	0,07
928.000	Egypt Government International Bond	7,50%	16/02/2061	872.738	0,15
800.000	Egypt Government International Bond	7,63%	29/05/2032	847.005	0,14
799.000	Ghana Government International Bond	7,75%	07/04/2029	815.854	0,14
298.000	Oman Government International Bond	6,25%	25/01/2031	319.515	0,05
398.000	Oman Sovereign Sukuk Co	4,88%	15/06/2030	407.800	0,07
600.000	Sri Lanka Government International Bond	5,88%	25/07/2022	510.000	0,08
1.224.000	Turk Ihracat Kredi Bankasi AS	5,75%	06/07/2026	1.216.471	0,20
800.000	Turkey Government International Bond	5,25%	13/03/2030	761.552	0,13
591.000	Ukraine Government International Bond	6,88%	21/05/2029	612.800	0,10
1.000.000	Ukraine Government International Bond	7,38%	25/09/2032	1.049.890	0,17
1.005.000	United States Treasury Note/Bond	0,13%	31/05/2022	1.005.360	0,17
Total dólar estadounidense				9.376.148	1,56
Total bonos del Estado *				13.626.031	2,27

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund (cont.)

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
Fondos de inversión 0,08% (31 de diciembre de 2020: 0,00%)			
Libra esterlina			
394.721	NB Global Monthly Income Fund Ltd	479.853	0,08
Total fondos de inversión ^h		479.853	0,08
Total inversiones		563.880.827	93,83

Contratos de divisas a plazo 0,63% (31 de diciembre de 2020: 4,88%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
400.000 €	550.335 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	2.273	0,00
309.449 €	359.000 €	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	1.618	0,00
850.330 USD	698.000 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	22.274	0,01
924.704 USD	656.000 €	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	18.427	0,00
888.336 USD	631.000 €	19/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	16.597	0,00
92.928.796 USD	77.466.658 €	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	5	1.028.018	0,17
2.771.654 USD	2.000.000 €	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	8.616	0,00
1.218.527 USD	1.000.000 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	32.200	0,01
Clases CAD con cobertura						
5.098.218 CAD	4.059.132 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	57.938	0,01
5.175.991 CAD	4.118.484 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	61.391	0,01
5.022.125 CAD	3.998.797 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	56.825	0,01
Clases EUR con cobertura						
4.271.309 USD	3.510.000 €	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	107.302	0,02
15.434.714 USD	12.744.823 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	7	315.188	0,05
Clases GBP con cobertura						
129.195.845 €	177.892.486 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	594.013	0,10
132.229.003 €	182.008.544 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	668.320	0,11
127.267.549 €	175.125.238 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	697.282	0,11
5.748.341 USD	4.089.400 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	98.758	0,02
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ^{oo}					3.787.040	0,63

Contratos de futuros 0,02% (31 de diciembre de 2020: 0,03%)

Número de contratos	Descripción	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
43	Euro-Bund Future September 2021	47.424	0,01
(124)	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future September 2021	46.505	0,01
Plusvalía latente total sobre contratos de futuros [±]		93.929	0,02

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de swap de rentabilidad total (0,08%) (31 de diciembre de 2020: 0,05%)

	Importe nominal	Fecha de extinción	Tipo variable	Entidad de referencia	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
USD	13.811.250	15/02/2029	0,75 ¹	Goldman Sachs Basket SDHY ²	168.324	0,03
USD	34.999.892	20/09/2021	0,13 ³	iBoxx USD Liquid High Yield Index ²	149.928	0,03
USD	12.000.087	20/09/2021	0,13 ³	iBoxx USD Liquid High Yield Index ⁴	83.205	0,01
USD	5.799.982	20/09/2021	0,13 ³	iBoxx USD Liquid High Yield Index ⁴	38.297	0,01
USD	27.080.000	04/02/2028	0,64 ¹	JPMorgan Bond Basket ⁴	18.492	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de swap de rentabilidad total[∞]					458.246	0,08

¹ El tipo de interés efectivo de los fondos de la Fed a un día es la referencia para este contrato de swap de rentabilidad total.

² La contraparte en este contrato de swap de rentabilidad total es Goldman Sachs International.

³ El LIBOR a 3 meses es la referencia para este contrato de swap de rentabilidad total.

⁴ La contraparte en este 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	568.220.042	94,56

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,23%) (31 de diciembre de 2020: (0,58%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
3.000.000 €	3.671.550 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(112.570)	(0,02)
3.460.579 €	4.165.537 USD	19/07/2021	JPMorgan Chase Bank	3	(60.159)	(0,01)
38.727 €	54.786 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(1.284)	(0,00)
2.000.000 €	2.830.804 USD	19/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(67.766)	(0,01)
798 USD	1.000 CAD	19/07/2021	JPMorgan Chase Bank	1	(10)	(0,00)
12.775.396 USD	9.257.871 €	19/07/2021	State Street Bank and Trust and Co	1	(14.528)	(0,00)
Clases CAD con cobertura						
169.872 CAD	139.176 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	2	(1.996)	(0,00)
94.427 CAD	78.415 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(2.161)	(0,00)
Clases EUR con cobertura						
7.347.152 €	8.808.811 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	(92.687)	(0,01)
7.543.006 €	9.045.278 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	4	(96.807)	(0,02)
7.561.589 €	9.057.136 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	12	(86.618)	(0,01)
Clases GBP con cobertura						
28.122.794 €	39.741.292 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	12	(889.122)	(0,15)
3.341.850 USD	2.421.300 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	(3.222)	(0,00)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo[∞]					(1.428.930)	(0,23)

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de futuros (0,48%) (31 de diciembre de 2020: (0,03%))

Número de contratos	Descripción	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
(442)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future September 2021	(217.650)	(0,04)
(275)	US Treasury 10-Year Ultra Future September 2021	(708.984)	(0,12)
(98)	US Treasury Long Bond (CBT) Future September 2021	(355.890)	(0,06)
(191)	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future September 2021	(1.538.952)	(0,26)
Minusvalía latente total sobre contratos de futuros *		(2.821.476)	(0,48)

	Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados	(4.250.406)	(0,71)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	563.969.636	93,85
Otro activo neto	36.967.462	6,15
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	600.937.098	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	209.294.857	34,05
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	354.106.117	57,61
μ Fondos de inversión	479.853	0,08
± Instrumentos financieros derivados negociados en mercados regulados	(2.727.547)	(0,44)
∞ Instrumentos financieros derivados que se negocian en mercados OTC	2.816.356	0,46
Total inversiones	563.969.636	91,76

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

20 compras de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
16.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 19/08/2021	15.999.582
8.900.000	Fastighets AB Balder, 2.87%, 02/06/2081	10.821.738
8.285.000	EQM Midstream Partners LP, 4.75%, 15/01/2031	8.164.315
7.650.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp., 5.75%, 15/01/2029	7.775.775
7.675.000	TransDigm Inc, 4.88%, 01/05/2029	7.646.450
7.535.000	AssuredPartners Inc, 5.63%, 15/01/2029	7.643.019
7.390.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC, 6.50%, 15/02/2029	7.491.214
7.210.000	New Fortress Energy Inc, 6.50%, 30/09/2026	7.277.800
7.145.000	Carnival Corp, 5.75%, 01/03/2027	7.170.356
5.130.000	Royal Caribbean Cruises Ltd, 7.50%, 15/10/2027	5.783.025
5.695.000	TransDigm Inc, 4.63%, 15/01/2029	5.682.027
5.650.000	Calpine Corp, 4.63%, 01/02/2029	5.667.501
5.140.000	CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC, 5.50%, 15/06/2031	5.140.000
4.905.000	American Airlines, Inc./AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.75%, 20/04/2029	5.102.281
4.175.000	Atrium European Real Estate Ltd, 3.63%, 29/12/2049	4.953.492
4.445.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp, 5.75%, 15/01/2028	4.510.850
4.120.000	Royal Caribbean Cruises Ltd, 5.50%, 01/04/2028	4.274.688
4.190.000	CommScope Technologies LLC, 5.00%, 15/03/2027	4.191.468
4.130.000	Cinemark USA Inc, 5.25%, 15/07/2028	4.130.000
4.050.000	CHS/Community Health Systems Inc, 6.88%, 15/04/2029	4.125.437

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas (cont.)

20 ventas de mayor valor:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
6.618.000	BP Capital Markets Plc, 3.63%, 29/12/2049	8.674.512
7.675.000	TransDigm Inc, 4.88%, 01/05/2029	7.511.906
6.500.000	Marathon Oil Corp, 4.40%, 15/07/2027	7.255.985
5.695.000	TransDigm Inc, 4.63%, 15/01/2029	5.652.288
4.450.000	Fastighets AB Balder, 2.87%, 02/06/2081	5.322.875
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 19/08/2021	4.999.960
3.900.000	ConocoPhillips, 4.88%, 01/10/2047	4.897.191
4.100.000	LYB International Finance III LLC, 4.20%, 01/05/2050	4.703.857
4.250.000	Occidental Petroleum Corp, 5.88%, 01/09/2025	4.632.500
4.500.000	BAT Capital Corp, 2.73%, 25/03/2031	4.607.325
4.000.000	Delta Air Lines Inc/SkyMiles IP Ltd, 4.75%, 20/10/2028	4.350.000
4.000.000	Southern Co, 4.00%, 15/01/2051	4.265.000
3.745.000	Altice France Holding SA, 10.50%, 15/05/2027	4.183.090
3.659.344	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust, 5.88%, 15/10/2027	4.066.446
3.300.000	Kinder Morgan Energy Partners LP, 5.50%, 01/03/2044	4.064.087
3.250.000	Atrium European Real Estate Ltd, 3.63%, 29/12/2049	3.868.206
3.540.000	TransDigm Inc, 5.50%, 15/11/2027	3.659.652
3.598.000	Calpine Corp, 5.00%, 01/02/2031	3.651.970
3.112.000	Carnival Corp, 9.88%, 01/08/2027	3.574.910
3.310.000	GTCR AP Finance Inc, 8.00%, 15/05/2027	3.558.250

Neuberger Berman Global Diversified Income FMP - 2024 Fund

Informe del Gestor de inversiones

Durante el periodo de seis meses finalizado el 30 de junio de 2021 (el "periodo analizado") la rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD alcanzó el 0,76%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Durante el periodo analizado, los diferenciales de crédito en emisiones con grado de inversión¹ ("IG") y sin grado de inversión² se estrecharon en 14 pb y 64 pb, respectivamente. Las principales causas de este estrechamiento fueron la fuerte demanda continuada de valores con rentabilidad excedente, los sólidos beneficios empresariales y la mejoría de los fundamentales. Las rentabilidades de la deuda pública a corto plazo de mercados desarrollados se movieron al alza en el periodo: la rentabilidad del bono estadounidense a dos años aumentó 13 pb; la del bono japonés a dos años, 3 pb; la del bono alemán a dos años, 4 pb; y la del bono británico a dos años, 22 pb.

La rentabilidad superior registrada en el periodo se debió principalmente a las asignaciones de la cartera a deuda de alta rentabilidad de los mercados desarrollados y crédito con grado de inversión. En el segmento de alta rentabilidad, la exposición de la cartera a las empresas de ocio, industria básica y energía midstream resultó clave para la rentabilidad. La exposición a empresas financieras fue el factor que más contribuyó a la rentabilidad en crédito con grado de inversión, mientras que las exposiciones a bonos corporativos de mercados emergentes de la cartera la mermaron durante el periodo.

Estamos seguros de que los fundamentales de las empresas con grado de inversión van a seguir mejorando y nuestro equipo de análisis cree que los indicadores de crédito a 12 meses probablemente serán mejores en general que en la actualidad. El ámbito de la oferta del panorama técnico también debería seguir en positivo, pues muchas empresas ya han adelantado sus emisiones este año, lo que probablemente reducirá las emisiones en el tramo final del mismo. La sólida demanda suscita algo más de dudas desde el punto de vista técnico, pero el crédito estadounidense en particular debería seguir respaldado por las compras extranjeras, que se mantienen en niveles elevados gracias a unos costes de cobertura relativamente bajos.

A nuestro parecer, las valoraciones en las áreas de alta rentabilidad y préstamos reflejan unas perspectivas de impagos muy favorables, lo que depende de la mejora de los fundamentales y la capacidad de los emisores para refinanciarse a tipos más bajos. El apalancamiento neto de la alta rentabilidad está disminuyendo y se espera que se establezca en el cuartil inferior histórico, mientras que la cobertura de intereses sobre el índice roza su máximo. El crecimiento del EBITDA de los préstamos también es sumamente positivo y los balances se encuentran saneados en general. Las condiciones del crédito por lo general favorecen una reducción de los diferenciales y, en alta rentabilidad, la proporción de bonos con calificación BB roza o alcanza el nivel máximo histórico del 53% del total en circulación. Aunque los niveles de los rendimientos absolutos de los mercados de alta rentabilidad global son bajos desde el punto de vista histórico, la mayor proporción de títulos de crédito de alta calidad y el hecho de que estemos iniciando un nuevo ciclo de crédito son factores importantes que debemos tener en cuenta cuando pensemos en los diferenciales y los niveles de los rendimientos. Además, el potencial de compresión de los diferenciales se mantiene al persistir la demanda de rendimiento con menor duración entre los inversores.

Las expectativas de crecimiento mundial para el resto de 2021 siguen siendo alentadoras, siendo probable que los ME se beneficien de la incesante recuperación cíclica, tal como reflejan tanto los datos de manufacturas como los precios de las materias primas. La aceleración de la vacunación prevista para el segundo semestre del año en el mundo emergente probablemente favorecerá a la dinámica del crecimiento doméstico. Prevemos un rebote del EBITDA de la deuda corporativa de ME y una mejora de las métricas de apalancamiento de las empresas. Creemos que los impagos de bonos corporativos de alta rentabilidad en mercados emergentes probablemente seguirán contenidos de aquí en adelante, con una tasa de morosidad estimada del 2,9% para 2021, en consonancia con el promedio a 10 años de esta clase de activos. Creemos que las valoraciones de la deuda corporativa de ME se sitúan dentro de un rango de valor razonable pero todavía atractivo en comparación con los mercados desarrollados.

¹ Categoría de inversión: Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporate Index

² Sin grado de inversión: Bloomberg Barclays Global High Yield Corporate Index.

Neuberger Berman Global Diversified Income FMP - 2024 (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD	A 31 de diciembre de 2020 USD
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		245.532.887	257.685.649
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	4.283.334	9.935.376
Ingresos a percibir y otros activos		2.873.181	2.937.712
Activos totales		252.689.402	270.558.737
Pasivo circulante			
Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		41.467	123
Gastos devengados		148.443	179.616
Otras cuentas por pagar		7.727	10.324
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		197.637	190.063
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		252.491.765	270.368.674

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global Diversified Income FMP - 2024 (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Periodo finalizado el 30 de junio de 2020*
		USD	USD
Ingresos			
Ingresos por intereses		5.846.044	112.126
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		(3.254.699)	(857.581)
		2.591.345	(745.455)
Gastos			
Comisión de gestión	5	704.065	18.617
Comisión de administración	5	90.290	3.723
Comisión de compromiso	16	21.009	–
Comisión de depósito	5	4.556	2.031
Comisión del Depositario	5	6.467	168
Honorarios profesionales	7	27.669	1.205
Honorarios de los Consejeros	6	2.203	117
Costes de transacciones	7	2.203	118
Gastos de constitución	7	–	44.494
Honorarios de auditoría	7	8.116	724
Reembolso de IVA		(1.242)	–
Otros gastos	7	3.587	362
Gastos totales		868.923	71.559
Costes financieros			
Repartos de dividendos abonados	1	5.640.905	–
		5.640.905	–
Impuestos retenidos en origen		622	10.001
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		(3.919.105)	(827.015)

* La Cartera comenzó a funcionar el 22 de junio de 2020, por lo que las cifras de resultados no son directamente comparables.

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global Diversified Income FMP - 2024 (cont.)

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

		Semestre finalizado el 30 de junio de 2021	Periodo finalizado el 30 de junio de 2020*
		USD	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo		270.368.674	–
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		(3.919.105)	(827.015)
Suscripciones	5	–	182.472.628
Reembolsos	5	(13.957.804)	–
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo		252.491.765	181.645.613

* La Cartera comenzó a funcionar el 22 de junio de 2020, por lo que las cifras de resultados no son directamente comparables.

Neuberger Berman Global Diversified Income FMP - 2024 (cont.)

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 de empresa 92,53% (31 de diciembre de 2020: 90,65%)					
Dólar estadounidense					
4.000.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd*	3,38%	24/07/2024	4.162.928	1,65
5.000.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust*	4,50%	15/09/2023	5.363.290	2,12
2.944.000	Africa Finance Corp*	3,88%	13/04/2024	3.120.450	1,24
944.000	African Export-Import Bank*	4,13%	20/06/2024	1.007.864	0,40
1.583.000	African Export-Import Bank*	5,25%	11/10/2023	1.714.811	0,68
3.000.000	Air Lease Corp*	4,25%	01/02/2024	3.254.964	1,29
2.100.000	Anglo American Capital Plc*	3,63%	11/09/2024	2.265.317	0,90
1.510.000	APX Group Inc**	8,50%	01/11/2024	1.580.781	0,63
910.000	Avolon Holdings Funding Ltd**	3,63%	01/05/2022	931.154	0,37
3.120.000	Avolon Holdings Funding Ltd**	5,25%	15/05/2024	3.433.715	1,36
500.000	Azure Orbit IV International Finance Ltd*	3,75%	25/01/2023	518.106	0,20
3.889.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT*	3,75%	11/04/2024	4.123.926	1,63
3.750.000	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT*	3,95%	28/03/2024	4.001.187	1,58
4.000.000	Barclays Plc*	4,38%	11/09/2024	4.368.267	1,73
3.800.000	Bharti Airtel International Netherlands BV*	5,35%	20/05/2024	4.188.688	1,66
2.500.000	Black Sea Trade & Development Bank*	3,50%	25/06/2024	2.639.804	1,05
3.000.000	BOC Aviation Ltd*	4,00%	25/01/2024	3.189.045	1,26
4.550.000	Boeing Co*	4,51%	01/05/2023	4.852.212	1,92
3.005.000	Buckeye Partners LP**	4,35%	15/10/2024	3.153.372	1,25
3.115.000	Carnival Corp**	11,50%	01/04/2023	3.509.593	1,39
1.595.000	Carpenter Technology Corp*	4,45%	01/03/2023	1.667.579	0,66
1.800.000	CBQ Finance Ltd*	5,00%	24/05/2023	1.939.608	0,77
2.460.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp*	5,38%	01/06/2024	2.497.134	0,99
240.000	CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd*	1,75%	10/08/2023	241.498	0,10
1.245.000	CIT Group Inc*	5,00%	01/08/2023	1.347.712	0,53
1.295.000	CommScope Inc**	5,50%	01/03/2024	1.336.116	0,53
3.430.000	DCP Midstream Operating LP*	3,88%	15/03/2023	3.566.222	1,41
889.000	Dianjian International Finance Ltd*	4,60%	29/12/2049	917.913	0,36
2.639.000	DIB Sukuk Ltd*	3,63%	06/02/2023	2.747.322	1,09
2.000.000	DP World Crescent Ltd*	3,91%	31/05/2023	2.104.625	0,83
1.333.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank*	4,88%	23/05/2024	1.403.569	0,56
4.300.000	Energy Transfer LP*	4,50%	15/04/2024	4.683.818	1,85
1.100.000	EnerSys**	5,00%	30/04/2023	1.152.179	0,46
1.510.000	EPR Properties*	5,25%	15/07/2023	1.595.838	0,63
3.685.000	EQM Midstream Partners LP*	4,00%	01/08/2024	3.790.944	1,50
3.000.000	ERAC USA Finance LLC**	2,70%	01/11/2023	3.134.561	1,24
1.280.000	Ford Motor Co*	8,50%	21/04/2023	1.430.016	0,57

Neuberger Berman Global Diversified Income FMP - 2024 (cont.)

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 92,53% (31 de diciembre de 2020: 90,65%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
1.000.000	Ford Motor Credit Co LLC*	3,37%	17/11/2023	1.037.932	0,41
2.895.000	Ford Motor Credit Co LLC*	5,58%	18/03/2024	3.174.223	1,26
4.550.000	General Motors Financial Co Inc*	3,95%	13/04/2024	4.897.734	1,94
3.750.000	Glencore Funding LLC**	4,63%	29/04/2024	4.112.898	1,63
944.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd*	5,13%	15/05/2024	1.030.654	0,41
1.944.000	Greenland Global Investment Ltd*	6,75%	26/09/2023	1.604.429	0,64
1.000.000	Haitong International Securities Group Ltd*	3,38%	19/07/2024	1.049.510	0,42
3.750.000	HSBC Holdings Plc*	4,25%	14/03/2024	4.063.704	1,61
2.800.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	3,25%	13/11/2024	2.072.812	0,82
700.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	3,75%	29/05/2024	518.193	0,20
2.500.000	Hyundai Capital America**	3,40%	20/06/2024	2.667.461	1,06
2.570.000	INEOS Group Holdings SA**	5,63%	01/08/2024	2.585.638	1,02
1.270.000	Kuwait Projects Co SPC Ltd*	5,00%	15/03/2023	1.314.905	0,52
2.980.000	Live Nation Entertainment Inc**	4,88%	01/11/2024	3.033.640	1,20
3.800.000	Mashreqbank PSC*	4,25%	26/02/2024	4.070.527	1,61
3.310.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co**	5,50%	15/04/2024	3.347.237	1,33
889.000	Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd*	3,38%	29/12/2049	911.225	0,36
889.000	MTN Mauritius Investments Ltd*	4,76%	11/11/2024	948.682	0,38
4.600.000	Natwest Group Plc*	5,13%	28/05/2024	5.110.758	2,02
2.375.000	Navient Corp**	6,50%	15/06/2022	2.479.381	0,98
3.445.000	NOVA Chemicals Corp**	4,88%	01/06/2024	3.638.781	1,44
4.000.000	NRG Energy Inc**	3,75%	15/06/2024	4.264.289	1,69
3.060.000	NuStar Logistics LP*	4,75%	01/02/2022	3.099.734	1,23
3.570.000	OneMain Finance Corp*	6,13%	15/03/2024	3.846.675	1,52
4.000.000	Pacific Gas & Electric Co*	3,75%	15/02/2024	4.196.847	1,66
1.715.000	Performance Food Group Inc**	5,50%	01/06/2024	1.722.212	0,68
1.400.000	Philippine National Bank*	3,28%	27/09/2024	1.469.747	0,58
4.300.000	Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp**	3,85%	15/10/2023	4.560.165	1,81
1.340.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	5,25%	15/04/2024	1.437.525	0,57
1.500.000	QIB Sukuk Ltd*	3,98%	26/03/2024	1.609.156	0,64
1.000.000	QIIB Senior Sukuk Ltd*	4,26%	05/03/2024	1.078.675	0,43
1.700.000	QNB Finansbank AS*	6,88%	07/09/2024	1.845.775	0,73
2.500.000	Rakfunding Cayman Ltd*	4,13%	09/04/2024	2.678.491	1,06
1.750.000	REC Ltd*	3,38%	25/07/2024	1.820.014	0,72
1.250.000	REC Ltd*	3,50%	12/12/2024	1.310.374	0,52
889.000	REC Ltd*	5,25%	13/11/2023	959.354	0,38
3.595.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	10,88%	01/06/2023	4.098.480	1,62
2.500.000	Samba Funding Ltd*	2,75%	02/10/2024	2.608.937	1,03

Neuberger Berman Global Diversified Income FMP - 2024 (cont.)

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 92,53% (31 de diciembre de 2020: 90,65%) (cont.)					
Dólar estadounidense (cont.)					
1.833.000	Sands China Ltd*	4,60%	08/08/2023	1.952.722	0,77
2.389.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 4*	4,22%	27/01/2024	2.586.016	1,02
750.000	Shimao Group Holdings Ltd*	6,13%	21/02/2024	772.855	0,31
600.000	Shriram Transport Finance Co Ltd*	4,40%	13/03/2024	602.850	0,24
1.950.000	Six Flags Entertainment Corp**	4,88%	31/07/2024	1.971.938	0,78
2.600.000	Societe Generale SA**	2,63%	16/10/2024	2.716.516	1,08
1.865.000	Starwood Property Trust Inc*	5,00%	15/12/2021	1.876.656	0,74
297.000	Sunac China Holdings Ltd*	5,95%	26/04/2024	292.732	0,12
3.939.000	Sunac China Holdings Ltd*	7,50%	01/02/2024	4.028.032	1,59
3.000.000	Sunny Optical Technology Group Co Ltd*	3,75%	23/01/2023	3.105.635	1,23
3.850.000	Synchrony Financial*	4,25%	15/08/2024	4.209.088	1,67
232.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	5,50%	15/09/2024	235.755	0,09
2.140.000	Taylor Morrison Communities Inc/Taylor Morrison Holdings II Inc**	5,63%	01/03/2024	2.325.902	0,92
1.265.000	Taylor Morrison Communities Inc/Taylor Morrison Holdings II Inc**	5,88%	15/04/2023	1.355.125	0,54
2.780.000	TRI Pointe Group Inc/TRI Pointe Homes Inc*	5,88%	15/06/2024	3.099.366	1,23
2.600.000	Ventas Realty LP*	3,50%	15/04/2024	2.784.518	1,10
2.139.000	VEON Holdings BV*	7,25%	26/04/2023	2.326.060	0,92
1.500.000	Weibo Corp*	3,50%	05/07/2024	1.583.535	0,63
1.300.000	Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp**	4,25%	30/05/2023	1.350.375	0,53
889.000	Wynn Macau Ltd*	4,88%	01/10/2024	900.628	0,36
400.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd**	8,50%	26/02/2024	364.055	0,14
Total bonos de empresa				233.653.261	92,53
Bonos del Estado 4,68% (31 de diciembre de 2020: 4,11%)					
Dólar estadounidense					
889.000	Egypt Government International Bond	4,55%	20/11/2023	921.485	0,37
1.889.000	Egypt Government International Bond	6,20%	01/03/2024	2.025.063	0,80
889.000	Oman Government International Bond	4,13%	17/01/2023	913.487	0,36
444.000	Republic of South Africa Government International Bond	4,67%	17/01/2024	478.410	0,19
3.300.000	Sri Lanka Government International Bond	6,35%	28/06/2024	2.277.000	0,90
2.250.000	Turkey Government International Bond	5,75%	22/03/2024	2.339.113	0,93
2.583.000	Ukraine Government International Bond	8,99%	01/02/2024	2.860.621	1,13
Total bonos del Estado *				11.815.179	4,68
Total inversiones				245.468.440	97,21

Neuberger Berman Global Diversified Income FMP - 2024 (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Contratos de divisas a plazo 0,03% (31 de diciembre de 2020: 0,18%)

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Plusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases EUR con cobertura						
29.582 USD	24.689 €	19/07/2021	UBS AG	1	293	0,00
1.919.186 USD	1.576.577 €	19/07/2021	Westpac Banking Corp	2	48.851	0,02
Clases GBP con cobertura						
2.753.725 £	3.790.075 USD	19/07/2021	UBS AG	1	14.247	0,01
Clases HKD con cobertura						
7.670.429 HKD	986.776 USD	19/07/2021	Citibank NA	1	973	0,00
Clases SGD con cobertura						
25.198 USD	33.761 SGD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	83	0,00
Plusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					64.447	0,03
					Valor razonable USD	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados					245.532.887	97,24

Pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Contratos de divisas a plazo (0,02%) (31 de diciembre de 2020: (0,00%))

Importe a percibir	Importe a pagar	Fecha de vencimiento	Contraparte	Contratos	Minusvalía latente USD	% del Patrimonio neto
Clases EUR con cobertura						
20.902 €	25.223 USD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(426)	(0,00)
4.117.756 €	4.915.324 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(30.319)	(0,01)
13.298 €	16.211 USD	19/07/2021	Westpac Banking Corp	1	(435)	(0,00)
Clases GBP con cobertura						
13.839 £	19.606 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(488)	(0,00)
25.183 USD	18.320 £	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(126)	(0,00)
Clases HKD con cobertura						
6.331 USD	49.272 HKD	19/07/2021	Goldman Sachs International	1	(14)	(0,00)
Clases SGD con cobertura						
5.628.107 SGD	4.196.444 USD	19/07/2021	UBS AG	1	(9.659)	(0,01)
Minusvalía latente total sobre contratos de divisas a plazo ∞					(41.467)	(0,02)

Neuberger Berman Global Diversified Income FMP - 2024 (cont.)

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	(41.467)	(0,02)
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados	245.491.420	97,22
Otro activo neto	7.000.345	2,78
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables	252.491.765	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	178.969.596	70,83
** Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario negociados en un mercado regulado	66.498.844	26,31
∞ Instrumentos financieros derivados OTC	22.980	0,01
Total inversiones	245.491.420	97,15

Neuberger Berman Global Diversified Income FMP - 2024 (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

Total compras:

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
2.600.000	Societe Generale SA, 2.63%, 16/10/2024	2.723.994
2.100.000	Anglo American Capital Plc, 3.63%, 11/09/2024	2.276.644
1.510.000	EPR Properties, 5.25%, 15/07/2023	1.551.525
1.340.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc, 5.25%, 15/04/2024	1.430.450
1.300.000	Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp, 4.25%, 30/05/2023	1.322.750
800.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 8.50%, 26/02/2024	858.190
750.000	Shimao Group Holdings Ltd, 6.13%, 21/02/2024	795.750
640.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc, 6.38%, 01/04/2024	652.800
600.000	Shriram Transport Finance Co Ltd, 4.40%, 13/03/2024	596.100
500.000	Ukraine Government International Bond, 8.99%, 01/02/2024	568.400
400.000	QNB Finansbank AS, 6.88%, 07/09/2024	444.000
297.000	Sunac China Holdings Ltd, 5.95%, 26/04/2024	296.905

Total ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto USD
2.583.000	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 3.38%, 19/06/2024	2.589.458
1.400.000	Bluestar Finance Holdings Ltd, 3.38%, 16/07/2024	1.404.144
630.000	INEOS Group Holdings SA, 5.63%, 01/08/2024	634.303
350.000	Synchrony Financial, 4.25%, 15/08/2024	381.847
400.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 8.50%, 26/02/2024	332.000
500.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd, 3.25%, 13/11/2024	265.000

Neuberger Berman China A-Share Equity Fund

Informe del Gestor de inversiones

La rentabilidad total de la Clase de acumulación I CNY en el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 ascendió al 4,80%. En el mismo periodo, el MSCI China A Onshore Net Index (Total Return, CNY) (el "Índice") registró una rentabilidad del 3,55%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

El mercado de acciones A chinas arrancó el 2021 con fuerza, movido por el optimismo acerca de la recuperación de China y la economía global. Sin embargo, desde finales de febrero aproximadamente, la preocupación por el aumento de los rendimientos de los bonos provocó una corrección en los distintos activos de riesgo, incluido este mercado. La volatilidad continuó hasta el final del periodo debido a las dificultades que sufrió el mercado de renta variable chino por el temor de los inversores al endurecimiento de las políticas monetarias y los cambios legislativos y políticos en China.

Energía y materiales —dos sectores que resurgieron por la recuperación de la demanda y, en el caso de la energía, también por la limitada oferta de petróleo— y el sector de atención sanitaria arrastraron el índice al alza. Por el contrario, el cambio en el ánimo de los inversores en relación con los mencionados cambios políticos en China sumió en negativo a los sectores inmobiliario, servicios de comunicaciones y consumo discrecional, dado su gran peso en China.

A pesar de las fluctuaciones del mercado general, seguimos accediendo al crecimiento nacional a través de empresas de calidad repartidas por toda la escala de capitalizaciones bursátiles. Las empresas que preferimos son las que denominamos "Quality Compounders" (empresas de calidad con una alta rentabilidad financiera (ROE), un flujo de caja constante y un sólido gobierno corporativo con una rentabilidad a largo plazo constante) y "Beneficiarias del crecimiento secular" (empresas posicionadas de cara al crecimiento secular nacional a largo plazo, respaldado por las políticas estatales y las tendencias sectoriales generales). Estas empresas a menudo ofrecen un crecimiento del beneficio por acción (BPA) superior al mercado, aunque se encuentran en el universo de los valores de pequeña y mediana capitalización poco analizados.

Este enfoque resultó favorable en un entorno difícil, siendo la selección de valores clave para la rentabilidad superior de la Cartera en el primer semestre. Nuestra ventaja más importante provino de las posiciones en los sectores de tecnología de la información, materiales y consumo básico. La selección de valores en industrias, consumo discrecional y atención sanitaria lastró los resultados relativos.

Después de la recuperación económica avanzada de China tras la pandemia por COVID-19, el crecimiento empezó a ralentizarse gradualmente en la primera mitad de este año, debido sobre todo a factores como el endurecimiento monetario, la política fiscal y las presiones a las que se vieron sometidos los productores midstream por el encarecimiento de las materias primas.

Estos factores se han visto plenamente reflejados en el mercado de capitales. Las cotizaciones de las acciones de sectores y empresas con unos fundamentales relativamente débiles han sufrido una importante corrección, por ejemplo, en los sectores de consumo, maquinaria de construcción, financiero e inmobiliario. Al mismo tiempo, las cotizaciones de las acciones de sectores como energía y materias primas han seguido aumentando.

En nuestra opinión, con la desaceleración del crecimiento económico en la segunda mitad del año, China se mostrará más activa en su política monetaria y fiscal, lo que proporcionará un apoyo adicional a la economía.

A medida que la economía vuelva gradualmente a la normalidad, la enorme divergencia sectorial que observamos en la primera mitad del año también se moderará. Se estima que las valoraciones de las empresas líderes en los sectores de consumo y fabricación se recuperarán, y también que los sectores sobrevalorados sufrirán una cierta corrección.

Nosotros seguiremos fieles a nuestra disciplina basada en la calidad, encontrando oportunidades de inversión de forma selectiva para la cartera. Creemos que mantener una cartera equilibrada de posiciones centrales de alta calidad resulta adecuado para beneficiarse del crecimiento económico chino, ya que, a largo plazo, ofrecerá unas rentabilidades ajustadas al riesgo excelentes.

Neuberger Berman China A-Share Equity Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 CNY	A 31 de diciembre de 2020 CNY
Activo circulante			
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		25.046.907	15.247.340
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	1.736.775	726.030
Ingresos a percibir y otros activos		73.341	550.418
Activos totales		26.857.023	16.523.788
Pasivo circulante			
Gastos devengados		254.302	367.490
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		149.519	–
Otras cuentas por pagar		244.705	209.189
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		648.526	576.679
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		26.208.497	15.947.109

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman China A-Share Equity Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021* CNY
Ingresos		
Ingresos por dividendos		97.509
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		826.399
		923.908
Gastos		
Comisión de gestión	5	79.866
Comisión de administración	5	59.120
Comisión de compromiso	16	572
Comisión de depósito	5	27.609
Comisión del Depositario	5	444
Honorarios profesionales	7	147.763
Honorarios de los Consejeros	6	14.562
Costes de transacciones	7	57.785
Honorarios de auditoría	7	38.222
Reembolso de IVA		(79)
Otros gastos	7	13.814
Gastos no asumidos	5	(353.854)
Gastos totales		85.824
Costes financieros		
Gastos por intereses		100
		100
Impuestos retenidos en origen		9.688
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		828.296

* La cartera comenzó a funcionar el 28 de julio de 2020.

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman China A-Share Equity Fund (cont.)

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

	Semestre finalizado el 30 de junio de 2021*
	CNY
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	15.947.109
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	828.296
Suscripciones	14.415.929
Reembolsos	(4.982.837)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	26.208.497

* La cartera comenzó a funcionar el 28 de julio de 2020.

Neuberger Berman China A-Share Equity Fund (cont.)

Cartera de inversiones

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Número de acciones	Descripción de los valores	Valor razonable CNY	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 95,57% (31 de diciembre de 2020: 95,61%)			
Yuan renminbi chino			
14.500	Anhui Conch Cement Co Ltd Class A	595.225	2,27
34.200	Bank of Ningbo Co Ltd Class A	1.332.774	5,08
7.750	Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co Ltd Class A	428.730	1,64
7.200	Chacha Food Co Ltd Class A	310.320	1,18
20.300	China Merchants Bank Co Ltd Class A	1.100.057	4,20
13.400	China Vanke Co Ltd Class A	319.054	1,22
15.100	Fujian Green Pine Co Ltd Class A	318.610	1,21
6.900	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd Class A	385.365	1,47
9.533	Guangdong Haid Group Co Ltd Class A	777.893	2,97
4.900	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd Class A	782.873	2,99
4.400	Hundsun Technologies Inc Class A	410.300	1,56
7.520	Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd Class A	511.134	1,95
8.075	Joyoung Co Ltd Class A	262.357	1,00
700	Kweichow Moutai Co Ltd Class A	1.439.690	5,49
11.440	LONGi Green Energy Technology Co Ltd Class A	1.016.330	3,88
29.000	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A	1.334.000	5,09
7.100	Midea Group Co Ltd Class A	506.727	1,93
3.885	Montage Technology Co Ltd Class A	242.346	0,92
18.020	NARI Technology Co Ltd Class A	418.785	1,60
19.900	Ping An Insurance Group Co of China Ltd Class A	1.279.172	4,88
40.200	Poly Developments & Holdings Group Co Ltd Class A	484.008	1,85
1.900	Proya Cosmetics Co Ltd Class A	373.749	1,43
14.300	Riyue Heavy Industry Co Ltd Class A	387.244	1,48
27.000	Sany Heavy Industry Co Ltd Class A	784.890	2,99
2.500	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd Class A	1.200.125	4,58
2.508	Tsingtao Brewery Co Ltd Class A	290.050	1,11
24.300	Weichai Power Co Ltd Class A	434.241	1,66
3.034	Will Semiconductor Co Ltd Shanghai Class A	976.948	3,73
2.975	Wuliangye Yibin Co Ltd Class A	886.223	3,38
19.100	WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd Class A	295.477	1,13
1.700	WuXi AppTec Co Ltd Class A	266.203	1,01
9.350	Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd Class A	524.441	2,00
4.900	Yunnan Energy New Material Co Ltd Class A	1.147.090	4,38
18.000	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A	909.000	3,47
22.400	Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd Class A	463.008	1,77
Total yuan renminbi chino		23.194.439	88,50

Neuberger Berman China A-Share Equity Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Número de Acciones	Descripción de los valores	Valor razonable CNY	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 95,57% (31 de diciembre de 2020: 95,61%) (cont.)			
Dólar de Hong Kong			
800	Kuaishou Technology Class B	129.652	0,50
3.000	Meituan Class B	799.677	3,05
1.900	Tencent Holdings Ltd Class A	923.139	3,52
Total dólar de Hong Kong		1.852.468	7,07
Total valores de renta variable *		25.046.907	95,57
Total inversiones		25.046.907	95,57
		Valor razonable CNY	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		25.046.907	95,57
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados		25.046.907	95,57
Otro activo neto		1.161.590	4,43
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		26.208.497	100,00
Análisis de la cartera		CNY	% de los Activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial		25.046.907	93,26
Total inversiones		25.046.907	93,26

Neuberger Berman China A-Share Equity Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste CNY
24.000	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A	1.110.092
26.800	Bank of Ningbo Co Ltd Class A	1.039.117
14.200	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd Class A	992.732
1.700	Tencent Holdings Ltd Class A	839.710
400	Kweichow Moutai Co Ltd Class A	831.202
3.000	Meituan Class B	794.473
1.600	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd Class A	749.732
11.900	China Merchants Bank Co Ltd Class A	650.717
7.600	LONGi Green Energy Technology Co Ltd Class A	649.791
31.000	Fujian Green Pine Co Ltd Class A	610.848
7.900	Guangdong Haid Group Co Ltd Class A	563.186
14.975	Joyoung Co Ltd Class A	494.236
1.700	Will Semiconductor Co Ltd Shanghai Class A	491.080
10.100	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A	477.917
1.600	Wuliangye Yibin Co Ltd Class A	472.336
15.600	Sany Heavy Industry Co Ltd Class A	466.001
2.500	Yunnan Energy New Material Co Ltd Class A	456.803
8.000	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd Class A	433.179
15.800	Riyue Heavy Industry Co Ltd Class A	425.374
4.208	Tsingtao Brewery Co Ltd Class A	394.962
7.900	Chacha Food Co Ltd Class A	390.402
2.700	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd Class A	388.735
8.300	Anhui Conch Cement Co Ltd Class A	357.303
3.800	Hundsun Technologies Inc Class A	344.367
4.500	Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd Class A	339.160
5.800	Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd Class A	330.576
4.659	Montage Technology Co Ltd Class A	302.344
3.800	Midea Group Co Ltd Class A	278.950
21.800	Poly Developments & Holdings Group Co Ltd Class A	273.432
1.700	WuXi AppTec Co Ltd Class A	269.768
12.400	Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd Class A	265.881
13.700	Weichai Power Co Ltd Class A	243.305
9.100	NARI Technology Co Ltd Class A	219.144
1.100	Proya Cosmetics Co Ltd Class A	200.977
12.900	Deppon Logistics Co Ltd Class A	194.794

Neuberger Berman China A-Share Equity Fund (cont.)

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
10.600	China Merchants Bank Co Ltd Class A	508.993
3.900	LONGi Green Energy Technology Co Ltd Class A	401.687
4.700	Guangdong Haid Group Co Ltd Class A	371.195
7.400	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A	369.700
3.600	Tsingtao Brewery Co Ltd Class A	361.862
15.900	Fujian Green Pine Co Ltd Class A	353.040
20.200	Guotai Junan Securities Co Ltd Class A	349.921
6.000	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai Class A	311.205
7.300	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A	296.696
600	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd Class A	283.163
19.200	Poly Developments & Holdings Group Co Ltd Class A	282.008
4.100	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd Class A	271.975
10.800	Huayu Automotive Systems Co Ltd Class A	266.369
6.300	Bank of Ningbo Co Ltd Class A	256.008
12.700	China Yangtze Power Co Ltd Class A	245.110
8.700	China Vanke Co Ltd Class A	240.948
1.200	Proya Cosmetics Co Ltd Class A	235.449
5.800	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A	233.982
11.900	Weichai Power Co Ltd Class A	232.499
1.500	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd Class A	228.464
6.900	Joyoung Co Ltd Class A	225.879
100	Kweichow Moutai Co Ltd Class A	207.497
4.500	Chacha Food Co Ltd Class A	203.825
400	Tencent Holdings Ltd Class A	194.319
6.200	NARI Technology Co Ltd Class A	190.320
3.300	Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co Ltd Class A	188.836
8.200	Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd Class A	180.688
6.000	Sany Heavy Industry Co Ltd Class A	172.672
12.900	Deppon Logistics Co Ltd Class A	157.586
500	Wuliangye Yibin Co Ltd Class A	145.924
600	Meituan Class B	144.985
500	Will Semiconductor Co Ltd Shanghai Class A	140.152
3.000	Anhui Conch Cement Co Ltd Class A	130.634
1.600	Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd Class A	116.404

Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund

Informe del Gestor de inversiones

Desde su creación el 24 de febrero de 2021 hasta el cierre del periodo analizado el 30 de junio de 2021, la rentabilidad total de la Clase de acumulación I EUR fue del 14,60%. En el mismo período, el índice de referencia, el MSCI Europe Index (Total Return, Net of Tax, EUR) registró una rentabilidad del 11,16%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Con la reapertura económica global, los mercados de renta variable mostraron una dinámica muy positiva, ya que se espera que los beneficios corporativos se normalicen debido a la recuperación de la demanda prevista en determinados sectores verticales, así como al colchón que ofrecen los estímulos monetario y fiscal. El acceso de la cadena de valor al sector de atención sanitaria puso de manifiesto el buen comportamiento en Europa.

La Cartera batió a su índice de referencia en el periodo analizado, gracias entre otros factores a la fuerte recuperación de la demanda de servicios veterinarios y salud dental, además de la moda de lujo. La demanda de servicios de laboratorio relacionados con la COVID-19 también se mantuvo sólida y contribuyó a la rentabilidad, junto con una fuerte demanda de servicios de inversión privados. La digitalización de la economía es otra tendencia que sigue favoreciendo a la cartera, mediante un operador de plataformas de 5G y un proveedor líder de equipos de semiconductores.

Observamos un continuo impulso normativo que favorece un desarrollo más sostenible de la economía global. Hemos incrementado nuestras posiciones en valores de electrificación del transporte, donde vemos un amplio margen de penetración adicional a largo plazo. Además, añadimos S4 Capital PLC, que constituye una interesante oportunidad de marketing digital.

En la economía actual, creemos que el éxito de la mayoría de las empresas de calidad depende ahora cada vez más del desarrollo del capital intangible: tecnología innovadora, investigación y desarrollo (I+D), capital humano y reputación de marca o plataforma para generar una posición competitiva duradera. Esta posición competitiva puede reforzarse mediante una buena "ciudadanía corporativa", gracias a una cuidadosa gestión de las prácticas medioambientales, sociales y de gobierno corporativo. Nuestra perspectiva de la cadena de valor nos permite identificar pronto la transición y las oportunidades ESG, ya que la vida de las empresas y los ciclos de los productos son cada vez más breves y rápidos, lo que obliga a las empresas a adaptarse continuamente, enfocándose en la innovación y las mejoras. Creemos que el análisis prospectivo de esta combinación de atributos de calidad, factores ESG y características idiosincráticas es determinante para identificar a los ganadores de la transición de la nueva economía. En nuestra opinión, indica que las perspectivas fundamentales "bottom-up" probablemente seguirán siendo el principal impulsor de las rentabilidades superiores.

Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 EUR
Activo circulante		
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		7.153.191
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	193.274
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		35.933
Ingresos a percibir y otros activos		15.577
Activos totales		7.397.975
Pasivo circulante		
Descubierto bancario	3	78
Gastos devengados		41.823
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		185.624
Otras cuentas por pagar		13.843
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		241.368
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		7.156.607

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Periodo finalizado el 30 de junio de 2021* EUR
Ingresos		
Ingresos por dividendos		58.444
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		886.336
		944.780
Gastos		
Comisión de gestión	5	12.618
Comisión de distribución	5	69
Comisión de administración	5	7.454
Comisión de depósito	5	1.899
Comisión del Depositario	5	53
Honorarios profesionales	7	16.824
Honorarios de los Consejeros	6	1.671
Costes de transacciones	7	15.716
Gastos de constitución	7	35.000
Honorarios de auditoría	7	5.155
Reembolso de IVA		(9)
Otros gastos	7	1.337
Gastos no asumidos	5	(40.549)
Gastos totales		57.238
Costes financieros		
Gastos por intereses		614
		614
Impuestos retenidos en origen		14.181
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		872.747

* La cartera comenzó a funcionar el 24 de febrero de 2021.

Los ingresos y gastos se derivaron exclusivamente de actividades que han continuado.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund (cont.)

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

	Periodo finalizado el 30 de junio de 2021*
	EUR
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	–
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	872.747
Suscripciones	6.283.860
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	7.156.607

* La cartera comenzó a funcionar el 24 de febrero de 2021.

Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund (cont.)

Cartera de inversiones

Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados

Número de Acciones	Descripción de los valores	Valor razonable EUR	% del Patrimonio neto
Valores de renta variable 99,95%			
Corona danesa			
4.099	Novo Nordisk A/S Class B	289.610	4,05
Total corona danesa		289.610	4,05
Euro			
113	Adyen NV	232.837	3,25
1.954	Alfen Beheer BV	153.878	2,15
2.391	Amundi SA	177.771	2,49
566	ASML Holding NV	327.940	4,58
1.482	Beiersdorf AG	150.793	2,11
3.815	Cellnex Telecom SA	204.942	2,86
3.024	Euronext NV	277.301	3,88
2.907	HelloFresh SE	238.316	3,33
365	Kering SA	269.005	3,76
603	L'Oreal SA	226.607	3,17
7.025	RELX Plc	157.922	2,21
652	Reply SpA	90.367	1,26
399	Sartorius Stedim Biotech	159.161	2,22
1.293	Schneider Electric SE	171.555	2,40
3.071	Scout24 AG	218.410	3,05
4.831	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	136.041	1,90
3.345	TeamViewer AG	106.103	1,48
2.263	Zalando SE	230.713	3,22
Total euro		3.529.662	49,32
Corona noruega			
3.594	Bakkafrost P/F	250.402	3,50
Total corona noruega		250.402	3,50
Libra esterlina			
15.605	3i Group Plc	213.230	2,98
3.635	Bunzl Plc	101.160	1,41
8.632	CVS Group Plc	242.838	3,39
4.380	Dechra Pharmaceuticals Plc	222.968	3,12
14.244	HomeServe Plc	158.544	2,22
2.185	London Stock Exchange Group Plc	202.860	2,83
25.313	S4 Capital Plc	185.178	2,59
Total libra esterlina		1.326.778	18,54

Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

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

Número de Acciones	Descripción de los valores	Valor razonable EUR	% del Patrimonio neto
Renta variable 99,95% (cont.)			
Corona sueca			
7.246	Assa Abloy AB Class B	184.187	2,57
3.201	Atlas Copco AB Class A	165.384	2,31
Total corona sueca		349.571	4,88
Franco suizo			
4.888	Nestle SA	513.777	7,18
240	Partners Group Holding AG	306.846	4,29
201	Straumann Holding AG	270.460	3,78
300	Tecan Group AG	125.453	1,75
Total franco suizo		1.216.536	17,00
Dólar estadounidense			
818	SolarEdge Technologies Inc	190.632	2,66
Total dólar estadounidense		190.632	2,66
Total valores de renta variable *		7.153.191	99,95
Total inversiones		7.153.191	99,95
		Valor razonable EUR	% del Patrimonio neto
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		7.153.191	99,95
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados		7.153.191	99,95
Otro activo neto		3.416	0,05
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		7.156.607	100,00
Análisis de la cartera		EUR	% de los Activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial		7.153.191	96,69
Total inversiones		7.153.191	96,69

Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste EUR
4.888	Nestle SA	435.736
3.024	Euronext NV	268.728
566	ASML Holding NV	265.846
4.099	Novo Nordisk A/S Class B	242.862
240	Partners Group Holding AG	242.339
3.733	Bakkafrost P/F	233.639
117	Adyen NV	230.420
2.185	London Stock Exchange Group Plc	218.621
207	Straumann Holding AG	211.028
15.605	3i Group Plc	209.676
3.210	HelloFresh SE	208.847
365	Kering SA	200.601
2.263	Zalando SE	199.814
3.071	Scout24 AG	197.760
4.481	Cellnex Telecom SA	197.283
603	L'Oreal SA	190.272
25.313	S4 Capital Plc	184.589
818	SolarEdge Technologies Inc	182.853
8.871	CVS Group Plc	180.187
4.380	Dechra Pharmaceuticals Plc	179.251
14.244	HomeServe Plc	179.162
1.943	Beiersdorf AG	166.987
1.293	Schneider Electric SE	161.849
7.246	Assa Abloy AB Class B	160.027
3.201	Atlas Copco AB Class A	156.781
2.391	Amundi SA	155.267
399	Sartorius Stedim Biotech	148.192
7.025	RELX Plc	143.693
4.831	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	143.660
1.954	Alfen Beheer BV	132.014
3.345	TeamViewer AG	131.646
300	Tecan Group AG	107.036
3.635	Bunzl Plc	95.686
12.374	RWS Holdings PLC	91.646
828	Reply SpA	82.408

Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas (cont.)

Total ventas:

Unidades	Descripción de los valores	Producto EUR
12.374	RWS Holdings PLC	82.244
461	Beiersdorf AG	39.296
666	Cellnex Telecom SA	35.954
176	Reply SpA	19.888
303	HelloFresh SE	19.218
4.481	Cellnex Telecom SA, 27/04/2021 – Participatory Notes	14.716
139	Bakkafrost P/F	8.642
4	Adyen NV	7.986
6	Straumann Holding AG	7.521
239	CVS Group Plc	6.291
3.071	Scout24 AG, 31/12/2049 – Participatory Notes	344

Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund

Informe del Gestor de inversiones

Desde su creación el 24 de febrero de 2021 hasta el cierre del periodo analizado el 30 de junio de 2021, la rentabilidad total de la Clase de acumulación I USD fue del 12,40%. En el mismo período, el índice de referencia, el MSCI World Index (Total Return, Net of Tax, USD) (el "Índice"), registró una rentabilidad del 8,36%. (Los datos de rentabilidad citados representan rendimientos pasados y no son indicativos de los resultados futuros. La rentabilidad total que se indica refleja la reinversión de los ingresos por dividendos y otras distribuciones, en su caso).

Con la reapertura económica global durante el periodo, los mercados de renta variable mostraron una dinámica muy positiva, ya que se espera que los beneficios corporativos se normalicen debido a la recuperación de la demanda prevista en determinados sectores e industrias, así como al colchón que ofrecen los continuos estímulos monetario y fiscal. El objetivo medioambiental y social de las fintech y la inclusión financiera, que es la disponibilidad y la igualdad de oportunidades para acceder a los servicios financieros, mostró unos resultados especialmente buenos.

La Cartera batió a su índice de referencia en el periodo analizado, gracias entre otras cosas a un entorno de emisión de deuda favorable que benefició a las agencias de calificación, así como a la fuerte demanda de servicios de laboratorio relacionados con la COVID-19 y una inflación benigna de los servicios sanitarios a medida que la pandemia parecía tocar techo. La digitalización de la economía es otra tendencia que favoreció a la cartera.

Prevedemos un continuo impulso normativo favorable a un desarrollo más sostenible de la economía global. Hemos incrementado nuestras posiciones en valores de electrificación del transporte, donde vemos un amplio margen de penetración adicional a largo plazo. Además, añadimos una empresa que consideramos que constituye una interesante oportunidad de marketing digital.

En la economía actual, creemos que el éxito de la mayoría de las empresas de calidad depende cada vez más del desarrollo del capital intangible: tecnología innovadora, investigación y desarrollo (I+D), capital humano y reputación de marca o plataforma para generar una posición competitiva duradera. Esta posición competitiva puede reforzarse mediante una buena "ciudadanía corporativa" gracias a una cuidadosa gestión de las prácticas medioambientales, sociales y de gobierno corporativo ("ESG"). Nuestra perspectiva de la cadena de valor nos permite identificar pronto la transición y las oportunidades ESG, ya que la vida de las empresas y los ciclos de los productos son cada vez más breves y rápidos, lo que obliga a las empresas a adaptarse continuamente, enfocándose en la innovación y las mejoras. Creemos que el análisis prospectivo de esta combinación de atributos de calidad, factores ESG y características idiosincráticas es determinante para identificar a los "ganadores de la transición" de la nueva economía. En nuestra opinión, indica que las perspectivas fundamentales "bottom-up" probablemente seguirán siendo el principal impulsor de las rentabilidades superiores.

Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund (cont.)

Balance

	Nota	A 30 de junio de 2021 USD
Activo circulante		
Activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		21.992.238
Efectivo y equivalentes de efectivo	2	241.198
Cuentas a percibir por inversiones vendidas		201.222
Cuentas a percibir por acciones emitidas		127.837
Ingresos a percibir y otros activos		18.349
Activos totales		22.580.844
Pasivo circulante		
Descubierto bancario	3	7
Gastos devengados		52.848
Cuentas a pagar por inversiones adquiridas		452.689
Otras cuentas por pagar		15.593
Pasivo (sin incluir el Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables)		521.137
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		22.059.707

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund (cont.)

Cuenta de pérdidas y ganancias

	Nota	Periodo finalizado el 30 de junio de 2021* USD
Ingresos		
Ingresos por intereses		5
Ingresos por dividendos		63.858
Plusvalía/(minusvalía) neta sobre activos y pasivos financieros al valor razonable con cambios en resultados		1.879.570
		1.943.433
Gastos		
Comisión de gestión	5	21.516
Comisión de distribución	5	84
Comisión de administración	5	10.157
Comisión de depósito	5	2.311
Comisión del Depositario	5	139
Honorarios profesionales	7	20.234
Honorarios de los Consejeros	6	2.032
Costes de transacciones	7	25.202
Gastos de constitución	7	42.521
Honorarios de auditoría	7	6.135
Otros gastos	7	1.734
Gastos no asumidos	5	(42.342)
Gastos totales		89.723
Costes financieros		
Gastos por intereses		7
		7
Impuestos retenidos en origen		16.911
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones		1.836.792

* La cartera comenzó a funcionar el 24 de febrero de 2021.

Todos los beneficios y pérdidas proceden únicamente de operaciones continuas.

Las notas adjuntas forman parte de las cuentas.

Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund (cont.)

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

	Periodo finalizado el 30 de junio de 2021*
	USD
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al comienzo del periodo	–
Beneficios/(pérdidas) atribuibles a los titulares de Acciones de participación reembolsables como consecuencia de las operaciones	1.836.792
Suscripciones	24.547.180
Reembolsos	(4.324.265)
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables al final del periodo	22.059.707

* La cartera comenzó a funcionar el 24 de febrero de 2021.

Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund (cont.)

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 99,69%			
Dólar australiano			
83.310	BWX Ltd	340.245	1,54
Total dólar australiano		340.245	1,54
Corona danesa			
3.621	Novo Nordisk A/S Class B	303.398	1,38
Total corona danesa		303.398	1,38
Euro			
178	Adyen NV	434.951	1,97
2.488	Alfen Beheer BV	232.353	1,05
630	ASML Holding NV	432.880	1,96
5.097	HelloFresh SE	495.531	2,25
7.779	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	259.779	1,18
Total euro		1.855.494	8,41
Yen japonés			
4.500	Recruit Holdings Co Ltd	221.777	1,00
Total yen japonés		221.777	1,00
Corona noruega			
7.716	Bakkafrost P/F	637.530	2,89
Total corona noruega		637.530	2,89
Libra esterlina			
30.378	3i Group Plc	492.258	2,23
24.884	HomeServe Plc	328.463	1,49
52.055	S4 Capital Plc	451.603	2,05
Total libra esterlina		1.272.324	5,77
Corona sueca			
6.108	Atlas Copco AB Class A	374.244	1,70
Total corona sueca		374.244	1,70
Franco suizo			
5.827	Nestle SA	726.334	3,29
351	Partners Group Holding AG	532.186	2,41
Total franco suizo		1.258.520	5,70

Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund (cont.)

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
Renta variable 99,69% (cont.)			
Dólar estadounidense			
1.584	Abbott Laboratories	183.633	0,83
1.238	Adobe Inc	725.022	3,29
440	Alphabet Inc Class A	1.074.388	4,87
364	Amazon.com Inc	1.252.218	5,68
1.232	Anthem Inc	470.378	2,13
2.392	Applied Materials Inc	340.621	1,54
13.366	Brown & Brown Inc	710.269	3,22
1.852	Danaher Corp	497.003	2,25
1.195	Estee Lauder Cos Inc Class A	380.106	1,72
1.412	Intuit Inc	692.120	3,14
1.770	Mastercard Inc Class A	646.209	2,93
3.091	Match Group Inc	498.424	2,26
4.186	McCormick & Co Inc	369.707	1,68
4.914	Microsoft Corp	1.331.203	6,03
1.677	Moody's Corp	607.694	2,75
2.642	Nasdaq Inc	464.464	2,11
1.279	Netflix Inc	675.581	3,06
1.178	Nordson Corp	258.583	1,17
2.057	S&P Global Inc	844.296	3,83
1.534	SolarEdge Technologies Inc	423.951	1,92
1.319	Thermo Fisher Scientific Inc	665.396	3,02
1.325	Ulta Beauty Inc	458.145	2,08
1.769	UnitedHealth Group Inc	708.378	3,21
1.155	Veeva Systems Inc Class A	359.147	1,63
3.029	Visa Inc Class A	708.241	3,21
2.058	Zoetis Inc Class A	383.529	1,74
Total dólar estadounidense		15.728.706	71,30
Total valores de renta variable *		21.992.238	99,69
Total inversiones		21.992.238	99,69
Total activos financieros al valor razonable con cambios en resultados		21.992.238	99,69
Activos financieros netos al valor razonable con cambios en resultados		21.992.238	99,69
Otro activo neto		67.469	0,31
Patrimonio neto atribuible a los titulares de Acciones de participación reembolsables		22.059.707	100,00

Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund (cont.)

Cartera de inversiones (cont.)

Análisis de la cartera	USD	% de los Activos totales
* Valores mobiliarios y/o instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa oficial	21.992.238	97,39
Total inversiones	21.992.238	97,39

Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund (cont.)

Informe de compras y ventas significativas

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.

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

Unidades	Descripción de los valores	Coste USD
5.989	Microsoft Corp	1.455.711
444	Amazon.com Inc	1.448.229
538	Alphabet Inc Class A	1.166.745
2.523	S&P Global Inc	882.255
3.766	Visa Inc Class A	828.384
2.246	Mastercard Inc Class A	824.818
7.116	Nestle SA	801.614
16.284	Brown & Brown Inc	785.226
1.474	Netflix Inc	784.914
10.069	Bakkafrost P/F	772.128
2.161	UnitedHealth Group Inc	766.156
1.513	Adobe Inc	740.763
1.562	Thermo Fisher Scientific Inc	727.419
1.725	Intuit Inc	713.588
7.563	HelloFresh SE	619.047
37.115	3i Group Plc	611.669
2.049	Moody's Corp	609.304
3.776	Match Group Inc	583.331
429	Partners Group Holding AG	564.031
1.619	Ulta Beauty Inc	531.813
2.262	Danaher Corp	523.997
217	Adyen NV	520.234
1.505	Anthem Inc	501.917
1.799	SolarEdge Technologies Inc	495.826
1.655	Estee Lauder Cos Inc Class A	492.854
3.227	Nasdaq Inc	484.323
766	ASML Holding NV	468.719
30.402	HomeServe Plc	459.666
7.461	Atlas Copco AB Class A	458.500
52.055	S4 Capital Plc	450.165
4.843	McCormick & Co Inc	422.517
2.575	Zoetis Inc Class A	420.240
1.411	Veeva Systems Inc Class A	398.142
2.922	Applied Materials Inc	368.898
101.226	BWX Ltd	358.500
9.373	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	337.947
4.422	Novo Nordisk A/S Class B	322.195
1.439	Nordson Corp	288.752
5.500	Recruit Holdings Co Ltd	272.969

Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund (cont.)

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
1.075	Microsoft Corp	272.244
80	Amazon.com Inc	263.944
9.271	RELX Plc	245.004
2.466	HelloFresh SE	224.606
98	Alphabet Inc Class A	220.542
2.353	Bakkafrost P/F	190.695
476	Mastercard Inc Class A	179.574
466	S&P Global Inc	170.374
737	Visa Inc Class A	162.790
1.289	Nestle SA	150.788
392	UnitedHealth Group Inc	143.037
2.918	Brown & Brown Inc	138.138
275	Adobe Inc	137.456
460	Estee Lauder Cos Inc Class A	134.369
313	Intuit Inc	128.743
372	Moody's Corp	116.473
6.737	3i Group Plc	115.901
243	Thermo Fisher Scientific Inc	114.577
78	Partners Group Holding AG	108.725
195	Netflix Inc	108.143
685	Match Group Inc	99.702
273	Anthem Inc	96.339
410	Danaher Corp	94.275
294	Ulta Beauty Inc	94.089
39	Adyen NV	92.522
5.518	HomeServe Plc	90.157
585	Nasdaq Inc	89.809
1.353	Atlas Copco AB Class A	86.868
136	ASML Holding NV	86.081
517	Zoetis Inc Class A	82.720
530	Applied Materials Inc	73.856
265	SolarEdge Technologies Inc	69.454
256	Veeva Systems Inc Class A	67.425
17.916	BWX Ltd	65.342
1.594	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	59.530
657	McCormick & Co Inc	58.893
801	Novo Nordisk A/S Class B	55.484
261	Nordson Corp	52.469
1.000	Recruit Holdings Co Ltd	48.271

NOTAS DE LAS CUENTAS ABREVIADAS NO AUDITADAS

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

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 2021. 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 2020, 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, 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») y las normas de cotización de Euronext Dublin. 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 suponiendo la continuidad de la Sociedad y con arreglo al principio del coste histórico, modificado por la revaloración 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.

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 abiertos 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 periodo 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 periodo 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 periodo 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.

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021**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, que 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, que se declararán 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 del Neuberger Berman China Equity Fund y el Neuberger Berman China A-Share Equity Fund se declararán como máximo el último día hábil de cada mes y se abonarán en el plazo de tres días hábiles después de dicha fecha;
- e) cada una de las restantes Clases de reparto del Neuberger Berman China Bond Fund, el Neuberger Berman Global Thematic Equity Fund, el Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund, el Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund y el Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund se declararán trimestralmente y se abonarán en el plazo de treinta días hábiles en relación con los Ingresos netos de esas Clases de reparto correspondientes al trimestre anterior;
- f) cada una de las restantes Clases de reparto de Neuberger Berman High Yield Bond Fund, Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund, Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund, Neuberger Berman Global Bond Fund, Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund, Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund, Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund, Neuberger Berman Strategic Income Fund, Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund, Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund, Neuberger Berman European High Yield Bond Fund, Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund, Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund, Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund, Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund, Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund, Neuberger Berman US Equity Index Putwrite Fund, Neuberger Berman Global Equity Index Putwrite Fund, Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund, Neuberger Berman CLO Income Fund, Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund, Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund, Neuberger Berman Global Diversified Income FMP – 2024, Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund y Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund se declararán trimestralmente y se abonarán en el plazo de treinta días hábiles;
- g) cada una de las restantes Clases de reparto de Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund y Neuberger Berman US Long Short Equity Fund se declaren semestralmente y se abonen en un plazo de treinta días hábiles;
- h) cada una de las restantes Clases de Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund, Neuberger Berman US Small Cap Fund, Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund, Neuberger Berman US Equity Fund y Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund se declararán anualmente y se abonarán en el plazo de treinta días hábiles;
- i) cada una de las restantes Clases de reparto de las demás Carteras se declararán de forma anual y se abonarán 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;
- j) cada una de las Clases de reparto de ingresos brutos (mensual) de las Carteras se declararán como máximo el último día hábil de cada mes y se abonarán en el plazo de tres días hábiles, y
- k) cada una de las restantes Clases de reparto de ingresos (brutos) de todas las Carteras se declararán con carácter semestral y se abonarán en un plazo de treinta días hábiles.

Siempre que existan ingresos disponibles para su distribución, el Consejo de administración podrá acordar también 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.

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021**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.

De conformidad con el documento de orientación del Banco Central titulada «Umbrella Funds – Cash Accounts Holding Subscription, Redemption and Dividend Monies», que se publicó en marzo de 2016, una o varias cuentas de efectivo de la Sociedad están siendo operadas por el Agente administrativo, por cuenta de la Sociedad, con arreglo a los requisitos del Banco Central. 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 2021, dichas cuentas de efectivo tenían un saldo de 14.069.863 USD (31 de diciembre de 2020: 17.253.401 USD). Cualquier saldo de estas cuentas de efectivo al final del periodo está reflejado en el Balance consolidado de la Sociedad.

3. DESCUBIERTO BANCARIO

A 30 de junio de 2021 y 31 de diciembre de 2020, 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 los objetivos y políticas de inversión correspondientes a cada Cartera conforme a lo dispuesto en el folleto de la Sociedad y el suplemento pertinente de la Cartera. Las Carteras no están sujetas a requisitos de capital impuestos desde el exterior. Aunque las Carteras invierten en valores mobiliarios y otros activos financieros líquidos, el Gestor de inversiones también aplica un sistema de gestión del riesgo que cuenta con un equipo con dedicación exclusiva, el Departamento de Riesgo, cuyo funcionamiento es independiente de los gestores de carteras de la Sociedad gestora. El Departamento de Riesgo realiza un seguimiento diario de la liquidez de las Carteras e incorpora diversos escenarios de pruebas de estrés, incluidas pruebas para evaluar la capacidad de cada Cartera para hacer frente a las solicitudes de reembolso de los accionistas y otros métodos de análisis para controlar los niveles de liquidez previstos. El Comité de Riesgos de Inversión del Gestor de inversiones, grupo encargado de controlar el riesgo, también revisa los resultados de las pruebas de estrés como mínimo trimestralmente. El Gestor de inversiones trata de garantizar un nivel de liquidez adecuado en las Carteras para atender los reembolsos de los accionistas en condiciones de mercado normales y con niveles de reembolsos normales.

A 30 de junio de 2021 y 31 de diciembre de 2020 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.

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

5. COMISIONES DEL GESTOR DE INVERSIONES, EL AGENTE ADMINISTRATIVO, LA ENTIDAD COMERCIALIZADORA Y EL DEPOSITARIO

Respecto de cada clase de Acciones, el Gestor de inversiones tiene derecho a cobrar una comisión por los servicios de gestión de inversiones y una comisión por los servicios de administración prestados a cada Cartera.

La comisión por servicios de administración de gestión puede ascender al 0,20% por clase de acciones, con sujeción a una comisión anual mínima de 75.000 USD por Cartera. La comisión actual de servicios de administración que se aplica a las clases de acciones B, C, C1, C2, T y M es del 0,065% (frente al 0,10% anterior, con efectos el 1 de octubre de 2020). A todas las demás clases se les aplica un 0,05% (frente al 0,075% anterior, con efectos el 1 de octubre de 2020). A continuación se recogen las comisiones de gestión de inversiones para cada clase.

Las comisiones de gestión, con la excepción de cualquier comisión de rentabilidad, se devengan diariamente y se pagan a mes vencido al final de cada mes natural; el Gestor de inversiones pagará al Gestor delegado de inversiones y a Green Court Capital Management Limited con cargo a su propia comisión y puede pagar a los asesores de inversiones nombrados para cada Cartera con cargo a su comisión. Las comisiones de gestión actualmente vigentes respecto de cada Cartera se indican en los cuadros siguientes. El Gestor de inversiones también puede solicitar a la Sociedad que le reembolse todos los gastos varios en que incurran él o sus delegados, la Entidad comercializadora o el Agente administrativo en el cumplimiento de sus obligaciones, y abonará dichos gastos reembolsados al proveedor de servicios correspondiente.

Neuberger Berman High Yield Bond Fund	Comisión de gestión	Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)	Comisión de gestión
Clase de reparto (mensual) A AUD	1,20%	Clase de acumulación I5 EUR	0,30%
Clase de acumulación A AUD	1,20%	Clase de acumulación M EUR	1,20%
Clase de reparto (mensual) B AUD	1,80%	Clase de reparto M EUR	1,20%
Clase de acumulación B AUD	1,80%	Clase de acumulación Z EUR	0,00%
Clase de reparto (mensual) C2 AUD	1,80%	Clase de reparto (mensual) A GBP	1,20%
Clase de reparto (mensual) E AUD	1,80%	Clase de acumulación A GBP	1,20%
Clase de acumulación E AUD	1,80%	Clase de reparto A GBP	1,20%
Clase de reparto I AUD	0,60%	Clase de acumulación I GBP	0,60%
Clase de reparto (mensual) T AUD	1,80%	Clase de reparto I GBP	0,60%
Clase de reparto (semanal) T AUD	1,80%	Clase de acumulación I2 GBP	0,50%
Clase de acumulación T AUD	1,80%	Clase de reparto I2 GBP	0,50%
Clase de reparto (mensual) A CAD	1,20%	Clase de acumulación Z GBP	0,00%
Clase de acumulación A CHF	1,20%	Clase de reparto I2 GBP	0,50%
Clase de acumulación I CHF	0,60%	Clase de acumulación Z GBP	0,00%
Clase de reparto I CHF	0,60%	Clase de reparto (mensual) A HKD	1,20%
Clase de acumulación I2 EUR	0,50%	Clase de acumulación A HKD	1,20%
Clase de reparto (mensual) A CNY	1,20%	Clase de acumulación A SEK	1,20%
Clase de reparto (semanal) A CNY	1,20%	Clase de reparto (mensual) A SGD	1,20%
Clase de reparto (mensual) I CNY	0,60%	Clase de acumulación A SGD	1,20%
Clase de reparto (mensual) T CNY	1,80%	Clase de reparto (mensual) A USD	1,20%
Clase de reparto (mensual) A EUR	1,20%	Clase de reparto (semanal) A USD	1,20%
Clase de acumulación A EUR	1,20%	Clase de acumulación A USD	1,20%
Clase de reparto A EUR	1,20%	Clase de reparto A USD	1,20%
Clase de acumulación I EUR	0,60%	Clase de reparto (mensual) B USD	1,80%
Clase de reparto I EUR	0,60%	Clase de acumulación B USD	1,80%
Clase de acumulación I2 EUR	0,50%	Clase de acumulación C USD	0,80%
Clase de reparto I2 EUR	0,50%	Clase de reparto C USD	0,80%

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

5. COMISIONES DEL GESTOR DE INVERSIONES, EL AGENTE ADMINISTRATIVO, LA ENTIDAD COMERCIALIZADORA Y EL DEPOSITARIO (CONT.)

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)	Comisión de gestión	Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (cont.)	Comisión de gestión
Clase de acumulación C1 USD	1,20%	Clase de reparto 1I USD	0,85%
Clase de reparto C1 USD	1,20%	Clase de acumulación B USD	1,80%
Clase de reparto (mensual) C2 USD	1,80%	Clase de acumulación C1 USD	1,70%
Clase de acumulación C2 USD	1,80%	Clase de acumulación C2 USD	1,80%
Clase de reparto (mensual) E USD	1,80%	Clase de acumulación E USD	1,80%
Clase de acumulación E USD	1,80%	Clase de acumulación I3 USD	0,50%
Clase de reparto (mensual) I USD	0,60%	Clase de reparto I3 USD	0,50%
Clase de acumulación I USD	0,60%	Clase de acumulación M USD	1,70%
Clase de reparto I USD	0,60%	Clase de acumulación P USD	0,81%
Clase de reparto (mensual) I2 USD	0,50%	Clase de acumulación T USD	1,80%
Clase de acumulación I2 USD	0,50%	Clase de acumulación U USD	1,25%
Clase de reparto I2 USD	0,50%	Clase de acumulación Z USD	0,00%
Clase de reparto (mensual) I4 USD	0,36%	Clase de acumulación B ZAR	1,80%
Clase de acumulación M USD	1,20%	Clase de acumulación C2 ZAR	1,80%
Clase de reparto M USD	1,20%	Clase de acumulación E ZAR	1,80%
Clase de acumulación P USD	0,57%	Clase de acumulación T ZAR	1,80%
Clase de reparto (mensual) T USD	1,80%		
Clase de reparto (semanal) T USD	1,80%	Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund	
Clase de acumulación T USD	1,80%	Clase de reparto (mensual) A AUD	1,50%
Clase de reparto (mensual) U USD	0,90%	Clase de reparto (mensual) B AUD	1,80%
Clase de acumulación U USD	0,90%	Clase de acumulación B AUD	1,80%
Clase de acumulación Z USD	0,00%	Clase de reparto (mensual) C2 AUD	1,80%
Clase de reparto (mensual) A ZAR	1,20%	Clase de acumulación C2 AUD	1,80%
Clase de reparto (mensual) B ZAR	1,80%	Clase de reparto (mensual) E AUD	1,80%
Clase de reparto (mensual) C2 ZAR	1,80%	Clase de acumulación E AUD	1,80%
Clase de reparto (mensual) E ZAR	1,80%	Clase de reparto (mensual) T AUD	1,80%
Clase de acumulación E ZAR	1,80%	Clase de acumulación T AUD	1,80%
Clase de reparto (mensual) T ZAR	1,80%	Clase de acumulación A CHF	1,50%
Clase de acumulación T ZAR	1,80%	Clase de acumulación A EUR	1,50%
		Clase de acumulación I EUR	0,75%
Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund		Clase de acumulación M EUR	1,50%
Clase de acumulación E AUD	1,80%	Clase de reparto (mensual) A HKD	1,50%
Clase de acumulación T AUD	1,80%	Clase de acumulación A SGD	1,50%
Clase de acumulación 1A EUR	1,70%	Clase de reparto (mensual) A USD	1,50%
Clase de acumulación 1I EUR	0,85%	Clase de acumulación A USD	1,50%
Clase de acumulación I3 EUR	0,50%	Clase de reparto A USD	1,50%
Clase de acumulación M EUR	1,70%	Clase de reparto (mensual) B USD	1,80%
Clase de reparto sin cobertura I3 GBP	0,50%	Clase de acumulación B USD	1,80%
Clase de acumulación A SGD	1,70%	Clase de acumulación C1 USD	1,50%
Clase de acumulación 1A USD	1,70%	Clase de reparto (mensual) C2 USD	1,80%
Clase de acumulación 1I USD	0,85%	Clase de acumulación C2 USD	1,80%

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

5. COMISIONES DEL GESTOR DE INVERSIONES, EL AGENTE ADMINISTRATIVO, LA ENTIDAD COMERCIALIZADORA Y EL DEPOSITARIO (CONT.)

Neuberger Berman US Small Cap Fund (cont.)	Comisión de gestión	Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund (cont.)	Comisión de gestión
Clase de acumulación E USD	1,80%	Clase de acumulación Z USD	0,00%
Clase de acumulación I USD	0,85%		
Clase de reparto I USD	0,85%	Neuberger Berman Global Bond Fund	
Clase de acumulación I3 USD	0,60%	Clase de reparto (mensual) T AUD	1,00%
Clase de acumulación M USD	1,70%	Clase de acumulación A USD	0,80%
Clase de acumulación T USD	1,80%	Clase de acumulación C1 USD	0,80%
Clase de acumulación Z USD	0,00%	Clase de acumulación I USD	0,40%
Clase de acumulación E ZAR	1,80%	Clase de acumulación M USD	0,80%
Clase de acumulación T ZAR	1,80%	Clase de reparto (mensual) T USD	1,00%
		Clase de acumulación Z USD	0,00%
		Clase de reparto (mensual) T ZAR	1,00%
Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund			
Clase de reparto (mensual) A AUD	1,20%	Neuberger Berman Emerging Market Debt – Local Currency Fund	
Clase de acumulación A CHF	1,20%	Clase de reparto (mensual) B AUD	1,80%
Clase de acumulación I CHF	0,60%	Clase de acumulación B AUD	1,80%
Clase de reparto (mensual) A CNY	1,20%	Clase de reparto (mensual) C2 AUD	1,80%
Clase de acumulación A EUR	1,20%	Clase de acumulación C2 AUD	1,80%
Clase de reparto A EUR	1,20%	Clase de reparto (mensual) E AUD	1,80%
Clase de acumulación I EUR	0,60%	Clase de acumulación E AUD	1,80%
Clase de acumulación I2 EUR	0,50%	Clase de reparto (mensual) T AUD	1,80%
Clase de reparto I2 EUR	0,50%	Clase de acumulación T AUD	1,80%
Clase de reparto I3 EUR	0,42%	Clase de acumulación A EUR	1,50%
Clase de acumulación M EUR	1,20%	Clase de acumulación I EUR	0,75%
Clase de reparto M EUR	1,20%	Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,75%
Clase de acumulación I GBP	0,60%	Clase de acumulación sin cobertura I2 EUR	0,60%
Clase de reparto I GBP	0,60%	Clase de reparto sin cobertura I3 EUR	0,53%
Clase de acumulación I2 GBP	0,50%	Clase de reparto sin cobertura I4 EUR	0,45%
Clase de reparto I2 GBP	0,50%	Clase de acumulación sin cobertura M EUR	1,50%
Clase de acumulación I JPY	0,60%	Clase de reparto sin cobertura M EUR	1,50%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,20%	Clase de acumulación sin cobertura Y EUR	0,36%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,20%	Clase de acumulación I GBP	0,75%
Clase de acumulación A USD	1,20%	Clase de acumulación sin cobertura I4 GBP	0,45%
Clase de reparto A USD	1,20%	Clase de reparto sin cobertura I4 GBP	0,45%
Clase de acumulación C USD	0,80%	Clase de acumulación sin cobertura Y GBP	0,36%
Clase de reparto C USD	0,80%	Clase de acumulación A SEK	1,50%
Clase de acumulación C1 USD	1,20%	Clase de reparto (mensual) A SGD	1,50%
Clase de acumulación I USD	0,60%	Clase de reparto (mensual) A USD	1,50%
Clase de reparto I USD	0,60%	Clase de acumulación A USD	1,50%
Clase de acumulación I2 USD	0,50%	Clase de reparto (mensual) B USD	1,80%
Clase de reparto I2 USD	0,50%	Clase de acumulación B USD	1,80%
Clase de acumulación M USD	1,20%	Clase de acumulación C1 USD	1,50%
Clase de reparto M USD	1,20%		

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

5. COMISIONES DEL GESTOR DE INVERSIONES, EL AGENTE ADMINISTRATIVO, LA ENTIDAD COMERCIALIZADORA Y EL DEPOSITARIO (CONT.)

Neuberger Berman Emerging Market Debt – Local Currency Fund (cont.)	Comisión de gestión	Neuberger Berman Emerging Market Debt – Hard Currency Fund (cont.)	Comisión de gestión
Clase de reparto (mensual) C2 USD	1,80%	Clase de acumulación Z EUR	0,00%
Clase de acumulación C2 USD	1,80%	Clase de acumulación I GBP	0,70%
Clase de reparto (mensual) E USD	1,80%	Clase de reparto I GBP	0,70%
Clase de acumulación E USD	1,80%	Clase de acumulación I2 GBP	0,56%
Clase de acumulación I USD	0,75%	Clase de reparto I2 GBP	0,56%
Clase de reparto I USD	0,75%	Clase de acumulación P GBP	0,67%
Clase de acumulación I2 USD	0,60%	Clase de reparto (mensual) A HKD	1,40%
Clase de acumulación I5 USD	0,38%	Clase de acumulación I JPY	0,70%
Clase de reparto M USD	1,50%	Clase de acumulación A SEK	1,40%
Clase de reparto (mensual) T USD	1,80%	Clase de acumulación sin cobertura I SEK	0,70%
Clase de acumulación T USD	1,80%	Clase de acumulación I2 SEK	0,56%
Clase de acumulación X USD	0,38%	Clase de reparto (mensual) A SGD	1,40%
Clase de acumulación Y USD	0,36%	Clase de reparto (mensual) A USD	1,40%
Clase de reparto (mensual) B ZAR	1,80%	Clase de acumulación A USD	1,40%
Clase de acumulación B ZAR	1,80%	Clase de reparto A USD	1,40%
Clase de reparto (mensual) C2 ZAR	1,80%	Clase de acumulación C1 USD	1,40%
Clase de acumulación C2 ZAR	1,80%	Clase de acumulación I USD	0,70%
Clase de reparto (mensual) E ZAR	1,80%	Clase de reparto I USD	0,70%
Clase de acumulación E ZAR	1,80%	Clase de acumulación I2 USD	0,56%
Clase de reparto (mensual) T ZAR	1,80%	Clase de reparto I2 USD	0,56%
Clase de acumulación T ZAR	1,80%	Clase de reparto I3 USD	0,49%
		Clase de acumulación M USD	1,40%
		Clase de reparto M USD	1,40%
		Clase de acumulación P USD	0,67%
		Clase de acumulación Z USD	0,00%
Neuberger Berman Emerging Market Debt – Hard Currency Fund	Comisión de gestión	Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund	
Clase de reparto (mensual) A AUD	1,40%	Clase de acumulación A CHF	1,60%
Clase de reparto I AUD	0,70%	Clase de acumulación I CHF	0,80%
Clase de acumulación I2 EUR	0,56%	Clase de acumulación I4 CHF	0,48%
Clase de acumulación P CHF	0,67%	Clase de acumulación I5 CHF	0,40%
Clase de reparto (mensual) A EUR	1,40%	Clase de acumulación A EUR	1,60%
Clase de acumulación A EUR	1,40%	Clase de acumulación I EUR	0,80%
Clase de acumulación I EUR	0,70%	Clase de reparto I EUR	0,80%
Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,70%	Clase de acumulación I3 EUR	0,48%
Clase de reparto I EUR	0,70%	Clase de acumulación I5 EUR	0,40%
Clase de acumulación I2 EUR	0,56%	Clase de acumulación M EUR	1,60%
Clase de reparto I2 EUR	0,56%	Clase de reparto M EUR	1,60%
Clase de acumulación I3 EUR	0,49%	Clase de acumulación X EUR	0,46%
Clase de acumulación sin cobertura I3 EUR	0,49%	Clase de acumulación I GBP	0,80%
Clase de reparto I3 EUR	0,49%	Clase de acumulación A SEK	1,60%
Clase de acumulación I4 EUR	0,42%		
Clase de acumulación M EUR	1,40%		
Clase de reparto M EUR	1,40%		
Clase de acumulación P EUR	0,67%		

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

5. COMISIONES DEL GESTOR DE INVERSIONES, EL AGENTE ADMINISTRATIVO, LA ENTIDAD COMERCIALIZADORA Y EL DEPOSITARIO (CONT.)

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)	Comisión de gestión	Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	Comisión de gestión
Clase de reparto (mensual) A USD	1,60%	Clase de reparto (mensual) A AUD	1,00%
Clase de acumulación A USD	1,60%	Clase de reparto (mensual) A CAD	1,00%
Clase de acumulación C1 USD	1,60%	Clase de acumulación A CHF	1,00%
Clase de acumulación I USD	0,80%	Clase de reparto A CHF	1,00%
Clase de reparto I USD	0,80%	Clase de acumulación I CHF	0,50%
Clase de acumulación I2 USD	0,64%	Clase de reparto I CHF	0,50%
Clase de acumulación I5 USD	0,40%	Clase de acumulación I2 EUR	0,40%
Clase de acumulación M USD	1,60%	Clase de reparto I2 CHF	0,40%
Clase de reparto M USD	1,60%	Clase de acumulación I5 CHF	0,25%
		Clase de acumulación P CHF	0,48%
		Clase de reparto P CHF	0,48%
		Clase de acumulación A EUR	1,00%
		Clase de reparto A EUR	1,00%
		Clase de acumulación I EUR	0,50%
		Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,50%
		Clase de reparto I EUR	0,50%
		Clase de acumulación I2 EUR	0,40%
		Clase de reparto I2 EUR	0,40%
		Clase de acumulación I5 EUR	0,25%
		Clase de acumulación M EUR	1,00%
		Clase de reparto M EUR	1,00%
		Clase de acumulación P EUR	0,48%
		Clase de acumulación U EUR	0,75%
		Clase de reparto X EUR	0,40%
		Clase de acumulación A GBP	1,00%
		Clase de acumulación I GBP	0,50%
		Clase de reparto I GBP	0,50%
		Clase de acumulación I2 GBP	0,40%
		Clase de reparto I2 GBP	0,40%
		Clase de reparto I5 GBP	0,25%
		Clase de acumulación P GBP	0,48%
		Clase de reparto P GBP	0,48%
		Clase de acumulación I JPY	0,50%
		Clase de reparto I JPY	0,50%
		Clase de acumulación A SEK	1,00%
		Clase de reparto (mensual) A SGD	1,00%
		Clase de reparto (mensual) A USD	1,00%
		Clase de acumulación A USD	1,00%
		Clase de reparto A USD	1,00%
		Clase de acumulación C1 USD	1,00%
		Clase de reparto C1 USD	1,00%
		Clase de acumulación I USD	0,50%

Neuberger Berman Strategic Income Fund

Clase de reparto (mensual) A AUD	1,00%
Clase de reparto (mensual) Z AUD	0,00%
Clase de reparto (mensual) A EUR	1,00%
Clase de acumulación A EUR	1,00%
Clase de acumulación I EUR	0,50%
Clase de acumulación M EUR	1,00%
Clase de reparto M EUR	1,00%
Clase de reparto (mensual) A GBP	1,00%
Clase de reparto (mensual) A HKD	1,00%
Clase de acumulación I JPY	0,50%
Clase de acumulación sin cobertura I JPY	0,50%
Clase de reparto CG I JPY	0,50%
Clase de reparto I JPY	0,50%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,00%
Clase de acumulación A SGD	1,00%
Clase de reparto (mensual) I SGD	0,50%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,00%
Clase de acumulación A USD	1,00%
Clase de reparto A USD	1,00%
Clase de acumulación C1 USD	1,00%
Clase de acumulación I USD	0,50%
Clase de reparto I USD	0,50%
Clase de acumulación M USD	1,00%
Clase de reparto M USD	1,00%
Clase de acumulación Z USD	0,00%

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

5. COMISIONES DEL GESTOR DE INVERSIONES, EL AGENTE ADMINISTRATIVO, LA ENTIDAD COMERCIALIZADORA Y EL DEPOSITARIO (CONT.)

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)	Comisión de gestión	Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)	Comisión de gestión
Clase de reparto I USD	0,50%	Clase de acumulación U USD	1,80%
Clase de acumulación I2 USD	0,40%	Clase de acumulación Z USD	0,00%
Clase de reparto I2 USD	0,40%		
Clase de acumulación I5 USD	0,25%	Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund	
Clase de reparto I5 USD	0,25%	Clase de reparto I3 AUD	0,49%
Clase de acumulación M USD	1,00%	Clase de acumulación A EUR	1,40%
Clase de reparto M USD	1,00%	Clase de acumulación I EUR	0,70%
Clase de acumulación P USD	0,48%	Clase de reparto I EUR	0,70%
Clase de acumulación Z USD	0,00%	Clase de acumulación I2 EUR	0,56%
		Clase de reparto I2 EUR	0,56%
Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund		Clase de reparto I3 EUR	0,49%
Clase de acumulación I CHF	0,75%	Clase de acumulación sin cobertura I4 EUR	0,42%
Clase de acumulación A EUR	1,50%	Clase de acumulación I5 EUR	0,35%
Clase de acumulación I EUR	0,75%	Clase de acumulación M EUR	1,40%
Clase de acumulación I2 EUR	0,60%	Clase de reparto M EUR	1,40%
Clase de acumulación M EUR	1,50%	Clase de acumulación Z EUR	0,00%
Clase de acumulación Z EUR	0,00%	Clase de acumulación I GBP	0,70%
Clase de acumulación Z GBP	0,00%	Clase de acumulación sin cobertura I GBP	0,70%
Clase de acumulación I JPY	0,75%	Clase de reparto I GBP	0,70%
Clase de acumulación A USD	1,50%	Clase de reparto sin cobertura I GBP	0,70%
Clase de acumulación I USD	0,75%	Clase de acumulación P GBP	0,67%
Clase de acumulación Z USD	0,00%	Clase de acumulación sin cobertura P GBP	0,67%
		Clase de acumulación Z GBP	0,00%
Neuberger Berman US Long Short Equity Fund		Clase de acumulación U NOK	1,05%
Clase de acumulación A EUR	2,25%	Clase de acumulación A SEK	1,40%
Clase de acumulación I EUR	1,35%	Clase de reparto (mensual) A SGD	1,40%
Clase de acumulación I3 EUR	0,95%	Clase de reparto (mensual) A USD	1,40%
Clase de acumulación sin cobertura I3 EUR	0,95%	Clase de acumulación A USD	1,40%
Clase de acumulación M EUR	2,25%	Clase de acumulación C1 USD	1,40%
Clase de acumulación sin cobertura I3 GBP	0,95%	Clase de acumulación I USD	0,70%
Clase de reparto I3 GBP	0,95%	Clase de reparto I USD	0,70%
Clase de acumulación A1 SGD	2,00%	Clase de acumulación I2 USD	0,56%
Clase de acumulación A (PF) USD	1,70%	Clase de reparto I2 USD	0,56%
Clase de acumulación A USD	2,25%	Clase de acumulación I3 USD	0,49%
Clase de acumulación A1 USD	2,00%	Clase de acumulación M USD	1,40%
Clase de acumulación C1 USD	2,25%	Clase de reparto M USD	1,40%
Clase de reparto I (PF) USD	1,00%	Clase de acumulación Z USD	0,00%
Clase de acumulación I USD	1,35%		
Clase de acumulación I3 USD	0,95%		
Clase de acumulación M USD	2,25%		

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

5. COMISIONES DEL GESTOR DE INVERSIONES, EL AGENTE ADMINISTRATIVO, LA ENTIDAD COMERCIALIZADORA Y EL DEPOSITARIO (CONT.)

Neuberger Berman European High Yield Bond Fund	Comisión de gestión	Neuberger Berman Asian Debt - Hard Currency Fund	Comisión de gestión
Clase de acumulación A EUR	1,20%	Clase de reparto (mensual) A SGD	1,20%
Clase de acumulación I EUR	0,60%	Clase de reparto (mensual) A USD	1,20%
Clase de acumulación I5 EUR	0,30%	Clase de acumulación A USD	1,20%
Clase de acumulación M EUR	1,20%	Clase de acumulación C1 USD	1,20%
Clase de reparto M EUR	1,20%	Clase de acumulación I USD	0,60%
Clase de acumulación X EUR	0,20%	Clase de reparto I USD	0,60%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,20%	Clase de acumulación M USD	1,20%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,20%	Clase de acumulación X USD	0,18%
Clase de acumulación A USD	1,20%		
Clase de acumulación I USD	0,60%	Neuberger Berman China Bond Fund	
Clase de acumulación I5 USD	0,30%	Clase de reparto (mensual) A CNY	1,30%
Clase de acumulación X USD	0,20%	Clase de reparto I CNY	0,65%
Clase de acumulación Z USD	0,00%	Clase de acumulación Z CNY	0,00%
		Clase de acumulación I EUR	0,65%
Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund		Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,65%
Clase de acumulación M EUR	0,90%	Clase de acumulación I2 GBP	0,52%
Clase de acumulación A USD	0,90%	Clase de acumulación sin cobertura I3 GBP	0,46%
Clase de acumulación I USD	0,45%	Clase de reparto sin cobertura (mensual) A SGD	1,30%
Clase de acumulación Z USD	0,00%	Clase de acumulación sin cobertura I USD	0,65%
		Clase de acumulación sin cobertura M USD	1,30%
Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund		Clase de acumulación Z USD	0,00%
Clase de acumulación M EUR	1,50%	Clase de acumulación sin cobertura Z USD	0,00%
Clase de acumulación sin cobertura Z EUR	0,00%		
Clase de acumulación Z GBP	0,00%	Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund	
Clase de acumulación A USD	1,50%	Clase de reparto (mensual) A AUD	1,20%
Clase de acumulación CI USD	1,50%	Clase de acumulación P CHF	0,57%
Clase de acumulación I USD	0,75%	Clase de reparto P CHF	0,57%
Clase de acumulación I2 USD	0,60%	Clase de reparto (mensual) A EUR	1,20%
Clase de reparto I5 USD	0,38%	Clase de acumulación A EUR	1,20%
Clase de acumulación M USD	1,50%	Clase de acumulación I EUR	0,60%
Clase de acumulación Z USD	0,00%	Clase de reparto I EUR	0,60%
		Clase de acumulación I2 EUR	0,48%
Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund		Clase de reparto I2 EUR	0,48%
Clase de acumulación sin cobertura I GBP	0,85%	Clase de acumulación I3 EUR	0,42%
Clase de acumulación A USD	1,70%	Clase de acumulación I5 EUR	0,30%
Clase de acumulación I USD	0,85%	Clase de acumulación M EUR	1,20%
Clase de acumulación M USD	1,70%	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%

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

5. COMISIONES DEL GESTOR DE INVERSIONES, EL AGENTE ADMINISTRATIVO, LA ENTIDAD COMERCIALIZADORA Y EL DEPOSITARIO (CONT.)

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (cont.)	Comisión de gestión	Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)	Comisión de gestión
Clase de reparto I2 GBP	0,48%	Clase de reparto I USD	0,40%
Clase de acumulación P GBP	0,57%	Clase de acumulación I2 USD	0,32%
Clase de reparto P GBP	0,57%	Clase de acumulación M USD	0,80%
Clase de reparto (mensual) A HKD	1,20%	Clase de acumulación Z USD	0,00%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,20%		
Clase de reparto (mensual) A USD	1,20%	Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund	
Clase de acumulación A USD	1,20%	Clase de reparto A EUR	1,30%
Clase de reparto A USD	1,20%	Clase de acumulación I EUR	0,65%
Clase de acumulación C1 USD	1,20%	Clase de acumulación M EUR	1,30%
Clase de acumulación I USD	0,60%	Clase de reparto M EUR	1,30%
Clase de reparto I USD	0,60%	Clase de reparto P GBP	0,62%
Clase de acumulación I2 USD	0,48%	Clase de acumulación A USD	1,30%
Clase de reparto I2 USD	0,48%	Clase de acumulación C1 USD	1,30%
Clase de acumulación M USD	1,20%	Clase de acumulación I USD	0,65%
Clase de reparto M USD	1,20%	Clase de reparto I USD	0,65%
Clase de acumulación P USD	0,57%	Clase de acumulación M USD	1,30%
Clase de acumulación Z USD	0,00%		
		Neuberger Berman US Equity Fund	
		Clase de acumulación A USD	1,50%
		Clase de acumulación I USD	0,75%
		Clase de reparto I USD	0,75%
		Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund	
		Clase de acumulación Z (PF) EUR	0,10%
		Clase de acumulación A USD	1,20%
		Clase de acumulación C1 USD	1,20%
		Clase de acumulación I USD	0,60%
		Clase de acumulación M USD	1,20%
		Clase de reparto M USD	1,20%
		Clase de acumulación P USD	0,57%
		Clase de acumulación X USD	0,20%
		Clase de acumulación Z USD	0,00%
		Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund	
		Clase de acumulación I EUR	0,40%
		Clase de acumulación P GBP	0,38%
		Clase de acumulación A USD	0,80%
		Clase de acumulación C1 USD	0,80%
		Clase de acumulación I USD	0,40%
		Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund	
		Clase de acumulación I EUR	0,60%
		Clase de acumulación 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 acumulación I4 GBP	0,36%
		Clase de acumulación sin cobertura I4 GBP	0,36%
		Clase de reparto I4 GBP	0,36%
		Clase de reparto (mensual) A SGD	1,20%
		Clase de acumulación A USD	1,20%
		Clase de acumulación C1 USD	1,20%
		Clase de reparto (mensual) I USD	0,60%
		Clase de acumulación I USD	0,60%
		Clase de acumulación I3 USD	0,42%
		Clase de acumulación I4 USD	0,36%
		Clase de acumulación M USD	1,20%
		Clase de acumulación P USD	0,57%
		Clase de acumulación Z USD	0,00%

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

5. COMISIONES DEL GESTOR DE INVERSIONES, EL AGENTE ADMINISTRATIVO, LA ENTIDAD COMERCIALIZADORA Y EL DEPOSITARIO (CONT.)

Neuberger Berman Global Equity Index PutWrite Fund	Comisión de gestión	Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund	Comisión de gestión
Clase de acumulación I5 CHF	0,32%	Clase de acumulación I2 AUD	0,48%
Clase de reparto I5 CHF	0,32%	Clase de acumulación I NOK	0,60%
Clase de acumulación I EUR	0,65%	Clase de acumulación I USD	0,60%
Clase de acumulación I5 EUR	0,32%	Clase de acumulación I2 USD	0,48%
Clase de acumulación M EUR	1,30%	Clase de acumulación I5 USD	0,30%
Clase de acumulación X EUR	1,14%	Clase de acumulación Z USD	0,00%
Clase de acumulación Z EUR	0,00%		
Clase de acumulación I GBP	0,65%	Neuberger Berman Emerging Markets Sustainable Equity Fund	
Clase de acumulación A USD	1,30%	Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,85%
Clase de acumulación I USD	0,65%	Clase de acumulación sin cobertura I JPY	0,85%
Clase de reparto (mensual) I5 USD	0,32%	Clase de acumulación I USD	0,85%
Clase de acumulación I5 USD	0,32%	Clase de reparto I USD	0,85%
Clase de reparto I5 USD	0,32%	Clase de acumulación I5 USD	0,43%
Clase de reparto (mensual) X USD	1,14%		
Clase de acumulación X USD	1,14%	Neuberger Berman Global Thematic Equity Fund	
Clase de acumulación Z USD	0,00%	Clase de acumulación sin cobertura M EUR	2,00%
		Clase de acumulación A USD	2,00%
Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund		Clase de acumulación C1 USD	2,00%
Clase de acumulación I CHF	0,75%	Clase de acumulación I USD	1,00%
Clase de acumulación I5 CHF	0,38%	Clase de acumulación M USD	2,00%
Clase de acumulación A EUR	1,50%		
Clase de acumulación I EUR	0,75%	Neuberger Berman CLO Income Fund	
Clase de acumulación I2 EUR	0,60%	Clase de acumulación I EUR	0,75%
Clase de acumulación I5 EUR	0,38%	Clase de reparto I2 EUR	0,60%
Clase de acumulación M EUR	1,50%	Clase de reparto I2 GBP	0,60%
Clase de acumulación I GBP	0,75%	Clase de reparto I5 GBP	0,38%
Clase de acumulación I2 GBP	0,60%	Clase de acumulación Z GBP	0,00%
Clase de acumulación I5 GBP	0,38%	Clase de acumulación I SEK	0,75%
Clase de acumulación P GBP	0,71%	Clase de acumulación I USD	0,75%
Clase de acumulación Z GBP	0,00%	Clase de reparto I2 USD	0,60%
Clase de acumulación A SGD	1,50%	Clase de reparto I5 USD	0,38%
Clase de acumulación A USD	1,50%	Clase de acumulación Z USD	0,00%
Clase de acumulación C1 USD	1,50%		
Clase de acumulación I USD	0,75%	Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund	
Clase de acumulación I2 USD	0,60%	Clase de acumulación A EUR	1,70%
Clase de acumulación I5 USD	0,38%	Clase de acumulación I EUR	0,85%
Clase de acumulación M USD	1,50%	Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,85%
Clase de acumulación P USD	0,71%	Clase de acumulación sin cobertura M EUR	1,70%
Clase de acumulación Z USD	0,00%	Clase de acumulación A USD	1,70%

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

5. COMISIONES DEL GESTOR DE INVERSIONES, EL AGENTE ADMINISTRATIVO, LA ENTIDAD COMERCIALIZADORA Y EL DEPOSITARIO (CONT.)

Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund (cont.)	Comisión de gestión	Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund	Comisión de gestión
Clase de acumulación C1 USD	1,70%	Clase de acumulación I USD	0,60%
Clase de acumulación I USD	0,85%	Clase de reparto I USD	0,60%
Clase de reparto I USD	0,85%	Clase de acumulación X USD	0,20%
Clase de acumulación M USD	1,70%	Clase de acumulación Y USD	0,18%
Clase de acumulación X USD	1,55%		
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund		Neuberger Berman 5G Connectivity Fund	
Clase de acumulación U CHF	0,29%	Clase de acumulación A AUD	1,70%
Clase de acumulación A EUR	0,38%	Clase de acumulación A CNY	1,70%
Clase de acumulación I EUR	0,19%	Clase de acumulación A EUR	1,70%
Clase de reparto I EUR	0,19%	Clase de acumulación sin cobertura A EUR	1,70%
Clase de acumulación I2 EUR	0,15%	Clase de acumulación I EUR	0,85%
Clase de acumulación I5 EUR	0,09%	Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,85%
Clase de acumulación U EUR	0,29%	Clase de acumulación I5 EUR	0,43%
Clase de acumulación Z EUR	0,00%	Clase de acumulación sin cobertura M EUR	1,70%
Clase de acumulación Z USD	0,00%	Clase de acumulación A GBP	1,70%
		Clase de acumulación sin cobertura I GBP	0,85%
Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund		Clase de acumulación A HKD	1,70%
Clase de acumulación I EUR	0,35%	Clase de acumulación A SGD	1,70%
Clase de reparto I EUR	0,35%	Clase de acumulación A USD	1,70%
		Clase de acumulación I USD	0,85%
Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund		Clase de reparto I USD	0,85%
Clase de acumulación I EUR	0,45%	Clase de acumulación I2 USD	0,68%
Clase de reparto I EUR	0,45%	Clase de acumulación I3 USD	0,60%
Clase de acumulación I5 EUR	0,23%	Clase de acumulación I5 USD	0,43%
Clase de acumulación Z USD	0,00%	Clase de acumulación M USD	1,70%
		Clase de acumulación Z USD	0,00%
Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund		Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund	
Clase de acumulación I EUR	0,60%	Clase de acumulación I JPY	0,85%
Clase de acumulación M EUR	1,20%	Clase de reparto I JPY	0,85%
Clase de acumulación Z GBP	0,00%	Clase de acumulación I5 JPY	0,43%
Clase de acumulación I SEK	0,60%	Clase de acumulación Z JPY	0,00%
Clase de reparto I SEK	0,60%		
Clase de acumulación I USD	0,60%	Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund	
Clase de acumulación X USD	0,20%	Clase de acumulación I5 CAD	0,30%
Clase de acumulación Z USD	0,00%	Clase de acumulación I EUR	0,60%
		Clase de acumulación I5 EUR	0,30%
		Clase de acumulación M EUR	1,20%
		Clase de acumulación I5 GBP	0,30%

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021
5. COMISIONES DEL GESTOR DE INVERSIONES, EL AGENTE ADMINISTRATIVO, LA ENTIDAD COMERCIALIZADORA Y EL DEPOSITARIO (CONT.)

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund (cont.)	Comisión de gestión	Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund	Comisión de gestión
Clase de acumulación A USD	1,20%	Clase de acumulación I EUR	0,60%
Clase de acumulación I USD	0,60%	Clase de reparto I EUR	0,60%
Clase de reparto I USD	0,60%	Clase de acumulación M EUR	1,50%
Clase de acumulación M USD	1,20%	Clase de acumulación Z EUR	0,00%
Clase de acumulación Z USD	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%
Neuberger Berman Global Diversified Income FMP – 2024		Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund	
Clase de acumulación A EUR	0,75%	Clase de acumulación sin cobertura I5 EUR	0,30%
Clase de reparto A EUR	0,75%	Clase de acumulación sin cobertura M EUR	1,50%
Clase de reparto I EUR	0,35%	Clase de acumulación sin cobertura Z EUR	0,00%
Clase de reparto I GBP	0,35%	Clase de acumulación sin cobertura I GBP	0,60%
Clase de reparto A HKD	0,75%	Clase de acumulación sin cobertura I5 GBP	0,30%
Clase de reparto A SGD	0,75%	Clase de acumulación I USD	0,60%
Clase de acumulación A USD	0,75%	Clase de reparto I USD	0,60%
Clase de reparto A USD	0,75%	Clase de acumulación M USD	1,50%
Clase de acumulación I USD	0,35%		
Clase de reparto I USD	0,35%		
Clase de acumulación X USD	0,40%		
Clase de reparto X USD	0,40%		
Neuberger Berman China A-Share Equity Fund			
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%		

Cuando procede, se puede aplicar un descuento a las comisiones citadas.

El Gestor de inversiones 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 el Gestor de inversiones puede suspenderlas en cualquier momento sin previo aviso. El Gestor de Inversiones 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.

La Sociedad abona al Agente administrativo comisiones de administración basadas en el valor al cierre de mes del Patrimonio neto de Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund, 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%

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021**5. COMISIONES DEL GESTOR DE INVERSIONES, EL AGENTE ADMINISTRATIVO, LA ENTIDAD COMERCIALIZADORA Y EL DEPOSITARIO (CONT.)**

A partir del 1 de enero de 2021, 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	0,008%
Activos por encima de 25.000 millones USD	0,005%

Hasta el 31 de diciembre de 2020, 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 10.000 millones USD	0,010%
Activos entre 10.000 y 25.000 millones USD	0,008%
Activos entre 25.000 y 50.000 millones USD	0,006%
Activos por encima de 50.000 millones USD	0,005%

Las comisiones antes citadas están sujetas a una comisión mínima mensual de 4.000 USD por cada Cartera y se aplican a cuatro clases de acciones por Cartera. A las Carteras que tengan más de cuatro clases de acciones se les cobrará una comisión mensual de 150 USD (modificado el 1 de enero de 2021 con respecto a los 175 USD previos) 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.

Respecto a las Acciones B, C, E, C1 y C2 de cada Cartera, la Entidad comercializadora tendrá derecho a cobrar, por los servicios de comercialización prestados a dichas clases, una comisión de comercialización del 1,00%, que se devengará diariamente y se abonará a mes vencido al final de cada mes natural. Por el resto de las clases, el Gestor de inversiones podrá pagar a la Entidad comercializadora una comisión por sus servicios de comercialización con cargo a la comisión de gestión. En relación con las Acciones M de cada Cartera, la Entidad comercializadora tendrá derecho a cobrar, por los servicios de comercialización prestados a dichas clases, una comisión de comercialización anual, expresada como porcentaje del Valor liquidativo de la clase 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 del Folleto de cada Cartera.

Comisiones de Subasesores no afiliados:

Las comisiones abonadas a los Subasesores no afiliados nombrados por el Gestor de inversiones y/o el Gestor delegado de inversiones, a excepción de Green Court Capital Management Limited, se pagarán con cargo a los activos de la Cartera. Las comisiones totales abonadas a todos los asesores estaban en torno al 0,65% y 1,50% del Patrimonio neto de la Cartera. La comisión agregada de asesoría correspondiente al semestre finalizado el 30 de junio de 2021 fue de 200.883 USD (30 de junio de 2020: 207.306 USD).

Comisiones de rentabilidad

Al cierre del período el 30 de junio de 2021 se calcula una comisión de rentabilidad para Neuberger Berman US Long Short Equity Fund, Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund y Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund.

Comisión de rentabilidad abonada al Gestor de Inversiones

El Gestor de inversiones podría estar facultado para 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 del Gestor de inversiones. 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 materializarse posteriormente.

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.

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021**5. COMISIONES DEL GESTOR DE INVERSIONES, EL AGENTE ADMINISTRATIVO, LA ENTIDAD COMERCIALIZADORA Y EL DEPOSITARIO (CONT.)****Comisiones de rentabilidad (cont.)***Comisión de rentabilidad abonada al Gestor de Inversiones (cont.)*

En caso de que el Contrato de gestión se resolviese antes de finalizar el Periodo de cálculo en cualquier año, la Comisión de rentabilidad relativa al Periodo de cálculo vigente en ese momento se calculará y abonará como si la fecha de resolución fuese la fecha final del Periodo de cálculo pertinente.

La Comisión de rentabilidad se tendrá en cuenta en el Patrimonio neto en cada Día de negociación y normalmente se abonará al Gestor de inversiones 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 al Gestor 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 al Gestor 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.

La metodología empleada para calcular la Comisión de rentabilidad para cada Cartera es la siguiente:

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund

El Gestor 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.

Definiciones

Periodo de cálculo	<p>El Periodo de cálculo comprenderá por lo general del 1 de enero al 31 de diciembre de cada año, con las siguientes excepciones:</p> <ul style="list-style-type: none"> • cuando se produzca la emisión inicial de Acciones en cada Clase PF, el primer Periodo de cálculo irá desde la fecha de emisión hasta el 31 de diciembre; • cuando una Clase PF se extinga, el Periodo de cálculo terminará en la fecha en que se produzca esa extinción; y • si el Contrato del Gestor de inversiones se resuelve en cualquier año, el Periodo de cálculo terminará en la fecha en que se produzca esa resolución. <p>El primer valor utilizado para determinar la primera Comisión de rentabilidad de una Clase PF será el Precio de oferta inicial.</p>
Cristalización	<p>El momento a partir del cual una Comisión de rentabilidad es pagadera al Gestor de inversiones. La cristalización se producirá bien al final del Periodo de cálculo o bien un Día de negociación en el que un Accionista reembolse o canjee total o parcialmente su participación en Acciones.</p>
Cota máxima	<p>El que resulte mayor de: (i) el precio de oferta inicial por Acción y (ii) el Valor liquidativo por Acción al final de cualquier Periodo de cálculo anterior respecto del que se abonara una Comisión de rentabilidad.</p>

Metodología

Para cada Periodo 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 del Periodo 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 crecimiento porcentual del Valor liquidativo por Acción a lo largo del Periodo 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 Periodo 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, tal y como se ha descrito anteriormente.

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

5. COMISIONES DEL GESTOR DE INVERSIONES, EL AGENTE ADMINISTRATIVO, LA ENTIDAD COMERCIALIZADORA Y EL DEPOSITARIO (CONT.)

Comisiones de rentabilidad (cont.)

Comisión de rentabilidad abonada al Gestor de Inversiones (cont.)

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (cont.)

Metodología (continuación)

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 de inversiones 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 al Gestor 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 al Gestor 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.

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 del Gestor de inversiones. 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 materializarse posteriormente.

En el semestre terminado el 30 de junio de 2021, el Gestor de inversiones percibió una comisión de rentabilidad de 206.390 USD (30 de junio de 2020: 134.072 USD).

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund

El Gestor 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.

Definiciones

Índice de referencia	ICE BofA Global High Yield Constrained Index en la moneda de la clase correspondiente (que se indica a continuación)
Periodo de cálculo	<p>El Periodo de cálculo comprenderá por lo general del 1 de enero al 31 de diciembre de cada año, con las siguientes excepciones:</p> <ul style="list-style-type: none"> • cuando se produzca la emisión inicial de Acciones en cada Clase PF, el primer Periodo de cálculo irá desde la fecha de emisión hasta el 31 de diciembre; • cuando una Clase PF se extinga, el Periodo de cálculo terminará en la fecha en que se produzca esa extinción; y • si el Contrato del Gestor de inversiones se resuelve en cualquier año, el Periodo de cálculo terminará en la fecha en que se produzca esa resolución. <p>El primer valor utilizado para determinar la primera Comisión de rentabilidad de una Clase PF será el Precio de oferta inicial.</p>
Cristalización	El momento en el que se devenga una Comisión de rentabilidad pagadera al Gestor de inversiones. La cristalización se producirá, bien al final del Periodo 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 por Acción y la rentabilidad del Índice de referencia durante el Periodo de cálculo.

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021**5. COMISIONES DEL GESTOR DE INVERSIONES, EL AGENTE ADMINISTRATIVO, LA ENTIDAD COMERCIALIZADORA Y EL DEPOSITARIO (CONT.)****Comisiones de rentabilidad (cont.)**

Comisión de rentabilidad abonada al Gestor de Inversiones (cont.)

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund (cont.)Metodología

Para cada Período de cálculo, se devenga una Comisión de rentabilidad en cada Clase PF en circulación respecto de cualquier Diferencia positiva de rentabilidad, es decir, la diferencia entre el crecimiento del Valor liquidativo por 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 por Acción utilizado en el cálculo de la Comisión de rentabilidad no incluye en ningún caso ajustes por swing pricing.

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 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 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	HWOC seleccionar moneda USD
Clases PF EUR con cobertura	ICE BofA Global High Yield Constrained Index – EUR Hedged	HWOC seleccionar moneda EUR
Clases PF GBP con cobertura	ICE BofA Global High Yield Constrained Index – GBP Hedged	HWOC 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 una comisión de rentabilidad 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 incluso 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 al Gestor 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 al Gestor 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 al Gestor 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.

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 del Gestor de inversiones. 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 materializarse posteriormente.

La Cartera no abonó al Gestor de inversiones ninguna comisión de rentabilidad correspondiente al período finalizado el 30 de junio de 2021 y el 30 de junio de 2020.

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

5. COMISIONES DEL GESTOR DE INVERSIONES, EL AGENTE ADMINISTRATIVO, LA ENTIDAD COMERCIALIZADORA Y EL DEPOSITARIO (CONT.)

Comisiones de rentabilidad (cont.)

Comisión de rentabilidad abonada a los asesores

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund

Los asesores designados por el Gestor de inversiones o por el Gestor delegado de inversiones (en lo sucesivo, los "Subasesores no afiliados") pueden tener derecho a percibir una comisión de rentabilidad (en lo sucesivo, la "Comisión de rentabilidad del Asesor") pagadera con cargo a los activos de la Cartera, tal y como se describe con más detalle a continuación. Sin embargo, a modo de aclaración debe indicarse que no se abonarán comisiones de rentabilidad al Gestor de inversiones y al Gestor delegado de inversiones a cargo de los activos de la Cartera gestionados por el Gestor de inversiones o el Gestor delegado de inversiones cuando actúe en capacidad de asesor. Todas las clases de la cartera son Clases PF.

Definiciones

Parte asignada	La parte de la Cartera de la que es responsable un Subasesor no afiliado.
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: <ul style="list-style-type: none"> • en el caso del nombramiento inicial de un Subasesor no afiliado, el Período de cálculo irá desde la fecha de nombramiento hasta el 31 de diciembre; • si el Subasesor no afiliado cesa en sus funciones, el Período de cálculo terminará en la fecha del cese; y • si el Contrato del Gestor de inversiones se resuelve en cualquier año, el Período de cálculo terminará en la fecha en que se produzca esa resolución.
Cristalización	El momento a partir del cual una Comisión de rentabilidad del Asesor es pagadera al Subasesor no afiliado. En el caso de las Comisiones de rentabilidad de un Subasesor no afiliado, la Cristalización se producirá (i) al final del Período de cálculo; (ii) si el Gestor de inversiones o el Gestor delegado de inversiones reducen el capital asignado a la Parte asignada pertinente o (iii) en el momento en que se cese al Subasesor no afiliado.
Cota máxima	Respecto de un Subasesor no afiliado, el que resulte mayor de: (i) el Patrimonio neto de su Parte asignada en el momento de su nombramiento; y (ii) el valor que esa Parte asignada haya alcanzado al final de cualquier Período de cálculo previo respecto del que se abonara una Comisión de rentabilidad del Asesor, ajustado por cualesquiera suscripciones y reembolsos que afecten a la Parte asignada.

Metodología

Se abonará una Comisión de rentabilidad del Asesor a un Subasesor no afiliado solo con respecto a la Parte asignada pertinente y solo a partir del momento en el que el Gestor de inversiones o el Gestor delegado de inversiones nombren al Subasesor no afiliado para gestionar la Parte asignada y hasta el momento (en su caso) en el que el Subasesor no afiliado cese de gestionar la Parte asignada.

En cada Período de cálculo en el que el Patrimonio neto de la Parte asignada supere la Cota máxima, la Comisión de rentabilidad del Asesor pagadera equivaldrá al aumento del Patrimonio neto de la Parte asignada por encima de la Cota máxima, multiplicado por el porcentaje de la Comisión de rentabilidad del Subasesor no afiliado correspondiente, de acuerdo con lo acordado con el Gestor de inversiones y el Gestor delegado de inversiones, porcentaje que no superará el 20%.

La Comisión de rentabilidad del Asesor se calculará y devengará diariamente en cada Punto de valoración. La Comisión de rentabilidad del Asesor se calcula sobre el patrimonio neto no ajustado por swing pricing de la Parte asignada (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).

Los gastos de la Cartera (excluidas las Comisiones de gestión) se asignan de forma prorrateada a cada Parte asignada y a la parte de los activos de la Cartera que no están asignados a un Subasesor no afiliado, y la Comisión de rentabilidad del Asesor respecto de cada Parte asignada se calcula y abona tras deducir la parte de esos gastos que es atribuible a la Parte asignada correspondiente.

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021**5. COMISIONES DEL GESTOR DE INVERSIONES, EL AGENTE ADMINISTRATIVO, LA ENTIDAD COMERCIALIZADORA Y EL DEPOSITARIO (CONT.)****Comisiones de rentabilidad (cont.)**

Comisión de rentabilidad abonada a los asesores (cont.)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)Metodología (continuación)

La Comisión de rentabilidad del Asesor normalmente se abonará al Subasesor no afiliado a período vencido en el plazo de 30 Días hábiles siguientes a partir del 31 de diciembre de cada año. Sin embargo, si se produce la Cristalización de una Comisión de rentabilidad del Asesor durante un Período de cálculo, la Comisión de rentabilidad del Asesor devengada por esos importes se abonará en el plazo de 30 Días hábiles a partir del cierre del trimestre natural en el que se produjo la Cristalización.

Las Comisiones de rentabilidad del Asesor cristalizadas se mantendrán en la Cartera hasta que se abonen al Subasesor no afiliado y no participarán de ganancias y pérdidas posteriores de la Parte asignada. Las Comisiones de rentabilidad del Asesor cristalizadas no se emplearán ni estarán disponibles para satisfacer reembolsos o abonar comisiones y gastos de la Parte asignada pertinente, de la Cartera o de la Sociedad (excepto el abono de las propias Comisiones de rentabilidad del Asesor pagaderas al Subasesor no afiliado).

El Depositario verificará el cálculo de la Comisión de rentabilidad del Asesor.

Los inversores deben tener en cuenta que, como la Comisión de rentabilidad del Asesor se calcula y se abona a los Subasesores no afiliados en función de la rentabilidad de sus Partes asignadas y no de la rentabilidad de la Cartera en su conjunto, es posible que la Cartera abone una Comisión de rentabilidad del Asesor a un Subasesor no afiliado en circunstancias en las que la rentabilidad total de la Cartera sea negativa. Esto podría ocurrir, por ejemplo, durante un Período de cálculo en el que la Parte asignada a un Subasesor no afiliado rinde bien, pero las Partes asignadas a los demás Subasesores no afiliados pierden valor y la rentabilidad negativa agregada supera a la positiva generada por el Subasesor no afiliado que sí recibe la Comisión de rentabilidad del Asesor.

Las Comisiones de rentabilidad del Asesor 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 del Asesor podrán abonarse sobre plusvalías latentes que podrían no materializarse posteriormente.

Los Subasesores no afiliados pueden cobrar gastos de investigación a la Cartera si llevan a cabo un programa anual de investigación para la Cartera, según acuerden con la Sociedad.

Durante el semestre finalizado el 30 de junio de 2021, AllianceBernstein L.P., Alcova Asset Management LLP, Altiq LLP y Crabel Capital Management LLC ganaron comisiones de rentabilidad por valor de 691.872 USD, 6.492.956 USD, 100.687 USD y 775.711 USD, respectivamente.

En el semestre finalizado el 30 de junio de 2020, Altiq LLP, BH-DG Systematic Trading LLP, Crabel Capital Management LLC, P/E Global LLC, Sandbar Asset Management LLP y True Partner Capital USA Holding Inc obtuvieron comisiones de rentabilidad por valor de 6.809.573, USD, 101.901 USD, 93.494 USD, 5.483.884 USD, 4.122.790 USD y 6.546.724 USD, respectivamente.

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.

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021**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 Administradores se incluyen en el gasto total. 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.

La retribución total del Consejo de administración (incluidos los gastos) correspondiente al semestre cerrado el 30 de junio de 2021 ascendió a 104.783 USD en total (30 de junio de 2020: 108.386 USD) de los que 14.279 USD estaban pendientes de pago al cierre del periodo (31 de diciembre de 2020: 47.707 USD).

A 30 de junio de 2021, Michelle Green y Alex Duncan eran empleados del Gestor de Inversiones. Michelle Green y 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 2021 (30 de junio de 2020: igual).

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. Incluyen 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 registros 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 produzcan 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.

A efectos de la información financiera, los gastos de constitución se cargan en la Cuenta de pérdidas y ganancias a medida en que se incurren. 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.

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 Neuberger Berman Europe Limited, el Gestor de inversiones y Entidad comercializadora de la Sociedad. Neuberger Berman Europe Limited percibió comisiones de gestión por valor de 130.109.622 USD (30 de junio de 2020: 96.233.608 USD) durante el semestre finalizado el 30 de junio de 2021, de los cuales 22.830.985 USD (31 de diciembre de 2020: 20.215.112 USD) estaban pendientes de pago en la fecha de cierre del periodo. También se abona una comisión de rentabilidad al Gestor de inversiones sobre ciertas Carteras, tal y como se detalla en la Nota 5. El Gestor de inversiones ganó comisiones de rentabilidad por valor de 206.390 USD (30 de junio de 2020: 134.072 USD) durante el semestre finalizado el 30 de junio de 2021, de los cuales 206.390 USD (31 de diciembre de 2020: 656.302 USD) estaban pendientes de pago en la fecha de cierre del periodo. En la Nota 5 se incluye más información sobre las Comisiones de gestión. Consúltense la Nota 6 para más información sobre los honorarios de los Consejeros abonados en los períodos finalizados a 30 de junio de 2021 y a 30 de junio de 2020.

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021**8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)**

A 30 de junio de 2021, Neuberger Berman High Yield Bond Fund poseía 25.312.164 (31 de diciembre de 2020: 25.312.164) acciones por valor de 30.771.389 USD (31 de diciembre de 2020: 28.233.977 USD) del NB Global Monthly Income Fund Ltd, un fondo gestionado por Neuberger Berman Investment Advisers LLC, filial de Neuberger Berman Europe Limited, Gestor de inversiones y Entidad comercializadora de la Sociedad y 459.982 (31 de diciembre de 2020: 459.982) acciones por valor de 5.427.788 USD (31 de diciembre de 2020: 5.234.595 USD) del Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund, que está gestionado por Neuberger Berman Europe Limited, Gestor de inversiones y Entidad comercializadora de la Sociedad. La comisión de gestión de NB Global Monthly Income Fund Ltd es del 0,75%. La comisión de gestión de Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund es del 0%. El Gestor de inversiones ofreció un descuento por importe de 120.623 USD (30 de junio de 2020: 112.288 USD) a Neuberger Berman High Yield Bond Fund en relación con su inversión, por lo que su comisión de gestión efectiva sobre la inversión era del 0,00% (31 de diciembre de 2020: igual).

A 30 de junio de 2021, Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund poseía 1.902.691 (31 de diciembre de 2020: 1.902.691) acciones por valor de 2.313.056 USD (31 de diciembre de 2020: 2.122.321 USD) del NB Global Monthly Income Fund Ltd, un fondo gestionado por Neuberger Berman Investment Advisers LLC, filial de Neuberger Berman Europe Limited, Gestor de inversiones y Entidad comercializadora de la Sociedad. La comisión de gestión de NB Global Monthly Income Fund Ltd es del 0,75%. El Gestor de inversiones ofreció un descuento por importe de 9.067 USD (30 de junio de 2020: 8.440 USD) a Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund en relación con su inversión, por lo que su comisión de gestión efectiva sobre la inversión era del 0% (31 de diciembre de 2020: igual).

En el ejercicio cerrado el 30 de junio de 2021, Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund poseía 1.845.000 (31 de diciembre de 2020: 1.845.000) acciones por valor de 19.317.150 USD (31 de diciembre de 2020: 19.095.750 USD) del Neuberger Berman China Bond Fund, que está gestionado por Neuberger Berman Europe Limited, Gestor de inversiones y Entidad comercializadora de la Sociedad. La comisión de gestión del Neuberger Berman China Bond Fund es del 0,00% (31 de diciembre de 2020: igual).

En el ejercicio cerrado el 30 de junio de 2021, Neuberger Berman Emerging Market Debt – Hard Currency Fund poseía 150.000 (31 de diciembre de 2020: 150.000) acciones por valor de 16.606.500 USD (31 de diciembre de 2020: 16.354.500 USD) del Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund, que está gestionado por Neuberger Berman Europe Limited, Gestor de inversiones y Entidad comercializadora de la Sociedad. La comisión de gestión de Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund es del 0,00% (31 de diciembre de 2020: igual).

Al 30 de junio de 2021, Neuberger Berman Strategic Income Fund poseía 945.691 acciones (31 de diciembre de 2020: 945.691) acciones por valor de 10.326.950 USD (31 de diciembre de 2020: 10.043.242 USD) del Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund, 1.094.321 (31 de diciembre de 2020: 1.094.321) acciones por valor de 14.992.197 USD (31 de diciembre de 2020: 14.455.980 USD) del Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund y 486.855 acciones (31 de diciembre de 2020: 486.855) acciones por valor de 5.822.785 USD (31 de diciembre de 2020: 5.589.095 USD) del Neuberger Berman European High Yield Bond Fund y 459.982 acciones (31 de diciembre de 2020: 459.982) acciones por valor de 5.427.783 USD (31 de diciembre de 2020: 5.234.590 USD) del Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund y 861.209 acciones (31 de diciembre de 2020: cero) por valor de 1.046.951 USD (31 de diciembre de 2020: cero USD) del NB Global Monthly Income Fund Ltd. Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund, Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund, Neuberger Berman European High Yield Bond Fund y Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund están gestionados por Neuberger Berman Europe Limited, Gestor de inversiones y Entidad comercializadora de la Sociedad. La comisión de gestión del Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund, Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund, Neuberger Berman European High Yield Bond Fund y Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund asciende al 0,00% (31 de diciembre de 2020: igual). La comisión de gestión de NB Global Monthly Income Fund Ltd es del 0,75%. El Gestor de inversiones ofreció un descuento por importe de cero USD (30 de junio de 2020: cero USD) a Neuberger Berman Strategic Income Fund en relación con su inversión, por lo que su comisión de gestión efectiva sobre la inversión era del 0,00% (31 de diciembre de 2020: igual).

A 30 de junio de 2021, Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund poseía 300.000 (31 de diciembre de 2020: 300.000) acciones por valor de 33.213.000 USD (31 de diciembre de 2020: 32.709.000 USD) del Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund, que está gestionado por Neuberger Berman Europe Limited, Gestor de inversiones y Entidad comercializadora de la Sociedad. La comisión de gestión de Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund es del 0,00% (31 de diciembre de 2020: igual).

A 30 de junio de 2021, Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund poseía 1.596.964 (31 de diciembre de 2020: 1.596.964) acciones por valor de 16.720.213 USD (31 de diciembre de 2020: 16.528.577 USD) del Neuberger Berman China Bond Fund, que está gestionado por Neuberger Berman Europe Limited, Gestor de inversiones y Entidad comercializadora de la Sociedad. La comisión de gestión del Neuberger Berman China Bond Fund es del 0,00% (31 de diciembre de 2020: igual).

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021**8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)**

A 30 de junio de 2021, Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund poseía 125.000 (31 de diciembre de 2020: 125.000) acciones por valor de 151.960 USD (31 de diciembre de 2020: 139.429 USD) del NB Global Monthly Income Fund Ltd, un fondo gestionado por Neuberger Berman Investment Advisers LLC, filial de Neuberger Berman Europe Limited, Gestor de inversiones y Entidad comercializadora de la Sociedad. La comisión de gestión del Neuberger Berman Global Floating Rate Income Fund Ltd es del 0,75%. El Gestor de inversiones ofreció un descuento por importe de 596 USD (30 de junio de 2020: 521 USD) a Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund en relación con su inversión, por lo que su comisión de gestión efectiva sobre la inversión era del 0,00%.

A 30 de junio de 2021, Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund poseía 79.779 (31 de diciembre de 2020: 79.779) acciones por valor de 835.286 USD (31 de diciembre de 2020: 825.712 USD) del Neuberger Berman China Bond Fund, que está gestionado por Neuberger Berman Europe Limited, Gestor de inversiones y Entidad comercializadora de la Sociedad. La comisión de gestión de Neuberger Berman China Bond Fund es del 0%.

A 30 de junio de 2021, Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund poseía 394.721 (31 de diciembre de 2020: cero) por valor de 479.853 USD (31 de diciembre de 2020: cero USD) del NB Global Monthly Income Fund Ltd, un fondo gestionado por Neuberger Berman Investment Advisers LLC, filial de Neuberger Berman Europe Limited, Gestor de inversiones y Entidad comercializadora de la Sociedad. La comisión de gestión del Neuberger Berman Global Floating Rate Income Fund Ltd es del 0,75%. El Gestor de inversiones ofreció un descuento por importe de cero USD (30 de junio de 2020: cero USD) a Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund en relación con su inversión, por lo que su comisión de gestión efectiva sobre la inversión era del 0,00%.

A 30 de junio de 2021 y 31 de diciembre de 2020, las inversiones cruzadas entre Carteras de la Sociedad estaban excluidas de las Cuentas consolidadas.

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 Promotor, 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) para asegurar que las obligaciones antes señaladas se aplican a todas las operaciones con partes vinculadas; y (ii) las operaciones con partes vinculadas que se hayan celebrado durante el periodo cumplen dichas obligaciones.

El Consejo de administración no conoce la existencia de transacciones con partes relacionadas durante el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 (31 de diciembre de 2020: igual), exceptuando las que constan en las presentes cuentas.

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

A 30 de junio de 2021 y 31 de diciembre de 2020, 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 2021 Número de Acciones	31 de diciembre de 2020 Número de Acciones
Neuberger Berman High Yield Bond Fund	Clase de reparto (semanal) T AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.675	1.675
Neuberger Berman High Yield Bond Fund	Clase de acumulación Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	17.419	16.356
Neuberger Berman High Yield Bond Fund	Clase de acumulación Z GBP	Empleado de Neuberger Berman	488	8.039
Neuberger Berman High Yield Bond Fund	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Bond-Plus Income & Growth Multi-Asset Class Securities Investment Trust Fund	3.083.065	3.237.608
Neuberger Berman High Yield Bond Fund	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	12.242	26.574
Neuberger Berman High Yield Bond Fund	Clase de acumulación P USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.208	1.208
Neuberger Berman High Yield Bond Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	11.177	11.177
Neuberger Berman High Yield Bond Fund	Clase de acumulación T ZAR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.308	1.308
Neuberger Berman Diversified Currency Fund	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.790
Neuberger Berman Diversified Currency Fund	Clase de acumulación M EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	901
Neuberger Berman Diversified Currency Fund	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.653
Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund	Clase de acumulación T AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	516	516
Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund	Clase de reparto sin cobertura I3 GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.065	1.065
Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund	Clase de acumulación P USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.167	1.167
Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	10.891	4.784
Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund	Clase de reparto I USD1	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	268	268
Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund	Clase de reparto (mensual) B AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.418	1.418
Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund	Clase de reparto (mensual) E AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.586	1.586
Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund	Clase de reparto (mensual) T AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.424	1.424
Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund	Clase de acumulación T AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.140	1.140

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2021 Número de Acciones	31 de diciembre de 2020 Número de Acciones
Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund	Clase de reparto (mensual) E USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.351
Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund	Clase de reparto (mensual) I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	943	943
Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.008	1.008
Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund	Clase de reparto (mensual) T USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	985	985
Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	12.429	12.396
Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund	Clase de reparto (mensual) B ZAR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.809
Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund	Clase de acumulación C2 ZAR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.921	2.921
Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund	Clase de reparto (mensual) E ZAR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.790	1.790
Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund	Clase de reparto (mensual) T ZAR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.208	1.208
Neuberger Berman China Equity Fund	Clase de acumulación Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	891	891
Neuberger Berman China Equity Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	16.177	16.177
Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund	Clase de acumulación B AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.356	1.356
Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund	Clase de acumulación E AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.356	1.356
Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund	Clase de acumulación T AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.662	2.662
Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund	Clase de reparto sin cobertura I CAD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	4.440	4.440
Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund	Clase de acumulación M EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	901	901
Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund	Clase de acumulación Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	22.279	17.803
Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund	Clase de acumulación Z GBP	Empleado de Neuberger Berman	1.153	800
Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund	Clase de acumulación B USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.859
Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund	Clase de acumulación E USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.000
Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund	Clase de acumulación T USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	670	1.963
Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	24.884	19.733
Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund	Clase de acumulación B ZAR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.410	1.410
Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund	Clase de acumulación E ZAR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.410	1.410
Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund	Clase de acumulación T ZAR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.765	2.765

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2021 Número de Acciones	31 de diciembre de 2020 Número de Acciones
Neuberger Berman US Small Cap Fund	Clase de acumulación B AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	727	727
Neuberger Berman US Small Cap Fund	Clase de acumulación C2 AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.010	1.010
Neuberger Berman US Small Cap Fund	Clase de acumulación E AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	756	756
Neuberger Berman US Small Cap Fund	Clase de acumulación T AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.329	1.329
Neuberger Berman US Small Cap Fund	Clase de acumulación sin cobertura A EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.531	2.531
Neuberger Berman US Small Cap Fund	Clase de acumulación Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	18.641	10.341
Neuberger Berman US Small Cap Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	11.267	9.204
Neuberger Berman US Small Cap Fund	Clase de acumulación E ZAR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	745	745
Neuberger Berman US Small Cap Fund	Clase de acumulación T ZAR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.812	1.812
Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	25.679	9.906
Neuberger Berman Global Bond Fund	Clase de reparto (mensual) T AUD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.937	-
Neuberger Berman Global Bond Fund	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.068	1.068
Neuberger Berman Global Bond Fund	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	888	3.210
Neuberger Berman Global Bond Fund	Clase de reparto (mensual) T USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.000	-
Neuberger Berman Global Bond Fund	Clase de reparto (mensual) T ZAR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	4.481	-
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund	Clase de acumulación B AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	824	824
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund	Clase de acumulación E AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.494	1.494
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund	Clase de acumulación T AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.472	1.472
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund	Clase de acumulación I GBP	Empleado de Neuberger Berman	7.903	7.903
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund	Clase de acumulación I GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.011	1.011
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund	Clase de acumulación A SEK	Empleado de Neuberger Berman	11.535	11.535
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund	Clase de acumulación B USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund	Clase de acumulación E USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Bond-Plus Income & Growth Multi-Asset Class Securities Investment Trust Fund	8.317.759	7.470.640

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2021 Número de Acciones	31 de diciembre de 2020 Número de Acciones
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund	Clase de acumulación I5 USD	Empleado de Neuberger Berman	2.538	2.538
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund	Clase de reparto M USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.145	-
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund	Clase de acumulación T USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	950	950
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund	Clase de acumulación E ZAR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	855	855
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund	Clase de acumulación T ZAR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.683	1.683
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund	Clase de acumulación I2 EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.911	2.911
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund	Clase de acumulación P CHF	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.118	1.118
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund	Clase de reparto (mensual) A EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.008	1.008
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund	Clase de acumulación P EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	946	946
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund	Clase de acumulación Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	36.061	31.397
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund	Clase de acumulación P GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	978	978
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund	Clase de acumulación sin cobertura I SEK	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.990	2.990
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund	Clase de reparto A USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund	Clase de reparto I2 USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	27.152	9.940
Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund	Clase de acumulación I GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	787	787
Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund	Clase de acumulación A SEK	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.409	2.409
Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund	Clase de acumulación M USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.040	1.040
Neuberger Berman Strategic Income Fund	Clase de acumulación A EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	913	913
Neuberger Berman Strategic Income Fund	Clase de reparto (mensual) A GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	834	834
Neuberger Berman Strategic Income Fund	Clase de reparto (mensual) A HKD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	11.473	11.473
Neuberger Berman Strategic Income Fund	Clase de acumulación A SGD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	682	682
Neuberger Berman Strategic Income Fund	Clase de reparto A USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.093	1.093
Neuberger Berman Strategic Income Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	21.953	9.998
Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	Clase de reparto (mensual) A CAD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.365	1.365

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2021 Número de Acciones	31 de diciembre de 2020 Número de Acciones
Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	Clase de reparto P CHF	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.245	1.245
Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	Clase de acumulación sin cobertura I EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.568	2.568
Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	Clase de reparto I GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	814	814
Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	Clase de acumulación P GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.487	2.487
Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	Clase de acumulación A SEK	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.374	2.374
Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.034	9.580
Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	28.807	47.967
Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund	Clase de acumulación Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	5.572	5.094
Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund	Clase de acumulación Z GBP	Empleado de Neuberger Berman	11.991	11.991
Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	10.891	10.891
Neuberger Berman US Long Short Equity Fund	Clase de acumulación I3 EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.771	2.771
Neuberger Berman US Long Short Equity Fund	Clase de acumulación sin cobertura I3 EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.771	2.771
Neuberger Berman US Long Short Equity Fund	Clase de acumulación sin cobertura I3 GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.455	2.455
Neuberger Berman US Long Short Equity Fund	Clase de reparto I3 GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.302	2.302
Neuberger Berman US Long Short Equity Fund	Clase de acumulación I3 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Neuberger Berman US Long Short Equity Fund	Clase de acumulación M USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.115	1.115
Neuberger Berman US Long Short Equity Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	14.441	14.441
Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund	Clase de reparto I3 EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	3.000	3.000
Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund	Clase de acumulación Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	12.640	12.136
Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund	Clase de reparto I GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	746	746
Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund	Clase de reparto sin cobertura I GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	746	746
Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund	Clase de acumulación P GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.315	2.315
Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund	Clase de acumulación sin cobertura P GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	772	772
Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund	Clase de acumulación Z GBP	Empleado de Neuberger Berman	511	4.052
Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund	Clase de reparto (mensual) A SGD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	699	699

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2021 Número de Acciones	31 de diciembre de 2020 Número de Acciones
Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund	Clase de reparto (mensual) A USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.025	1.025
Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	9	9
Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund	Clase de acumulación I2 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	857	857
Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	11.595	11.595
Neuberger Berman European High Yield Bond Fund	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.947	1.947
Neuberger Berman European High Yield Bond Fund	Clase de reparto (mensual) A USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.630	1.630
Neuberger Berman European High Yield Bond Fund	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.014	1.014
Neuberger Berman European High Yield Bond Fund	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	373.413	373.413
Neuberger Berman European High Yield Bond Fund	Clase de acumulación X USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	3.639	3.639
Neuberger Berman European High Yield Bond Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	25.907	25.580
Neuberger Berman European High Yield Bond Fund	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Strategic Income Fund	486.855	486.855
Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	886	886
Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Group LLC	612	1.664
Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	2.658	2.658
Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund	Clase de acumulación M EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund	Clase de acumulación sin cobertura Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	8.815	7.810
Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund	Clase de acumulación Z GBP	Empleado de Neuberger Berman	498	-
Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund	Clase de reparto I5 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.315	3.315
Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	9.811	9.811
Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund	Clase de acumulación sin cobertura I GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.160	-
Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund	Clase de acumulación I USD	Empleado de Neuberger Berman	958	-
Neuberger Berman Asian Debt - Hard Currency Fund	Clase de reparto (mensual) A USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.046	1.046
Neuberger Berman Asian Debt - Hard Currency Fund	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Neuberger Berman Asian Debt - Hard Currency Fund	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2021 Número de Acciones	31 de diciembre de 2020 Número de Acciones
Neuberger Berman Asian Debt - Hard Currency Fund	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Group LLC	947.710	947.710
Neuberger Berman Asian Debt - Hard Currency Fund	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Neuberger Berman China Bond Fund	Clase de reparto (mensual) A CNY	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.993	1.993
Neuberger Berman China Bond Fund	Clase de reparto I CNY	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	704	704
Neuberger Berman China Bond Fund	Clase de acumulación Z CNY	Empleado de Neuberger Berman	1.218	7.145
Neuberger Berman China Bond Fund	Clase de acumulación Z CNY	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	614	614
Neuberger Berman China Bond Fund	Clase de acumulación sin cobertura I EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	3.000	3.000
Neuberger Berman China Bond Fund	Clase de acumulación I2 GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.176	-
Neuberger Berman China Bond Fund	Clase de acumulación sin cobertura I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.003	1.003
Neuberger Berman China Bond Fund	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund	1.845.000	-
Neuberger Berman China Bond Fund	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund	1.596.964	1.596.964
Neuberger Berman China Bond Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	40.097	40.097
Neuberger Berman China Bond Fund	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund	79.779	-
Neuberger Berman China Bond Fund	Clase de acumulación sin cobertura Z USD	Empleado de Neuberger Berman	7.418	2.222
Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund	Clase de reparto (mensual) A AUD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.390	1.390
Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund	Clase de reparto I2 EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.462	2.462
Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund	Clase de acumulación P GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.469	2.469
Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund	Clase de reparto A USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.000	-
Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.000	-
Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund	Clase de reparto I2 USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.128	1.128
Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	16.722	16.722
Neuberger Berman US Equity Fund	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Neuberger Berman US Equity Fund	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	997	997
Neuberger Berman US Equity Fund	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Group LLC	227.796	227.796
Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund	Clase de acumulación Z (PF) EUR	Empleado de Neuberger Berman	542	-

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2021 Número de Acciones	31 de diciembre de 2020 Número de Acciones
Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	942	942
Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund	Clase de acumulación P USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.143	1.143
Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund	Clase de acumulación X USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	2.226	-
Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Strategic Income Fund	1.094.321	1.094.321
Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund	Clase de acumulación P GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.295	2.295
Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.175	1.175
Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Group LLC	669	669
Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.083	1.083
Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	5.484	2.825
Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund	Clase de reparto A EUR	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	2.675	2.675
Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund	Clase de reparto P GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.332	2.332
Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	847	7.236
Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	2.917	6.058
Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.132	2.132
Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund	Clase de acumulación I4 EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.111	1.111
Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund	Clase de acumulación M EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.143	1.143
Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund	Clase de acumulación sin cobertura I GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	941	941
Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund	Clase de acumulación I3 GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.120	-
Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund	Clase de acumulación I4 GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	846	846
Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund	Clase de reparto I4 GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	787	787
Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund	Clase de reparto (mensual) A SGD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	809	809
Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Group LLC	759	2.300
Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund	Clase de acumulación I3 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	849	-
Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund	Clase de acumulación M USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.134	1.134

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2021 Número de Acciones	31 de diciembre de 2020 Número de Acciones
Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund	Clase de acumulación P USD	Neuberger Berman Group LLC	997	997
Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	59.382	83.306
Neuberger Berman Global Equity Index PutWrite Fund	Clase de reparto I5 CHF	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	116	116
Neuberger Berman Global Equity Index PutWrite Fund	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Group LLC	2.786	2.786
Neuberger Berman Global Equity Index PutWrite Fund	Clase de acumulación M EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.008	1.008
Neuberger Berman Global Equity Index PutWrite Fund	Clase de acumulación Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	33.621	33.441
Neuberger Berman Global Equity Index PutWrite Fund	Clase de acumulación I GBP	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	781	781
Neuberger Berman Global Equity Index PutWrite Fund	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	146	146
Neuberger Berman Global Equity Index PutWrite Fund	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	142	142
Neuberger Berman Global Equity Index PutWrite Fund	Clase de reparto (mensual) I5 USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Neuberger Berman Global Equity Index PutWrite Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	3.008	3.556
Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund	Clase de acumulación Z GBP	Empleado de Neuberger Berman	11.785	16.606
Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund	Clase de acumulación A SGD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.061	2.061
Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	18.240	16.904
Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund	Clase de acumulación I NOK	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	808	808
Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	250.117	250.117
Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund	Clase de acumulación I5 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.452	2.452
Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	81	81
Neuberger Berman Emerging Markets Sustainable Equity Fund	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	814	2.860
Neuberger Berman Emerging Markets Sustainable Equity Fund	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.882	2.882
Neuberger Berman Global Thematic Equity Fund	Clase de acumulación sin cobertura M EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.009	1.009
Neuberger Berman Global Thematic Equity Fund	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.000
Neuberger Berman Global Thematic Equity Fund	Clase de acumulación C1 USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Neuberger Berman Global Thematic Equity Fund	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Neuberger Berman Global Thematic Equity Fund	Clase de acumulación M USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2021 Número de Acciones	31 de diciembre de 2020 Número de Acciones
Neuberger Berman CLO Income Fund	Clase de reparto I5 GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.780	2.780
Neuberger Berman CLO Income Fund	Clase de acumulación Z GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.285	2.285
Neuberger Berman CLO Income Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	35.919	35.919
Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund	Clase de acumulación A EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.459	-
Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund	Clase de acumulación sin cobertura M EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.632	2.632
Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund	Clase de acumulación C1 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	3.000	3.000
Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund	Clase de acumulación I USD	Empleado de Neuberger Berman	100	-
Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	730	993.100
Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund	Clase de acumulación M USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund	Clase de acumulación X USD	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	3.000	3.000
Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund	Clase de acumulación X USD	Empleado de Neuberger Berman	588	-
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	Clase de acumulación U CHF	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	294	294
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	Clase de acumulación A EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	247	-
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	122	122
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	Clase de reparto I EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	119	119
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	Clase de acumulación I5 EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	88	88
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	Clase de acumulación U EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	79	269
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	Clase de acumulación Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	7.250	2.700
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	Clase de acumulación M USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	297
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund	150.000	150.000
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	300.000	300.000
Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	3.000	3.000
Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund	Clase de reparto I EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	978.926	978.926

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2021 Número de Acciones	31 de diciembre de 2020 Número de Acciones
Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	30.000	30.000
Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	28.155	28.155
Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund	Clase de reparto I EUR	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	219.027	219.027
Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund	Clase de reparto I EUR	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.158.459	1.158.459
Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Strategic Income Fund	945.691	945.691
Neuberger Berman Multi-Style Premia Fund	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	3.000
Neuberger Berman Multi-Style Premia Fund	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	-	911.174
Neuberger Berman Multi-Style Premia Fund	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	184.923
Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	1.000	1.000
Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund	Clase de acumulación I EUR	Empleado de Neuberger Berman	23.771	-
Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund	Clase de acumulación M EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.749	2.749
Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund	Clase de acumulación Z GBP	Empleado de Neuberger Berman	16.762	35.996
Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund	Clase de acumulación I SEK	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.830	2.830
Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund	Clase de reparto I SEK	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.830	2.830
Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	1.081	3.000
Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	7.959	7.959
Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund ¹	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund ¹	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.458.132	1.458.132
Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund ¹	Clase de acumulación X USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Neuberger Berman 5G Connectivity Fund ¹	Clase de acumulación sin cobertura A EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	923	923
Neuberger Berman 5G Connectivity Fund ¹	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	1.871	2.667
Neuberger Berman 5G Connectivity Fund ¹	Clase de acumulación I5 EUR	Empleado de Neuberger Berman	1.965	50.000
Neuberger Berman 5G Connectivity Fund ¹	Clase de acumulación sin cobertura M EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	923	923
Neuberger Berman 5G Connectivity Fund ¹	Clase de acumulación sin cobertura I GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.326	2.326
Neuberger Berman 5G Connectivity Fund ¹	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	1.000

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2021 Número de Acciones	31 de diciembre de 2020 Número de Acciones
Neuberger Berman 5G Connectivity Fund ¹	Clase de acumulación I USD	Empleado de Neuberger Berman	500	613
Neuberger Berman 5G Connectivity Fund ¹	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	3.000
Neuberger Berman 5G Connectivity Fund ¹	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	552	552
Neuberger Berman 5G Connectivity Fund ¹	Clase de acumulación I3 USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Neuberger Berman 5G Connectivity Fund ¹	Clase de acumulación I5 USD	Empleado de Neuberger Berman	14.465	23.787
Neuberger Berman 5G Connectivity Fund ¹	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	116.276	-
Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund ¹	Clase de acumulación I JPY	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	3.000	3.000
Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund ¹	Clase de acumulación I JPY	Empleado de Neuberger Berman	4.019	-
Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund ¹	Clase de reparto I JPY	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	497.000	497.000
Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund ¹	Clase de acumulación I5 JPY	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	318	-
Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund ¹	Clase de acumulación Z JPY	Empleado de Neuberger Berman	124.042	-
Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund ¹	Clase de acumulación M EUR	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.359	3.139
Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund ¹	Clase de acumulación A USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund ¹	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	3.000	3.000
Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund ¹	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	7.763	7.763
Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund ¹	Clase de acumulación M USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund ¹	Clase de acumulación Z USD	Empleado de Neuberger Berman	11.336	11.336
Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund ¹	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman High Yield Bond Fund	459.982	-
Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund ¹	Clase de acumulación Z USD	Neuberger Berman Strategic Income Fund	459.982	459.982
Neuberger Berman China A-Share Equity Fund ¹	Clase de acumulación I CNY	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	688	688
Neuberger Berman China A-Share Equity Fund ¹	Clase de acumulación I CNY	Empleado de Neuberger Berman	6.001	-
Neuberger Berman China A-Share Equity Fund ¹	Clase de acumulación sin cobertura I USD	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	1.000	1.000
Neuberger Berman China A-Share Equity Fund ¹	Clase de acumulación sin cobertura I USD	Empleado de Neuberger Berman	-	8.658
Neuberger Berman China A-Share Equity Fund ¹	Clase de reparto sin cobertura I USD	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	250.091	98.000
Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund ²	Clase de acumulación I EUR	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	825	-

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

8. TRANSACCIONES CON PARTES RELACIONADAS (CONT.)

Cartera	Clase de Acciones	Accionista	30 de junio de 2021 Número de Acciones	31 de diciembre de 2020 Número de Acciones
Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund ²	Clase de reparto I EUR	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	409.879	-
Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund ²	Clase de acumulación M EUR	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	1.649	-
Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund ²	Clase de acumulación Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	19.230	-
Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund ²	Clase de acumulación sin cobertura A USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund ²	Clase de acumulación sin cobertura I USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund ²	Clase de acumulación sin cobertura M USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund ²	Clase de acumulación sin cobertura M EUR	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	1.649	-
Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund ²	Clase de acumulación sin cobertura Z EUR	Empleado de Neuberger Berman	109.912	-
Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund ²	Clase de acumulación sin cobertura I GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	722	-
Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund ²	Clase de acumulación sin cobertura I5 GBP	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	722	-
Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund ²	Clase de acumulación I USD	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	1.000	-
Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund ²	Clase de acumulación I USD	Empleado de Neuberger Berman	2.805	-
Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund ²	Clase de reparto I USD	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	497.000	-
Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund ²	Clase de acumulación M USD	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-

¹ Cartera lanzada durante el ejercicio contable anterior.

² Cartera lanzada durante el actual periodo contable.

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO

Todos los importes de valor liquidativo y valor liquidativo por acción señalados son los utilizados en las operaciones de los accionistas

Neuberger Berman High Yield Bond Fund

Periodo 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 2021	26.928.312 AUD	8,12 AUD	5.697.820 AUD	15,87 AUD	34.119.830 AUD	6,50 AUD
31 de diciembre de 2020	29.282.032 AUD	8,11 AUD	7.280.415 AUD	15,39 AUD	56.504.465 AUD	6,58 AUD

Periodo 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 2021	607.489 AUD	10,28 AUD	1.846.281 AUD	6,51 AUD	4.411.802 AUD	6,56 AUD
31 de diciembre de 2020	49.232 AUD	10,06 AUD	2.313.495 AUD	6,59 AUD	7.914.460 AUD	6,63 AUD

Periodo 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 2021	2.559.524 AUD	11,60 AUD	79.793.222 AUD	11,30 AUD	113.491.745 AUD	7,38 AUD
31 de diciembre de 2020	1.560.697 AUD	11,33 AUD	99.329.604 AUD	11,18 AUD	106.128.062 AUD	7,43 AUD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

Periodo 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 2021	1.355.000 AUD	7,13 AUD	2.298.700 AUD	13,75 AUD	11.174.103 CAD	8,27 CAD
31 de diciembre de 2020	1.564.842 AUD	7,18 AUD	2.198.718 AUD	13,37 AUD	3.406.278 CAD	8,26 CAD

Periodo 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 reparto I CHF Valor liquidativo	Clase de reparto I CHF Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	5.398.330 CHF	13,46 CHF	721.799 CHF	14,20 CHF	179.684 CHF	7,89 CHF
31 de diciembre de 2020	5.299.026 CHF	13,10 CHF	832.489 CHF	13,78 CHF	178.640 CHF	7,84 CHF

Periodo finalizado el	Clase de acumulación I2 CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) A CNY Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A CNY Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (semanal) A CNY Valor liquidativo	Clase de reparto (semanal) A CNY Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	2.127.383 CHF	12,15 CHF	19.984.737 CNY	90,90 CNY	4.012.616 CNY	89,14 CNY
31 de diciembre de 2020	1.453.452 CHF	11,79 CHF	16.739.363 CNY	90,13 CNY	3.958.751 CNY	87,94 CNY

Periodo finalizado el	Clase de reparto (mensual) I CNY Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) I CNY Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) T CNY Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) T 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 2021	13.213.205 CNY	95,16 CNY	549.293 CNY	81,11 CNY	8.140.449 €	7,75 €
31 de diciembre de 2020	6.659.000 CNY	94,08 CNY	546.326 CNY	80,67 CNY	7.561.674 €	7,76 €

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

Periodo 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 2021	29.822.264 €	21,59 €	4.101.586 €	8,80 €	22.158.272 €	18,94 €
31 de diciembre de 2020	32.060.845 €	20,99 €	4.556.287 €	8,73 €	28.972.814 €	18,35 €

Periodo 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 2021	12.192.649 €	8,47 €	16.904.026 €	13,27 €	412.695 €	8,35 €
31 de diciembre de 2020	14.943.513 €	8,40 €	15.605.683 €	12,86 €	47.577.439 €	8,29 €

Periodo 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 2021	177.372.189 €	10,66 €	67.984 €	12,25 €	95.607 €	9,04 €
31 de diciembre de 2020	167.259.251 €	10,31 €	70.061 €	11,94 €	100.694 €	9,06 €

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación A GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación A GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	217.887 €	12,51 €	5.204.223 £	7,80 £	2.050.576 £	14,81 £
31 de diciembre de 2020	197.680 €	12,09 €	9.310.640 £	7,79 £	2.045.374 £	14,35 £

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

Periodo finalizado el	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	Clase de reparto I GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	1.684.715 £	9,33 £	6.610.910 £	17,76 £	18.232.876 £	10,09 £
31 de diciembre de 2020	2.262.963 £	9,23 £	6.549.702 £	17,16 £	19.389.640 £	9,98 £

Periodo 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 Z GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación Z GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	706.208 £	14,18 £	29.160.964 £	8,94 £	95.413 £	13,58 £
31 de diciembre de 2020	2.715.804 £	13,70 £	226.800.654 £	8,85 £	190.625 £	13,08 £

Periodo finalizado el	Clase de reparto (mensual) A HKD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A HKD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A HKD Valor liquidativo	Clase de acumulación 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 2021	52.124.340 HKD	8,17 HKD	1.064.897 HKD	14,12 HKD	107.039.538 SEK	146,06 SEK
31 de diciembre de 2020	61.176.263 HKD	8,15 HKD	2.947.406 HKD	13,68 HKD	140.173.288 SEK	141,69 SEK

Periodo 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 2021	25.356.057 SGD	17,06 SGD	4.008.234 SGD	30,30 SGD	161.614.992 USD	8,63 USD
31 de diciembre de 2020	23.053.125 SGD	17,02 SGD	3.847.907 SGD	29,34 SGD	127.337.025 USD	8,61 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

Periodo 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 2021	2.906.811 USD	8,27 USD	232.273.937 USD	18,53 USD	33.739.182 USD	9,94 USD
31 de diciembre de 2020	2.745.485 USD	8,25 USD	229.793.610 USD	17,94 USD	30.252.626 USD	9,83 USD

Periodo 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 2021	145.571.271 USD	6,95 USD	13.855.480 USD	12,65 USD	1.203.807 USD	13,83 USD
31 de diciembre de 2020	145.918.003 USD	7,03 USD	10.856.476 USD	12,34 USD	1.537.238 USD	13,43 USD

Periodo finalizado el	Clase de reparto C USD Valor liquidativo	Clase de reparto C 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 reparto C1 USD Valor liquidativo	Clase de reparto C1 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	132.268 USD	9,74 USD	6.419.459 USD	11,35 USD	972.235 USD	10,05 USD
31 de diciembre de 2020	130.310 USD	9,63 USD	6.930.042 USD	11,04 USD	912.572 USD	9,94 USD

Periodo finalizado el	Clase de reparto (mensual) C2 USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) C2 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 reparto (mensual) E USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) E USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	9.096.781 USD	6,95 USD	4.349.775 USD	12,66 USD	21.985.469 USD	7,05 USD
31 de diciembre de 2020	8.873.363 USD	7,03 USD	1.676.881 USD	12,35 USD	24.257.744 USD	7,13 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	2.983.647 USD	11,41 USD	54.371.822 USD	8,88 USD	583.707.728 USD	27,81 USD
31 de diciembre de 2020	3.061.840 USD	11,13 USD	29.880.680 USD	8,84 USD	589.598.458 USD	26,84 USD

Periodo finalizado el	Clase de reparto I USD Valor liquidativo	Clase de reparto I USD Valor liquidativo de la Acción	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
30 de junio de 2021	50.003.864 USD	11,51 USD	64.108.596 USD	9,96 USD	447.561.627 USD	15,19 USD
31 de diciembre de 2020	45.545.960 USD	11,37 USD	59.161.744 USD	9,90 USD	433.118.997 USD	14,65 USD

Periodo finalizado el	Clase de reparto I2 USD Valor liquidativo	Clase de reparto I2 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	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	96.834.490 USD	9,60 USD	193.170.740 USD	10,68 USD	727.269 USD	13,88 USD
31 de diciembre de 2020	200.788.366 USD	9,49 USD	170.401.537 USD	10,53 USD	907.308 USD	13,48 USD

Periodo 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 reparto (mensual) T USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) T USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	648.971 USD	9,72 USD	6.577.208 USD	12,00 USD	196.913.175 USD	7,57 USD
31 de diciembre de 2020	809.598 USD	9,71 USD	5.793.338 USD	11,58 USD	177.025.571 USD	7,61 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

Periodo finalizado el	Clase de reparto (semanal) T USD Valor liquidativo	Clase de reparto (semanal) T 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 reparto (mensual) U USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) U USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	2.797.899 USD	7,61 USD	10.044.641 USD	13,77 USD	920.090 USD	8,39 USD
31 de diciembre de 2020	3.076.111 USD	7,66 USD	6.742.373 USD	13,37 USD	916.353 USD	8,35 USD

Periodo 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 reparto (mensual) A ZAR Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A ZAR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	11.307.872 USD	14,94 USD	74.237.780 USD	14,10 USD	9.870.159 ZAR	80,50 ZAR
31 de diciembre de 2020	13.134.779 USD	14,44 USD	61.065.100 USD	13,57 USD	9.946.011 ZAR	80,72 ZAR

Periodo finalizado el	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	Clase de reparto (mensual) E ZAR Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) E ZAR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	709.787.654 ZAR	69,85 ZAR	35.729.959 ZAR	69,79 ZAR	182.291.399 ZAR	69,06 ZAR
31 de diciembre de 2020	829.238.274 ZAR	70,61 ZAR	56.831.637 ZAR	70,54 ZAR	249.534.827 ZAR	69,81 ZAR

Periodo 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 2021	25.257.820 ZAR	163,41 ZAR	2.494.700.216 ZAR	76,14 ZAR	17.979.548 ZAR	148,63 ZAR
31 de diciembre de 2020	20.837.715 ZAR	155,94 ZAR	2.521.720.719 ZAR	76,58 ZAR	31.369.583 ZAR	141,13 ZAR

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Diversified Currency Fund**

Periodo 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 A USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	–	–	–	–	–	–
31 de diciembre de 2020	17.963 €	10,04 €	39.695 €	8,79 €	121.320 USD	10,58 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación I USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	–	–
31 de diciembre de 2020	1.119.707 USD	11,19 USD

** La Cartera se liquidó el 22 de enero de 2021.

Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund

Periodo 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 2021	1.834.248 AUD	18,80 AUD	1.089.510 AUD	17,38 AUD	3.096.805 €	25,50 €
31 de diciembre de 2020	801.623 AUD	16,78 AUD	542.124 AUD	15,44 AUD	2.734.679 €	22,52 €

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (cont.)

Periodo finalizado el	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación 1 A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación 1 A EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación EUR 1 I Valor liquidativo	Clase de acumulación EUR 1 I Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	644.907 €	18,61 €	2.349.581 €	28,91 €	5.181.762 €	31,13 €
31 de diciembre de 2020	741.251 €	16,62 €	1.593.328 €	25,68 €	11.712.117 €	27,54 €

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación B USD Valor liquidativo	Clase de acumulación B USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	1.150.282 £	15,55 £	31.092.446 SGD	47,32 SGD	12.789.039 USD	20,07 USD
31 de diciembre de 2020	14.730 £	13,83 £	22.788.251 SGD	41,85 SGD	5.890.577 USD	17,83 USD

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación E USD Valor liquidativo	Clase de acumulación E USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	2.745.967 USD	15,34 USD	3.145.545 USD	20,07 USD	4.868.157 USD	18,88 USD
31 de diciembre de 2020	2.554.201 USD	13,62 USD	1.928.675 USD	17,83 USD	4.041.172 USD	16,78 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación I3 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I3 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 2021	42.960.179 USD	28,46 USD	6.799.109 USD	25,57 USD	56.460.060 USD	21,32 USD
31 de diciembre de 2020	41.629.823 USD	25,00 USD	5.980.073 USD	22,49 USD	70.863.628 USD	18,94 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (cont.)

Periodo finalizado el	Clase de acumulación P USD Valor liquidativo	Clase de acumulación P 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 U USD Valor liquidativo	Clase de acumulación U USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	17.440 USD	14,95 USD	7.310.299 USD	21,66 USD	71.151.568 USD	29,54 USD
31 de diciembre de 2020	15.341 USD	13,15 USD	3.637.400 USD	19,15 USD	68.431.247 USD	26,05 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación 1 A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación 1 A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación USD 1 I Valor liquidativo	Clase de acumulación USD 1 I Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	259.661 USD	23,84 USD	89.546.541 USD	32,42 USD	348.206.110 USD	35,82 USD
31 de diciembre de 2020	99.951 USD	20,89 USD	87.666.797 USD	28,65 USD	267.245.719 USD	31,52 USD

Periodo finalizado el	Clase de reparto USD 1 I Valor liquidativo	Clase de reparto USD 1 I 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 2021	9.245.123 USD	34,56 USD	55.535.806 ZAR	278,10 ZAR	5.247.416 ZAR	276,48 ZAR
31 de diciembre de 2020	5.395.001 USD	30,41 USD	41.744.051 ZAR	242,23 ZAR	4.142.138 ZAR	240,82 ZAR

Periodo 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 2021	35.648.238 ZAR	256,10 ZAR	30.098.075 ZAR	299,87 ZAR
31 de diciembre de 2020	32.330.499 ZAR	223,06 ZAR	23.717.684 ZAR	259,90 ZAR

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund

Periodo 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 2021	1.340.883 AUD	10,73 AUD	3.921.970 AUD	10,14 AUD	2.923.690 AUD	14,23 AUD
31 de diciembre de 2020	776.966 AUD	9,08 AUD	2.111.869 AUD	8,63 AUD	2.648.865 AUD	11,87 AUD

Periodo finalizado el	Clase de reparto (mensual) C2 AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) C2 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 reparto (mensual) E AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) E AUD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	168.121 AUD	10,15 AUD	92.653 AUD	15,11 AUD	793.692 AUD	10,13 AUD
31 de diciembre de 2020	148.081 AUD	8,65 AUD	152.006 AUD	12,61 AUD	1.357.371 AUD	8,62 AUD

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación T AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación T AUD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	1.212.312 AUD	15,39 AUD	3.403.616 AUD	11,59 AUD	6.454.180 AUD	17,94 AUD
31 de diciembre de 2020	1.180.760 AUD	12,85 AUD	2.480.739 AUD	9,82 AUD	2.870.444 AUD	14,90 AUD

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	2.277.923 CHF	16,80 CHF	11.897.842 €	10,01 €	48.708.773 €	21,88 €
31 de diciembre de 2020	1.931.175 CHF	13,97 CHF	1.091.201 €	8,31 €	11.488.469 €	18,10 €

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (cont.)

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación A SGD Valor liquidativo	Clase de acumulación A SGD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	293.028 €	13,73 €	41.294.160 HKD	11,38 HKD	471.369 SGD	34,13 SGD
31 de diciembre de 2020	60.942 €	11,46 €	18.318.949 HKD	9,60 HKD	145.367 SGD	28,23 SGD

Periodo 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 2021	28.189.162 USD	13,02 USD	201.090.785 USD	26,48 USD	8.294.216 USD	19,23 USD
31 de diciembre de 2020	11.941.179 USD	10,97 USD	110.760.996 USD	21,88 USD	4.089.319 USD	16,21 USD

Periodo 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 C1 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	16.299.288 USD	11,06 USD	16.619.759 USD	16,60 USD	26.148.028 USD	13,80 USD
31 de diciembre de 2020	14.331.779 USD	9,38 USD	9.727.594 USD	13,81 USD	19.164.005 USD	11,45 USD

Periodo finalizado el	Clase de reparto (mensual) C2 USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) C2 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 reparto (mensual) E USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) E USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	1.152.996 USD	11,19 USD	1.245.813 USD	16,60 USD	7.363.878 USD	11,06 USD
31 de diciembre de 2020	731.875 USD	9,49 USD	1.191.845 USD	13,80 USD	8.260.059 USD	9,38 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (cont.)

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	14.103.063 USD	15,75 USD	91.737 USD	11,02 USD	119.697.966 USD	29,56 USD
31 de diciembre de 2020	11.436.978 USD	13,10 USD	58.740 USD	9,25 USD	76.828.613 USD	24,33 USD

Periodo 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 acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	7.510.545 USD	17,65 USD	1.050.774 USD	21,66 USD	36.322.005 USD	16,09 USD
31 de diciembre de 2020	1.013.087 USD	14,88 USD	799.855 USD	17,82 USD	19.654.163 USD	13,36 USD

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	11.779.442 USD	12,53 USD	25.298.067 USD	17,94 USD	8.392.042 USD	16,96 USD
31 de diciembre de 2020	3.781.460 USD	10,57 USD	8.086.551 USD	14,85 USD	6.039.928 USD	13,91 USD

Periodo finalizado el	Clase de reparto (mensual) B ZAR Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) B ZAR Valor liquidativo de la Acción	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
30 de junio de 2021	70.530.675 ZAR	103,82 ZAR	38.420.283 ZAR	190,85 ZAR	8.735.172 ZAR	102,64 ZAR
31 de diciembre de 2020	55.308.351 ZAR	88,45 ZAR	39.094.929 ZAR	155,84 ZAR	4.971.060 ZAR	87,45 ZAR

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (cont.)

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación E ZAR Valor liquidativo	Clase de acumulación E ZAR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	2.032.609 ZAR	188,43 ZAR	35.792.716 ZAR	103,82 ZAR	34.082.906 ZAR	213,51 ZAR
31 de diciembre de 2020	1.039.676 ZAR	153,87 ZAR	21.990.098 ZAR	88,45 ZAR	18.757.264 ZAR	174,35 ZAR

Periodo finalizado el	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 2021	163.920.308 ZAR	157,35 ZAR	34.077.679 ZAR	258,43 ZAR
31 de diciembre de 2020	50.784.596 ZAR	133,39 ZAR	19.615.302 ZAR	209,98 ZAR

Neuberger Berman China Equity Fund

Periodo 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 2021	543.267 CHF	18,67 CHF	3.038.561 €	33,05 €	2.235.111 €	35,46 €
31 de diciembre de 2020	504.251 CHF	17,33 CHF	2.864.919 €	30,75 €	2.263.915 €	32,88 €

Periodo finalizado el	Clase de acumulación I4 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación 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 2021	96.604 €	20,34 €	223.507 €	20,87 €	24.009 €	26,94 €
31 de diciembre de 2020	89.554 €	18,85 €	241.981 €	19,52 €	22.135 €	24,84 €

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman China Equity Fund (cont.)

Periodo finalizado el	Clase de reparto A GBP Valor liquidativo	Clase de reparto A GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto sin cobertura I2 GBP Valor liquidativo	Clase de reparto sin cobertura I2 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I4 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I4 GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	510.710 £	16,18 £	312.747 £	32,48 £	358.307 £	20,98 £
31 de diciembre de 2020	556.366 £	15,01 £	293.477 £	30,48 £	331.119 £	19,39 £

Periodo finalizado el	Clase de reparto I4 GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I4 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A HKD Valor liquidativo	Clase de acumulación A 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 2021	46.091 £	19,20 £	1.564.968 HKD	16,98 HKD	4.075.762 SGD	45,30 SGD
31 de diciembre de 2020	42.862 £	17,86 £	1.448.117 HKD	15,71 HKD	4.172.500 SGD	41,98 SGD

Periodo 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 2021	71.868.357 USD	38,10 USD	1.901.816 USD	23,45 USD	490.584.712 USD	41,02 USD
31 de diciembre de 2020	76.930.563 USD	35,24 USD	2.181.035 USD	21,70 USD	493.105.042 USD	37,80 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I4 USD Valor liquidativo	Clase de reparto 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 2021	26.711.684 USD	25,27 USD	175.393 USD	20,94 USD	50.965.812 USD	22,42 USD
31 de diciembre de 2020	26.896.747 USD	23,26 USD	296.197 USD	19,43 USD	47.371.641 USD	20,84 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman China Equity Fund (cont.)

Periodo 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
30 de junio de 2021	55.157.621 USD	26,46 USD	439.687 USD	27,18 USD
31 de diciembre de 2020	53.309.577 USD	24,42 USD	402.911 USD	24,91 USD

Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund

Periodo 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 2021	2.670.881 AUD	14,14 AUD	90.151 AUD	14,14 AUD	383.627 AUD	14,13 AUD
31 de diciembre de 2020	1.841.419 AUD	13,57 AUD	41.529 AUD	13,58 AUD	556.360 AUD	13,57 AUD

Periodo 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 acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	2.845.538 AUD	14,79 AUD	81.366.176 CAD	10,50 CAD	5.373.384 €	13,00 €
31 de diciembre de 2020	4.286.412 AUD	14,13 AUD	64.160.602 CAD	10,30 CAD	3.426.235 €	12,37 €

Periodo 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 acumulación I GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	818.345 €	15,38 €	243.101 €	10,91 €	563.542 £	14,51 £
31 de diciembre de 2020	1.077.506 €	14,78 €	183.919 €	10,33 €	533.572 £	13,76 £

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (cont.)

Periodo finalizado el	Clase de acumulación Z GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación Z GBP 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 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	312.010 £	17,15 £	6.177.481.398 ¥	2.063,46 ¥	6.658.894 USD	13,95 USD
31 de diciembre de 2020	288.831 £	16,19 £	5.440.453.438 ¥	1.816,51 ¥	6.089.999 USD	13,27 USD

Periodo 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 2021	5.307.876 USD	14,93 USD	317.552 USD	11,41 USD	572.301 USD	14,93 USD
31 de diciembre de 2020	6.658.005 USD	14,27 USD	318.615 USD	10,91 USD	512.151 USD	14,27 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación E USD Valor liquidativo	Clase de acumulación 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 acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	640.523 USD	14,93 USD	232.025.243 USD	15,51 USD	126.480.702 USD	15,91 USD
31 de diciembre de 2020	3.288.833 USD	14,27 USD	238.131.751 USD	14,68 USD	93.038.272 USD	15,20 USD

Periodo 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 acumulación B ZAR Valor liquidativo	Clase de acumulación B ZAR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	5.385.456 USD	15,63 USD	27.350.994 USD	15,69 USD	27.152.092 ZAR	175,03 ZAR
31 de diciembre de 2020	7.438.285 USD	14,87 USD	13.133.116 USD	14,77 USD	26.399.096 ZAR	164,45 ZAR

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (cont.)

Periodo 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 2021	5.917.675 ZAR	175,01 ZAR	15.567.766 ZAR	175,02 ZAR	33.560.617 ZAR	183,50 ZAR
31 de diciembre de 2020	6.272.736 ZAR	164,43 ZAR	8.794.806 ZAR	164,44 ZAR	40.775.053 ZAR	171,56 ZAR

Neuberger Berman US Small Cap Fund

Periodo 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 2021	1.509.766 AUD	13,12 AUD	58.311 AUD	12,80 AUD	3.641.553 AUD	18,36 AUD
31 de diciembre de 2020	885.264 AUD	12,31 AUD	59.835 AUD	12,01 AUD	1.214.209 AUD	17,23 AUD

Periodo 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 2021	1.318.367 AUD	16,71 AUD	9.007.224 €	18,32 €	27.540.970 €	13,10 €
31 de diciembre de 2020	634.012 AUD	15,61 AUD	504.436 €	17,11 €	29.818 €	11,78 €

Periodo 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 2021	6.986.102 €	21,38 €	3.426.398 €	16,75 €	18.512.891 €	15,58 €
31 de diciembre de 2020	3.108.023 €	19,88 €	727.084 €	15,00 €	16.369.196 €	13,95 €

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman US Small Cap Fund (cont.)

Periodo 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 I JPY Valor liquidativo	Clase de reparto I JPY Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	191.249 €	18,84 €	372.265 €	19,97 €	4.819.644.903 ¥	4,61 ¥
31 de diciembre de 2020	90.346 €	17,68 €	191.246 €	18,49 €	3.866.535.201 ¥	3,96 ¥

Periodo 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 B USD Valor liquidativo	Clase de acumulación B USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	196.423.669 USD	28,11 USD	11.753.313 USD	18,15 USD	13.572.186 USD	21,21 USD
31 de diciembre de 2020	94.334.706 USD	26,10 USD	5.159.376 USD	16,85 USD	9.497.339 USD	19,79 USD

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	519.656 USD	21,23 USD	11.613.821 USD	18,70 USD	205.120.812 USD	30,74 USD
31 de diciembre de 2020	452.710 USD	19,82 USD	3.538.633 USD	17,45 USD	204.818.639 USD	28,41 USD

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	25.424.059 USD	22,36 USD	79.595.488 USD	15.337,02 USD	107.942.632 USD	21,30 USD
31 de diciembre de 2020	13.968.767 USD	20,67 USD	111.832.238 USD	14.159,56 USD	72.307.070 USD	19,88 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman US Small Cap Fund (cont.)

Periodo 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 acumulación E ZAR Valor liquidativo	Clase de acumulación E ZAR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	10.433.280 USD	22,95 USD	3.008.115 USD	20,57 USD	48.331.928 ZAR	253,26 ZAR
31 de diciembre de 2020	5.109.551 USD	21,32 USD	174.277 USD	18,93 USD	21.374.260 ZAR	231,92 ZAR

Periodo finalizado el	Clase de acumulación T ZAR Valor liquidativo	Clase de acumulación T ZAR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	28.122.197 ZAR	208,22 ZAR
31 de diciembre de 2020	18.594.309 ZAR	189,73 ZAR

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund

Periodo 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 2021	489.421 AUD	8,15 AUD	958.740 CHF	11,57 CHF	242.326 CHF	12,43 CHF
31 de diciembre de 2020	421.550 AUD	8,17 AUD	1.173.975 CHF	11,33 CHF	879.040 CHF	12,12 CHF

Periodo 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 2021	2.040.618 CNY	95,40 CNY	16.714.612 €	12,12 €	4.154.759 €	7,77 €
31 de diciembre de 2020	2.030.099 CNY	94,90 CNY	15.430.284 €	11,84 €	5.000.813 €	7,75 €

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund (cont.)

Periodo 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 reparto I2 EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I2 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	38.600.396 €	12,79 €	1.397.564 €	11,84 €	414.440 €	7,71 €
31 de diciembre de 2020	22.164.342 €	12,47 €	2.555.885 €	11,53 €	563.374 €	7,69 €

Periodo finalizado el	Clase de reparto I3 EUR Valor liquidativo	Clase de reparto 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 2021	9.692.291 €	8,82 €	1.072.171 €	10,84 €	826.609 €	8,09 €
31 de diciembre de 2020	223.419.619 €	8,80 €	989.079 €	10,63 €	976.746 €	8,15 €

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación I2 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	16.227.448 £	13,75 £	6.824.877 £	8,51 £	1.353.065 £	12,75 £
31 de diciembre de 2020	11.902.323 £	13,37 £	4.217.647 £	8,46 £	1.314.244 £	12,39 £

Periodo finalizado el	Clase de reparto I2 GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I2 GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I JPY Valor liquidativo	Clase de acumulación 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 2021	4.347.352 £	8,29 £	19.034.608.982 ¥	1.279,41 ¥	368.759 SGD	16,93 SGD
31 de diciembre de 2020	5.606.544 £	8,24 £	21.575.048.856 ¥	1.244,42 ¥	324.214 SGD	16,95 SGD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund (cont.)

Periodo 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 2021	3.470.738 USD	8,60 USD	37.226.847 USD	13,69 USD	9.657.318 USD	8,84 USD
31 de diciembre de 2020	2.174.348 USD	8,60 USD	33.694.602 USD	13,33 USD	9.984.212 USD	8,78 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación C USD Valor liquidativo	Clase de acumulación C USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto C USD Valor liquidativo	Clase de reparto C 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 2021	125.409 USD	12,26 USD	125.008 USD	8,89 USD	5.830.316 USD	10,88 USD
31 de diciembre de 2020	122.481 USD	11,97 USD	148.740 USD	8,84 USD	7.435.510 USD	10,65 USD

Periodo 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 2021	102.671.913 USD	14,49 USD	64.981.748 USD	9,03 USD	114.537.833 USD	13,55 USD
31 de diciembre de 2020	210.699.468 USD	14,06 USD	61.898.208 USD	8,98 USD	6.818.566 USD	13,15 USD

Periodo 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 2021	2.361.803 USD	8,82 USD	3.551.941 USD	11,12 USD	1.162.119 USD	9,20 USD
31 de diciembre de 2020	2.056.340 USD	8,77 USD	3.415.525 USD	10,86 USD	1.191.307 USD	9,24 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund (cont.)

Periodo finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	13.354.081 USD	12,96 USD
31 de diciembre de 2020	12.727.499 USD	12,55 USD

Neuberger Berman Global Bond Fund

Periodo finalizado el	Clase de reparto (mensual) T AUD* Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) T AUD* 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 2021	37.637 AUD	9,56 AUD	483.599 USD	11,80 USD	1.378.124 USD	10,57 USD
31 de diciembre de 2020	–	–	913.244 USD	12,19 USD	1.471.918 USD	10,97 USD

Periodo 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 reparto (mensual) T USD* Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) T USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	1.726.524 USD	11,64 USD	1.463.185 USD	11,04 USD	29.154 USD	9,72 USD
31 de diciembre de 2020	1.757.110 USD	12,00 USD	1.458.608 USD	11,43 USD	–	–

Periodo finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD 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 2021	239.354.103 USD	12,15 USD	430.476 ZAR	96,08 ZAR
31 de diciembre de 2020	244.549.518 USD	12,50 USD	–	–

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund

Periodo 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 reparto (mensual) C2 AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) C2 AUD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	27.756.119 AUD	5,27 AUD	1.397.461 AUD	9,76 AUD	4.791.049 AUD	5,27 AUD
31 de diciembre de 2020	36.303.151 AUD	5,83 AUD	1.998.333 AUD	10,28 AUD	7.096.374 AUD	5,84 AUD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación C2 AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación 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	Clase de acumulación E AUD Valor liquidativo	Clase de acumulación E AUD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	696.109 AUD	9,76 AUD	3.994.877 AUD	5,28 AUD	343.187 AUD	9,75 AUD
31 de diciembre de 2020	778.438 AUD	10,28 AUD	11.462.023 AUD	5,84 AUD	803.632 AUD	10,27 AUD

Periodo finalizado el	Clase de reparto (mensual) T AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) 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 acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	41.610.200 AUD	5,60 AUD	1.976.311 AUD	10,35 AUD	28.592.650 €	8,31 €
31 de diciembre de 2020	44.340.914 AUD	6,17 AUD	2.815.360 AUD	10,85 AUD	32.036.136 €	8,72 €

Periodo 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 2021	32.344.458 €	8,82 €	196.769.575 €	10,12 €	25.363.648 €	11,90 €
31 de diciembre de 2020	33.554.119 €	9,21 €	198.964.589 €	10,19 €	46.174.682 €	11,98 €

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

Periodo finalizado el	Clase de reparto sin cobertura I3 EUR* Valor liquidativo	Clase de reparto sin cobertura I3 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 2021	10.910.138 €	9,26 €	21.734.912 €	8,44 €	–	–
31 de diciembre de 2020	12.192.408 €	9,52 €	22.339.437 €	8,68 €	59.736.117 €	10,35 €

Periodo 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 reparto sin cobertura M EUR Valor liquidativo	Clase de reparto sin cobertura M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación sin cobertura Y EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura Y EUR* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	96.021 €	10,91 €	260.687 €	7,57 €	67.546.931 €	10,06 €
31 de diciembre de 2020	181.790 €	11,07 €	393.505 €	7,94 €	–	–

Periodo finalizado el	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	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 2021	84.413 £	9,47 £	113.635.899 £	10,22 £	86.482.821 £	8,17 £
31 de diciembre de 2020	87.893 £	9,86 £	254.174.766 £	10,72 £	51.909.562 £	8,76 £

Periodo finalizado el	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 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 2021	–	–	140.446.756 £	9,74 £	12.831.597 SEK	102,39 SEK
31 de diciembre de 2020	68.949.728 £	11,73 £	–	–	13.447.625 SEK	107,28 SEK

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

Periodo 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 2021	917.339 SGD	14,62 SGD	7.021.275 USD	6,44 USD	21.791.313 USD	9,59 USD
31 de diciembre de 2020	1.694.465 SGD	15,77 SGD	4.378.190 USD	6,94 USD	25.257.659 USD	10,01 USD

Periodo 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 C1 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	70.384.968 USD	5,81 USD	3.921.481 USD	10,05 USD	114.828 USD	9,97 USD
31 de diciembre de 2020	94.090.812 USD	6,41 USD	4.973.729 USD	10,55 USD	156.484 USD	10,45 USD

Periodo finalizado el	Clase de reparto (mensual) C2 USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) C2 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 reparto (mensual) E USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) E USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	3.993.239 USD	5,81 USD	404.011 USD	10,05 USD	12.813.856 USD	5,81 USD
31 de diciembre de 2020	7.092.907 USD	6,41 USD	635.543 USD	10,56 USD	24.137.327 USD	6,41 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación E USD Valor liquidativo	Clase de acumulación 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 2021	1.456.385 USD	10,05 USD	652.186.841 USD	10,20 USD	21.507.857 USD	9,04 USD
31 de diciembre de 2020	2.802.590 USD	10,55 USD	718.694.596 USD	10,59 USD	22.464.438 USD	9,59 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

Periodo finalizado el	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación 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 reparto M USD Valor liquidativo	Clase de reparto M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	98.800.790 USD	9,87 USD	153.529.486 USD	11,50 USD	10.099 USD	8,82 USD
31 de diciembre de 2020	122.221.709 USD	10,25 USD	353.193.174 USD	11,93 USD	19.074 USD	9,54 USD

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	69.748.082 USD	6,27 USD	3.521.293 USD	10,67 USD	168.237.311 USD	10,02 USD
31 de diciembre de 2020	74.449.418 USD	6,88 USD	4.206.519 USD	11,15 USD	163.439.015 USD	10,39 USD

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación B ZAR Valor liquidativo	Clase de acumulación B ZAR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	195.964.965 USD	9,74 USD	612.899.269 ZAR	54,32 ZAR	30.678.960 ZAR	129,33 ZAR
31 de diciembre de 2020	–	–	786.482.697 ZAR	60,32 ZAR	51.556.231 ZAR	133,54 ZAR

Periodo finalizado el	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	Clase de reparto (mensual) E ZAR Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) E ZAR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	30.020.842 ZAR	54,31 ZAR	4.740.306 ZAR	129,32 ZAR	156.814.931 ZAR	54,33 ZAR
31 de diciembre de 2020	69.772.615 ZAR	60,30 ZAR	6.024.122 ZAR	133,52 ZAR	308.873.244 ZAR	60,32 ZAR

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

Periodo 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 2021	13.265.103 ZAR	129,35 ZAR	814.557.368 ZAR	57,74 ZAR	43.635.210 ZAR	137,45 ZAR
31 de diciembre de 2020	22.760.478 ZAR	133,56 ZAR	984.076.012 ZAR	63,79 ZAR	50.421.010 ZAR	141,21 ZAR

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund

Periodo 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 I2 CHF* Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 CHF* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	3.313.718 AUD	9,76 AUD	33.808.905 AUD	10,89 AUD	40.867.268 CHF	10,16 CHF
31 de diciembre de 2020	4.622.659 AUD	10,11 AUD	28.579.950 AUD	11,16 AUD	26.756.674 CHF	10,25 CHF

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	45.968.185 CHF	10,25 CHF	12.572.754 €	8,93 €	30.453.658 €	12,65 €
31 de diciembre de 2020	29.906.715 CHF	10,35 CHF	11.980.897 €	9,28 €	32.848.913 €	12,79 €

Periodo 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 reparto I EUR Valor liquidativo	Clase de reparto I EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	407.994.875 €	13,53 €	1.160.788 €	10,11 €	284.026.539 €	9,19 €
31 de diciembre de 2020	336.027.173 €	13,64 €	1.167.833 €	9,83 €	256.501.278 €	9,45 €

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

Periodo 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 2021	94.165.524 €	10,31 €	54.455.411 €	9,86 €	116.207.754 €	11,56 €
31 de diciembre de 2020	144.677.580 €	10,39 €	48.436.210 €	10,14 €	77.420.551 €	11,64 €

Periodo 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 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 2021	62.004.589 €	10,00 €	2.403.319 €	9,99 €	174.153.297 €	13,04 €
31 de diciembre de 2020	83.523.217 €	9,72 €	6.796.310 €	10,27 €	169.073.590 €	13,13 €

Periodo 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 2021	1.200.268 €	12,02 €	431.295 €	9,04 €	42.670.040 €	10,47 €
31 de diciembre de 2020	1.397.235 €	12,21 €	593.333 €	9,41 €	13.190.690 €	10,56 €

Periodo 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 2021	387.696 €	10,75 €	21.099.509 £	12,32 £	6.855.053 £	9,61 £
31 de diciembre de 2020	339.152 €	10,80 €	9.061.809 £	12,38 £	4.772.238 £	9,85 £

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

Periodo 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 2021	37.204.682 £	10,80 £	95.717.033 £	10,00 £	5.308.817 £	11,03 £
31 de diciembre de 2020	35.586.494 £	10,84 £	86.136.176 £	10,24 £	5.938.055 £	11,09 £

Periodo 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 2021	2.429.028 HKD	10,34 HKD	2.136.443.325 ¥	1.068,22 ¥	916.587.437 SEK	121,53 SEK
31 de diciembre de 2020	3.737.719 HKD	10,70 HKD	2.149.865.574 ¥	1.074,93 ¥	847.947.649 SEK	122,77 SEK

Periodo finalizado el	Clase de acumulación sin cobertura I SEK* Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I SEK* Valor liquidativo de la Acción	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
30 de junio de 2021	307.175 SEK	102,74 SEK	36.612.633 SEK	101,38 SEK	26.487.506 SGD	19,54 SGD
31 de diciembre de 2020	296.055 SEK	99,02 SEK	–	–	25.878.145 SGD	20,21 SGD

Periodo 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 2021	288.583.035 USD	9,63 USD	201.976.965 USD	14,47 USD	10.548 USD	10,55 USD
31 de diciembre de 2020	183.070.206 USD	9,95 USD	205.783.308 USD	14,58 USD	10.731 USD	10,73 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

Periodo 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 2021	20.384.633 USD	11,03 USD	1.001.371.269 USD	15,32 USD	140.708.178 USD	10,54 USD
31 de diciembre de 2020	35.072.677 USD	11,16 USD	979.308.959 USD	15,37 USD	141.097.094 USD	10,79 USD

Periodo 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 reparto I3 USD Valor liquidativo	Clase de reparto I3 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	263.906.998 USD	13,26 USD	77.616.626 USD	10,23 USD	127.926.750 USD	10,41 USD
31 de diciembre de 2020	371.126.568 USD	13,30 USD	67.483.173 USD	10,46 USD	131.068.021 USD	10,65 USD

Periodo finalizado el	Clase de reparto I4 USD* Valor liquidativo	Clase de reparto 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 2021	–	–	32.672.944 USD	11,09 USD	6.805.451 USD	9,07 USD
31 de diciembre de 2020	5.014.382 USD	10,03 USD	37.254.909 USD	11,21 USD	7.579.872 USD	9,39 USD

Periodo 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 2021	37.874.720 USD	11,37 USD	10.567.700 USD	12,61 USD
31 de diciembre de 2020	51.846.150 USD	11,41 USD	3.131.677 USD	12,61 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund

Periodo 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 2021	160.995 CHF	12,14 CHF	27.485.557 CHF	13,03 CHF	–	–
31 de diciembre de 2020	245.969 CHF	12,18 CHF	26.614.564 CHF	13,02 CHF	591.109 CHF	11,82 CHF

Periodo finalizado el	Clase de acumulación I4 CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación I4 CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I5 CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 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 2021	12.955.962 CHF	10,51 CHF	499.867 CHF	12,11 CHF	600.723 €	11,90 €
31 de diciembre de 2020	13.638.640 CHF	10,49 CHF	881.986 CHF	12,07 CHF	4.639.370 €	11,94 €

Periodo 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 I3 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I3 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	648.490 €	13,51 €	37.084 €	9,20 €	582.360 €	11,48 €
31 de diciembre de 2020	665.054 €	13,49 €	379.170 €	9,36 €	849.293 €	11,45 €

Periodo 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 2021	91.451 €	12,58 €	745.563 €	11,53 €	655.931 €	8,73 €
31 de diciembre de 2020	91.115 €	12,53 €	851.019 €	11,60 €	890.783 €	8,99 €

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)

Periodo 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 2021	49.553.586 €	12,18 €	142.450 £	14,34 £	4.639.195 SEK	104,17 SEK
31 de diciembre de 2020	49.366.439 €	12,13 €	155.374 £	14,27 £	7.070.723 SEK	104,21 SEK

Periodo 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 2021	4.358.497 USD	9,19 USD	7.700.284 USD	14,28 USD	2.070.071 USD	11,04 USD
31 de diciembre de 2020	4.358.806 USD	9,41 USD	8.732.452 USD	14,25 USD	5.170.812 USD	11,08 USD

Periodo 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 2021	15.516.304 USD	15,21 USD	3.350.480 USD	10,75 USD	1.302.993 USD	13,72 USD
31 de diciembre de 2020	19.781.489 USD	15,12 USD	3.358.805 USD	10,88 USD	1.288.435 USD	13,63 USD

Periodo 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 2021	873.610 USD	14,12 USD	2.323.534 USD	11,07 USD	902.088 USD	9,17 USD
31 de diciembre de 2020	868.396 USD	14,01 USD	2.439.021 USD	11,10 USD	768.575 USD	9,40 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Strategic Income Fund

Periodo 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) Z AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) Z AUD 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 2021	4.891.126 AUD	9,77 AUD	8.007.672 AUD	10,39 AUD	9.860.705 €	9,27 €
31 de diciembre de 2020	7.326.089 AUD	9,77 AUD	7.815.793 AUD	10,34 AUD	9.628.899 €	9,30 €

Periodo 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 M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	522.688 €	11,85 €	5.547.659 €	12,20 €	2.378.184 €	11,44 €
31 de diciembre de 2020	469.888 €	11,65 €	4.752.741 €	11,97 €	2.333.988 €	11,28 €

Periodo finalizado el	Clase de reparto M EUR Valor liquidativo	Clase de reparto 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	Clase de reparto (mensual) A HKD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A HKD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	182.452 €	9,44 €	3.203.199 £	9,56 £	17.178.912 HKD	9,96 HKD
31 de diciembre de 2020	266.466 €	9,50 €	2.671.416 £	9,56 £	7.298.799 HKD	9,95 HKD

Periodo 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 2021	15.427.566.412 ¥	1.215,71 ¥	3.640.550.016 ¥	1.547,35 ¥	6.836.978.317 ¥	1.021,65 ¥
31 de diciembre de 2020	11.738.138.687 ¥	1.189,95 ¥	3.310.196.302 ¥	1.406,02 ¥	7.102.275.697 ¥	1.061,30 ¥

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación A SGD Valor liquidativo	Clase de acumulación A SGD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	8.771.490.797 ¥	960,54 ¥	29.840.488 SGD	19,01 SGD	5.775.454 SGD	22,85 SGD
31 de diciembre de 2020	8.729.105.220 ¥	955,90 ¥	29.049.120 SGD	18,99 SGD	3.048.196 SGD	22,39 SGD

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	5.444.618 SGD	20,98 SGD	57.759.335 USD	9,66 USD	300.786.307 USD	12,72 USD
31 de diciembre de 2020	4.684.381 SGD	20,91 SGD	46.140.978 USD	9,65 USD	271.358.679 USD	12,45 USD

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	12.354.257 USD	10,91 USD	81.877.957 USD	11,35 USD	380.906.749 USD	13,63 USD
31 de diciembre de 2020	10.490.629 USD	10,83 USD	69.177.066 USD	11,17 USD	328.309.066 USD	13,31 USD

Periodo finalizado el	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	Clase de reparto M USD Valor liquidativo	Clase de reparto M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	22.799.401 USD	10,95 USD	73.440.734 USD	12,82 USD	7.768.398 USD	9,92 USD
31 de diciembre de 2020	19.332.894 USD	10,88 USD	61.890.847 USD	12,59 USD	6.824.681 USD	9,94 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

Periodo finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	48.476.184 USD	13,65 USD
31 de diciembre de 2020	56.112.017 USD	13,30 USD

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund

Periodo 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 2021	2.802.975 AUD	9,38 AUD	5.309.375 CAD	9,67 CAD	7.489.221 CHF	10,42 CHF
31 de diciembre de 2020	1.798.470 AUD	9,53 AUD	481.721 CAD	9,82 CAD	7.327.930 CHF	10,39 CHF

Periodo 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 2021	1.058.585 CHF	8,06 CHF	15.819.845 CHF	10,80 CHF	1.296.398 CHF	8,09 CHF
31 de diciembre de 2020	1.158.013 CHF	8,17 CHF	14.259.969 CHF	10,74 CHF	10.971.944 CHF	8,20 CHF

Periodo 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 2021	4.480.019 CHF	11,01 CHF	14.972.095 CHF	8,88 CHF	4.629.038 CHF	11,19 CHF
31 de diciembre de 2020	4.944.829 CHF	10,94 CHF	14.666.206 CHF	9,00 CHF	4.398.433 CHF	11,12 CHF

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

Periodo 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 acumulación A EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación A EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	42.337.887 CHF	10,44 CHF	61.570 CHF	9,13 CHF	168.778.213 €	10,74 €
31 de diciembre de 2020	39.861.743 CHF	10,38 CHF	11.469 CHF	9,21 CHF	190.191.153 €	10,70 €

Periodo 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 acumulación sin cobertura I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	23.919.745 €	8,32 €	896.377.852 €	11,14 €	231.546 €	10,42 €
31 de diciembre de 2020	21.393.422 €	8,42 €	886.467.983 €	11,07 €	25.683 €	10,00 €

Periodo 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 2021	197.770.383 €	8,33 €	109.725.116 €	11,21 €	17.235.374 €	9,02 €
31 de diciembre de 2020	201.037.419 €	8,43 €	119.441.218 €	11,13 €	133.861.145 €	9,13 €

Periodo 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 2021	7.467.558 €	11,60 €	3.632.552 €	10,58 €	1.481.935 €	8,23 €
31 de diciembre de 2020	7.552.436 €	11,51 €	4.182.226 €	10,57 €	1.533.804 €	8,40 €

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

Periodo finalizado el	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	Clase de reparto X EUR* Valor liquidativo	Clase de reparto X EUR* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	123.637.966 €	10,67 €	3.126.387 €	10,63 €	58.293.064 €	10,41 €
31 de diciembre de 2020	109.768.538 €	10,60 €	2.115.116 €	10,57 €	58.975.421 €	10,53 €

Periodo finalizado el	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	Clase de reparto I GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	2.138.948 £	11,03 £	6.535.761 £	11,27 £	5.835.036 £	9,63 £
31 de diciembre de 2020	2.957.007 £	10,95 £	6.230.959 £	11,16 £	5.640.512 £	9,71 £

Periodo 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 I5 GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I5 GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	4.399.550 £	11,24 £	249.947.706 £	9,46 £	109.550.132 £	8,89 £
31 de diciembre de 2020	4.230.950 £	11,13 £	458.560.656 £	9,54 £	106.630.589 £	8,96 £

Periodo finalizado el	Clase de acumulación P GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación P GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto P GBP* Valor liquidativo	Clase de reparto 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 2021	406.890 £	10,58 £	669.834 £	10,00 £	104.913.472.197 ¥	1.141,00 ¥
31 de diciembre de 2020	268.403 £	10,48 £	–	–	99.795.123.604 ¥	1.131,21 ¥

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

Periodo 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 2021	9.355.865.767 ¥	850,60 ¥	22.761.958 SEK	104,29 SEK	36.902.377 SGD	18,98 SGD
31 de diciembre de 2020	7.388.015.887 ¥	859,14 ¥	19.216.155 SEK	103,67 SEK	30.465.526 SGD	19,26 SGD

Periodo 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 2021	21.446.835 USD	9,63 USD	667.025.955 USD	12,38 USD	197.757.508 USD	9,34 USD
31 de diciembre de 2020	9.609.587 USD	9,77 USD	575.156.722 USD	12,28 USD	163.593.735 USD	9,41 USD

Periodo 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 2021	76.733.401 USD	10,82 USD	6.409.295 USD	9,86 USD	1.117.042.496 USD	12,82 USD
31 de diciembre de 2020	69.354.598 USD	10,79 USD	6.737.750 USD	9,94 USD	701.373.870 USD	12,69 USD

Periodo 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 2021	211.770.399 USD	9,93 USD	100.389.091 USD	12,58 USD	65.391.544 USD	9,91 USD
31 de diciembre de 2020	178.313.281 USD	10,00 USD	87.918.158 USD	12,44 USD	80.733.046 USD	9,99 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

Periodo 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 2021	7.408.395 USD	12,98 USD	7.842.174 USD	9,50 USD	61.954.605 USD	10,99 USD
31 de diciembre de 2020	7.189.358 USD	12,83 USD	6.190.819 USD	9,57 USD	57.279.925 USD	10,94 USD

Periodo 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 2021	10.160.543 USD	9,26 USD	189.962.802 USD	12,41 USD	27.203.496 USD	13,15 USD
31 de diciembre de 2020	9.933.247 USD	9,41 USD	101.179.974 USD	12,29 USD	18.067.663 USD	12,98 USD

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund

Periodo 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 2021	602.943 CHF	9,66 CHF	644.851 €	9,34 €	215.177 €	9,78 €
31 de diciembre de 2020	1.788.357 CHF	9,60 CHF	834.532 €	9,31 €	357.019 €	9,72 €

Periodo 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 Z EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación Z EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	260.882 €	10,23 €	1.202.824 €	9,87 €	58.121 €	10,43 €
31 de diciembre de 2020	310.487 €	10,15 €	1.156.688 €	9,87 €	52.547 €	10,31 €

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Periodo finalizado el	Clase de acumulación Z GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación Z GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto D JPY* Valor liquidativo	Clase de reparto D 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 2021	132.832 £	11,08 £	–	–	4.965.404.655 ¥	992,52 ¥
31 de diciembre de 2020	130.962 £	10,92 £	90.586.446 ¥	983,29 ¥	4.732.899.851 ¥	982,69 ¥

Periodo 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 2021	3.051.846 USD	10,61 USD	2.092.313 USD	11,31 USD	126.371 USD	11,60 USD
31 de diciembre de 2020	3.209.486 USD	10,52 USD	2.080.102 USD	11,17 USD	124.386 USD	11,42 USD

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund

Periodo 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 2021	1.649.777 €	11,59 €	58.911.791 €	12,34 €	119.225.281 €	11,52 €
31 de diciembre de 2020	1.431.626 €	11,35 €	57.096.096 €	12,02 €	102.996.824 €	11,20 €

Periodo 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 acumulación sin cobertura I3 GBP* Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I3 GBP* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	29.503 €	10,65 €	5.184.727 €	11,51 €	25.306 £	10,31 £
31 de diciembre de 2020	27.687 €	9,99 €	5.671.802 €	11,31 €	139.540 £	10,09 £

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (cont.)

Periodo finalizado el	Clase de reparto I3 GBP* Valor liquidativo	Clase de reparto I3 GBP* Valor liquidativo de la Acción	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
30 de junio de 2021	1.381.288 £	10,81 £	571.719 SGD	26,12 SGD	1.415.718 USD	12,64 USD
31 de diciembre de 2020	1.003.124 £	10,48 £	505.795 SGD	25,44 SGD	1.191.791 USD	12,34 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A1 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A1 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 2021	13.865.910 USD	12,83 USD	17.476.784 USD	13,61 USD	47.314 USD	11,83 USD
31 de diciembre de 2020	9.583.362 USD	12,51 USD	15.175.857 USD	13,25 USD	46.340 USD	11,59 USD

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación I3 USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación I3 USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	38.878.712 USD	13,13 USD	29.287.690 USD	14,39 USD	132.553.010 USD	11,65 USD
31 de diciembre de 2020	36.974.960 USD	12,79 USD	27.237.243 USD	13,96 USD	83.893.777 USD	11,28 USD

Ejercicio finalizado el	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	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	1.023.455 USD	12,03 USD	7.402.483 USD	13,31 USD	7.105.351 USD	15,58 USD
31 de diciembre de 2020	929.283 USD	11,77 USD	7.247.145 USD	12,95 USD	8.873.535 USD	15,02 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund

Periodo 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 2021	8.380.712 AUD	9,33 AUD	9.535.727 €	11,42 €	288.242.423 €	11,60 €
31 de diciembre de 2020	12.337.115 AUD	9,53 AUD	22.523.225 €	11,49 €	281.551.972 €	11,63 €

Periodo 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 2021	46.087.448 €	8,68 €	120.291.151 €	11,89 €	34.231.770 €	8,46 €
31 de diciembre de 2020	52.449.335 €	8,87 €	290.082.908 €	11,91 €	37.285.901 €	8,64 €

Periodo 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 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I4 GBP 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 2021	40.910.757 €	9,33 €	624.986 €	10,70 €	28.296.347 €	12,52 €
31 de diciembre de 2020	41.809.768 €	9,54 €	802.328 €	10,51 €	28.095.258 €	12,53 €

Periodo 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 2021	894.326 €	11,16 €	680.757 €	8,03 €	155.954 €	12,34 €
31 de diciembre de 2020	1.033.414 €	11,27 €	838.160 €	8,35 €	149.520 €	12,32 €

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

Periodo 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 2021	910.812 £	12,14 £	103.944.464 £	10,51 £	14.811.388 £	9,46 £
31 de diciembre de 2020	827.671 £	12,40 £	129.996.866 £	10,79 £	17.562.005 £	9,86 £

Periodo 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 2021	655.267 £	9,51 £	35.832.485 £	10,63 £	1.193.053 £	10,43 £
31 de diciembre de 2020	744.375 £	9,96 £	28.164.666 £	10,85 £	1.154.865 £	10,71 £

Periodo 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 2021	226.307 £	13,01 £	9.129.123 NOK	114,63 NOK	30.383.725 SEK	116,56 SEK
31 de diciembre de 2020	277.214 £	13,24 £	9.249.526 NOK	116,34 NOK	74.265.173 SEK	116,56 SEK

Periodo 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 2021	227.437 SGD	16,62 SGD	489.631 USD	8,43 USD	34.777.279 USD	12,89 USD
31 de diciembre de 2020	1.013.440 SGD	17,33 SGD	387.419 USD	8,85 USD	13.780.922 USD	13,14 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (cont.)

Periodo 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 2021	1.812.392 USD	10,27 USD	107.386.608 USD	11,99 USD	1.812.893 USD	10,01 USD
31 de diciembre de 2020	2.630.014 USD	10,52 USD	174.767.462 USD	12,18 USD	1.134.281 USD	10,37 USD

Periodo 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 I3 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I3 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	10.905 USD	12,73 USD	62.014.115 USD	9,19 USD	47.366.965 USD	10,89 USD
31 de diciembre de 2020	11.065 USD	12,91 USD	55.396.416 USD	9,52 USD	44.413.446 USD	11,05 USD

Periodo 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 2021	3.706.414 USD	10,31 USD	1.814.723 USD	8,20 USD	163.354 USD	14,09 USD
31 de diciembre de 2020	4.463.119 USD	10,55 USD	1.855.489 USD	8,63 USD	165.320 USD	14,26 USD

Neuberger Berman EUR opean High Yield Bond Fund

Periodo 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 I5 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	189.299 €	13,16 €	529.705 €	13,58 €	13.462 €	13,26 €
31 de diciembre de 2020	200.153 €	12,76 €	396.191 €	13,13 €	13.000 €	12,81 €

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman EUR opean High Yield Bond Fund (cont.)

Periodo 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 X EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación X EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	410.587 €	12,67 €	263.332 €	10,09 €	4.704.750 €	11,84 €
31 de diciembre de 2020	405.210 €	12,33 €	359.549 €	10,04 €	4.540.841 €	11,43 €

Periodo 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 2021	121.935 SGD	20,34 SGD	1.277.786 USD	10,21 USD	75.824 USD	12,27 USD
31 de diciembre de 2020	1.807.694 SGD	20,24 SGD	685.584 USD	10,17 USD	97.986 USD	11,85 USD

Periodo 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 X USD Valor liquidativo	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	5.944.392 USD	15,27 USD	85.818 USD	11,46 USD	18.038.221 USD	12,74 USD
31 de diciembre de 2020	5.534.878 USD	14,70 USD	165.257 USD	11,02 USD	17.339.022 USD	12,25 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	6.130.762 USD	11,96 USD
31 de diciembre de 2020	7.736.042 USD	11,48 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund

Periodo finalizado el	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación 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 I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	1.330.683 €	16,27 €	938.498 USD	17,47 USD	323.860 USD	18,31 USD
31 de diciembre de 2020	1.028.083 €	14,38 €	125.203 USD	15,29 USD	26.596 USD	15,99 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	7.393.342 USD	19,75 USD
31 de diciembre de 2020	6.861.153 USD	17,19 USD

Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund

Periodo 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 2021	723.669 €	12,75 €	106.767 €	12,11 €	101.779 £	13,93 £
31 de diciembre de 2020	234.265 €	11,24 €	79.405 €	10,17 €	82.363 £	12,10 £

Periodo 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 2021	5.563.200 USD	12,04 USD	245.253 USD	10,89 USD	9.278.244 USD	15,19 USD
31 de diciembre de 2020	2.408.265 USD	10,50 USD	105.046 USD	9,55 USD	2.811.248 USD	13,21 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (cont.)

Periodo finalizado el	Clase de acumulación I2 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 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 2021	415.110 USD	13,47 USD	36.177 USD	10,91 USD	234.543 USD	11,17 USD
31 de diciembre de 2020	591.304 USD	11,70 USD	31.948 USD	9,64 USD	57.276 USD	9,79 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	150.342 USD	15,32 USD
31 de diciembre de 2020	130.210 USD	13,27 USD

Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund

Periodo 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 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 2021	19.515.760 £	10,87 £	7.920.988 USD	24,06 USD	121.135.909 USD	20,88 USD
31 de diciembre de 2020	–	–	2.078.429 USD	19,38 USD	94.722.218 USD	16,76 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	485.486 USD	20,30 USD
31 de diciembre de 2020	11.958 USD	16,43 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Asian Debt - Hard Currency Fund

Periodo 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 2021	2.105 SGD	19,56 SGD	937.075 USD	9,94 USD	3.002.775 USD	13,01 USD
31 de diciembre de 2020	142.865 SGD	20,00 SGD	1.032.834 USD	10,17 USD	2.786.141 USD	13,01 USD

Periodo 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 2021	1.470.742 USD	10,43 USD	584.978 USD	13,46 USD	10.390.647 USD	10,87 USD
31 de diciembre de 2020	1.535.244 USD	10,49 USD	138.849 USD	13,43 USD	10.817.141 USD	11,24 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M 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 2021	1.196.990 USD	10,59 USD	10.002 USD	10,00 USD
31 de diciembre de 2020	1.739.079 USD	10,62 USD	–	–

Neuberger Berman China Bond Fund

Periodo 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 2021	187.746 CNY	94,22 CNY	1.463.726 CNY	101,55 CNY	226.555 CNY	123,69 CNY
31 de diciembre de 2020	2.890.250 CNY	95,44 CNY	1.459.514 CNY	101,25 CNY	937.164 CNY	120,79 CNY

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman China Bond Fund (cont.)

Periodo 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 I2 GBP* Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 GBP* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	12.135.343 €	10,09 €	553.812 €	10,02 €	22.021 £	10,12 £
31 de diciembre de 2020	80.293 €	10,04 €	508.185 €	9,46 €	–	–

Periodo finalizado el	Clase de acumulación sin cobertura I3 GBP* Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I3 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 2021	15.202.418 £	9,76 £	2.098.915 SGD	18,97 SGD	9.397.748 USD	11,91 USD
31 de diciembre de 2020	14.953.495 £	9,60 £	1.258.824 SGD	18,78 SGD	9.484.209 USD	11,61 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación sin cobertura M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura M 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 sin cobertura Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	198.735 USD	11,12 USD	56.873.267 USD	10,47 USD	62.361 USD	11,28 USD
31 de diciembre de 2020	195.013 USD	10,91 USD	56.192.453 USD	10,35 USD	24.338 USD	10,96 USD

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund

Periodo finalizado el	Clase de reparto (mensual) A AUD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A AUD 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 P CHF Valor liquidativo	Clase de reparto P CHF Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	10.743.887 AUD	9,84 AUD	60.354.908 CHF	11,32 CHF	3.933.983 CHF	10,80 CHF
31 de diciembre de 2020	10.562.365 AUD	10,00 AUD	35.615.361 CHF	11,23 CHF	3.398.551 CHF	10,87 CHF

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (cont.)

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	36.523.630 €	9,93 €	163.186.534 €	12,22 €	458.925.301 €	12,92 €
31 de diciembre de 2020	25.060.595 €	10,07 €	119.052.117 €	12,15 €	373.859.916 €	12,81 €

Periodo 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 2021	102.497.376 €	10,99 €	271.014.729 €	11,90 €	182.278.027 €	10,02 €
31 de diciembre de 2020	169.145.788 €	11,04 €	320.540.521 €	11,79 €	24.646 €	10,01 €

Periodo finalizado el	Clase de acumulación I3 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación 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 2021	1.434.064 €	12,01 €	109.363.040 €	13,15 €	12.495.948 €	12,95 €
31 de diciembre de 2020	983.596 €	11,89 €	57.014.024 €	13,01 €	13.262.489 €	12,91 €

Periodo 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 reparto P EUR Valor liquidativo	Clase de reparto P EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	5.328.904 €	9,58 €	185.295.595 €	11,50 €	12.773.323 €	11,04 €
31 de diciembre de 2020	4.729.002 €	9,72 €	89.119.718 €	11,39 €	8.459.670 €	11,09 €

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (cont.)

Periodo 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 2021	6.997.913 £	12,08 £	60.782.583 £	11,88 £	2.792.299 £	10,91 £
31 de diciembre de 2020	3.925.010 £	11,94 £	59.705.060 £	11,73 £	2.213.285 £	10,93 £

Periodo finalizado el	Clase de acumulación P GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación P GBP Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto P GBP Valor liquidativo	Clase de reparto P 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 2021	5.827.564 £	10,86 £	7.405.509 £	10,55 £	4.431.079 HKD	9,86 HKD
31 de diciembre de 2020	2.276.020 £	10,73 £	4.230.115 £	10,56 £	3.506.390 HKD	10,02 HKD

Periodo 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 2021	4.165.719 SGD	19,95 SGD	86.777.476 USD	10,23 USD	73.802.113 USD	12,85 USD
31 de diciembre de 2020	3.198.132 SGD	20,23 SGD	71.163.061 USD	10,39 USD	65.345.286 USD	12,72 USD

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	30.133 USD	10,04 USD	12.908.237 USD	11,28 USD	215.996.635 USD	14,07 USD
31 de diciembre de 2020	–	–	12.294.801 USD	11,22 USD	194.815.607 USD	13,89 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (cont.)

Periodo 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 2021	135.562 USD	10,05 USD	77.527.696 USD	13,11 USD	1.674.677 USD	11,54 USD
31 de diciembre de 2020	–	–	72.424.407 USD	12,93 USD	1.285.824 USD	11,55 USD

Periodo 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 P USD Valor liquidativo	Clase de acumulación P USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	19.005.596 USD	11,45 USD	2.984.960 USD	10,09 USD	95.832.322 USD	12,53 USD
31 de diciembre de 2020	19.198.032 USD	11,37 USD	3.166.034 USD	10,20 USD	44.062.765 USD	12,36 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	3.833.583 USD	13,37 USD
31 de diciembre de 2020	4.176.275 USD	13,16 USD

Neuberger Berman US Equity Fund

Periodo 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 2021	817.419 USD	17,33 USD	1.251.212 USD	25,33 USD	5.727.032 USD	25,14 USD
31 de diciembre de 2020	871.353 USD	15,53 USD	517.631 USD	22,61 USD	5.110.788 USD	22,44 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund

Periodo finalizado el	Clase de acumulación Z (PF) EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación Z (PF) 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 2021	24.510.334 €	12,23 €	32.856.257 USD	12,78 USD	424.043 USD	10,99 USD
31 de diciembre de 2020	24.022.813 €	11,85 €	11.928.181 USD	12,39 USD	458.711 USD	10,71 USD

Periodo 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 reparto M USD Valor liquidativo	Clase de reparto M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	118.413 USD	13,31 USD	61.251 USD	11,14 USD	1.597.043 USD	9,62 USD
31 de diciembre de 2020	5.528.823 USD	12,87 USD	59.581 USD	10,83 USD	1.576.353 USD	9,63 USD

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	13.800 USD	12,07 USD	10.698 USD	10,70 USD	15.022.062 USD	13,70 USD
31 de diciembre de 2020	13.341 USD	11,67 USD	10.324 USD	10,32 USD	14.453.332 USD	13,21 USD

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund

Periodo 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 2021	4.643.364 €	10,21 €	24.533 £	10,69 £	931.288 USD	11,73 USD
31 de diciembre de 2020	9.157.786 €	10,07 €	24.125 £	10,51 £	912.261 USD	11,54 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

Periodo 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 2021	341.025 USD	10,78 USD	16.924.298 USD	12,44 USD	10.605.877 USD	11,26 USD
31 de diciembre de 2020	317.391 USD	10,67 USD	16.570.999 USD	12,22 USD	5.596.724 USD	11,21 USD

Periodo 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 Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	26.888.974 USD	11,76 USD	936.977 USD	10,71 USD	34.001.881 USD	11,40 USD
31 de diciembre de 2020	27.033.566 USD	11,55 USD	835.308 USD	10,57 USD	35.324.358 USD	11,17 USD

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund

Periodo 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 acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	37.699 €	9,70 €	463.029 €	10,74 €	243.496 €	10,33 €
31 de diciembre de 2020	25.728 €	9,62 €	443.312 €	10,29 €	240.276 €	9,98 €

Periodo finalizado el	Clase de reparto M EUR Valor liquidativo	Clase de reparto M EUR Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto P GBP* Valor liquidativo	Clase de reparto 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 2021	72.669 €	8,78 €	23.505 £	10,08 £	5.572.356 USD	11,55 USD
31 de diciembre de 2020	35.991 €	8,68 €	23.159 £	9,93 £	4.990.572 USD	11,05 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

Periodo 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 2021	3.487.949 USD	11,23 USD	7.082.051 USD	12,84 USD	198.402 USD	10,59 USD
31 de diciembre de 2020	3.921.269 USD	10,80 USD	5.774.974 USD	12,25 USD	181.194 USD	10,42 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	2.003.864 USD	11,37 USD
31 de diciembre de 2020	2.390.101 USD	10,93 USD

Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund

Periodo finalizado el	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I 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 M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	470.494 €	12,75 €	2.441.395 €	12,66 €	371.332 €	11,98 €
31 de diciembre de 2020	578.808 €	11,47 €	2.283.617 €	11,37 €	379.769 €	10,85 €

Periodo 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 I3 GBP* Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I3 GBP* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I4 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I4 GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	36.799.258 £	12,49 £	22.512 £	10,62 £	519.061 £	13,10 £
31 de diciembre de 2020	2.264.100 £	11,30 £	–	–	1.525.880 £	11,74 £

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund (cont.)

Periodo 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 (mensual) A SGD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) A SGD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	116.109.193 £	12,87 £	9.142 £	11,61 £	162.824 SGD	21,47 SGD
31 de diciembre de 2020	71.330.624 £	11,63 £	8.356 £	10,61 £	96.158 SGD	19,67 SGD

Periodo 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 reparto (mensual) I USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	39.258.959 USD	13,93 USD	281.305 USD	12,34 USD	2.702.065 USD	11,84 USD
31 de diciembre de 2020	10.464.313 USD	12,51 USD	163.028 USD	11,14 USD	3.477.576 USD	10,81 USD

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación I4 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I4 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	54.156.897 USD	14,47 USD	10.907 USD	12,85 USD	33.352.026 USD	13,99 USD
31 de diciembre de 2020	33.288.245 USD	12,96 USD	784.509 USD	11,50 USD	32.287.784 USD	12,51 USD

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	782.489 USD	13,28 USD	12.771 USD	12,81 USD	33.023.434 USD	14,51 USD
31 de diciembre de 2020	995.139 USD	11,97 USD	11.432 USD	11,47 USD	16.239.539 USD	12,95 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Global Equity Index PutWrite Fund

Periodo finalizado el	Clase de acumulación I5 CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto I5 CHF Valor liquidativo	Clase de reparto I5 CHF 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 2021	869.836 CHF	11,19 CHF	1.182.382 CHF	9,85 CHF	185.592 €	10,91 €
31 de diciembre de 2020	2.160.336 CHF	10,38 CHF	2.034.922 CHF	9,32 CHF	176.224 €	10,12 €

Periodo 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 2021	903.788 €	11,36 €	356.418 €	10,55 €	1.255.396 €	10,96 €
31 de diciembre de 2020	5.084.335 €	10,53 €	398.044 €	9,86 €	1.266.613 €	10,19 €

Periodo 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 acumulación A USD Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	385.555 €	11,47 €	57.779 £	11,49 £	84.656 USD	12,02 USD
31 de diciembre de 2020	354.622 €	10,60 €	73.809 £	10,63 £	88.794 USD	11,13 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto (mensual) I5 USD Valor liquidativo	Clase de reparto (mensual) I5 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 2021	375.630 USD	12,45 USD	505.809 USD	10,64 USD	4.491.201 USD	12,47 USD
31 de diciembre de 2020	346.806 USD	11,49 USD	931.297 USD	10,01 USD	5.859.514 USD	11,49 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Global Equity Index PutWrite Fund (cont.)

Periodo finalizado el	Clase de reparto I5 USD Valor liquidativo	Clase de reparto I5 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	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	110.789 USD	11,08 USD	16.475 USD	10,30 USD	802.797 USD	12,06 USD
31 de diciembre de 2020	135.441 USD	10,42 USD	15.554 USD	9,72 USD	1.118.898 USD	11,16 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	4.826.629 USD	12,52 USD
31 de diciembre de 2020	6.767.741 USD	11,52 USD

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund

Periodo finalizado el	Clase de acumulación I CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación I CHF Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I5 CHF Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 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 2021	3.802.089 CHF	9,63 CHF	467.559 CHF	9,95 CHF	62.231.519 €	9,46 €
31 de diciembre de 2020	3.621.121 CHF	9,88 CHF	478.745 CHF	10,19 CHF	18.773.059 €	9,73 €

Periodo 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 I5 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	252.860.386 €	9,77 €	11.231.567 €	10,06 €	8.206.409 €	10,18 €
31 de diciembre de 2020	155.102.495 €	10,01 €	10.927.245 €	10,30 €	8.369.670 €	10,41 €

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Periodo finalizado el	Clase de acumulación M EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación 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 acumulación I2 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación I2 GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	848.687 €	9,35 €	69.477.185 £	10,48 £	465.828.624 £	10,49 £
31 de diciembre de 2020	1.212.616 €	9,66 €	70.143.561 £	10,70 £	421.726.144 £	10,71 £

Periodo 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 2021	123.027.064 £	10,62 £	394.590.571 £	10,14 £	340.509 £	10,81 £
31 de diciembre de 2020	123.682.944 £	10,83 £	281.766.781 £	10,36 £	399.533 £	11,00 £

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación C1 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	66.258 SGD	20,25 SGD	46.825.557 USD	10,16 USD	11.524.572 USD	9,88 USD
31 de diciembre de 2020	72.982 SGD	20,74 SGD	55.440.121 USD	10,41 USD	15.414.288 USD	10,17 USD

Periodo 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 I5 USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	159.133.343 USD	10,91 USD	63.113.403 USD	10,92 USD	18.951.192 USD	11,07 USD
31 de diciembre de 2020	96.977.902 USD	11,13 USD	57.656.240 USD	11,14 USD	16.190.315 USD	11,28 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (cont.)

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	10.987.095 USD	10,15 USD	6.792.309 USD	10,61 USD	202.394 USD	11,10 USD
31 de diciembre de 2020	13.755.477 USD	10,44 USD	40.496.426 USD	10,83 USD	2.972.232 USD	11,28 USD

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund

Periodo 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 I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	25.233.306 AUD	9,96 AUD	89.950.432 NOK	117,00 NOK	3.106.887 USD	12,24 USD
31 de diciembre de 2020	–	–	6.494.974 NOK	121,36 NOK	3.228.650 USD	12,70 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación I2 USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación 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 Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	4.782.449 USD	10,18 USD	30.322 USD	12,36 USD	4.230.292 USD	12,12 USD
31 de diciembre de 2020	–	–	31.411 USD	12,81 USD	4.695.328 USD	12,54 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Emerging Market Sustainable Equity Fund

Periodo 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 I JPY Valor liquidativo	Clase de acumulación sin cobertura I JPY 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 2021	9.258.090 €	11,57 €	1.787.574.347 ¥	1.383,10 ¥	120.044.880 USD	13,06 USD
31 de diciembre de 2020	6.332.987 €	10,55 €	1.566.429.931 ¥	1.210,66 ¥	112.597.718 USD	12,29 USD

Periodo finalizado el	Clase de reparto I USD Valor liquidativo	Clase de reparto 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 2021	36.884 USD	12,80 USD	254.994 USD	12,53 USD
31 de diciembre de 2020	34.860 USD	12,10 USD	22.690.705 USD	11,77 USD

Neuberger Berman Global Thematic Equity Fund

Periodo 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 2021	1.891.506 €	15,38 €	24.261.585 USD	15,33 USD	5.378.137 USD	14,87 USD
31 de diciembre de 2020	507.201 €	12,13 €	14.689.207 USD	12,42 USD	4.209.720 USD	12,10 USD

Periodo 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
30 de junio de 2021	6.316.967 USD	15,84 USD	16.821.003 USD	14,86 USD
31 de diciembre de 2020	1.860.540 USD	12,76 USD	6.229.691 USD	12,10 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman CLO Income Fund

Periodo finalizado el	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	Clase de reparto I2 GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I2 GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	1.810.685 €	10,96 €	6.532.960 €	9,24 €	30.677.790 £	9,34 £
31 de diciembre de 2020	1.209.793 €	10,52 €	6.264.914 €	9,06 €	14.791.942 £	9,12 £

Periodo finalizado el	Clase de reparto I5 GBP Valor liquidativo	Clase de reparto I5 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 I SEK Valor liquidativo	Clase de acumulación I SEK Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	25.981 £	9,35 £	80.376 £	11,26 £	56.716.076 SEK	110,61 SEK
31 de diciembre de 2020	25.380 £	9,13 £	76.579 £	10,73 £	43.276.367 SEK	105,94 SEK

Periodo finalizado el	Clase de acumulación I USD Valor liquidativo	Clase de acumulación I 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 reparto USD I4* Valor liquidativo	Clase de reparto I4 USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	34.825.162 USD	11,70 USD	20.477.432 USD	10,35 USD	–	–
31 de diciembre de 2020	17.846.790 USD	11,18 USD	10.111.392 USD	10,11 USD	27.012.939 USD	10,37 USD

Periodo finalizado el	Clase de reparto I5 USD Valor liquidativo	Clase de reparto I5 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 2021	26.560.129 USD	9,85 USD	428.303 USD	11,92 USD
31 de diciembre de 2020	25.341.231 USD	9,62 USD	407.835 USD	11,35 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund

Periodo 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 2021	176.970 €	15,28 €	2.454.312 €	10,66 €	23.856.360 €	14,97 €
31 de diciembre de 2020	140.785 €	13,62 €	–	–	7.751.362 €	12,80 €

Periodo 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 2021	28.747.702 €	17,97 €	24.456.648 USD	16,44 USD	4.480.679 USD	18,03 USD
31 de diciembre de 2020	14.972.550 €	15,49 €	13.736.898 USD	14,57 USD	2.585.658 USD	16,06 USD

Periodo 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 2021	14.731.539 USD	16,41 USD	8.493.662 USD	16,40 USD	10.836.071 USD	18,10 USD
31 de diciembre de 2020	8.318.637 USD	14,48 USD	19.776.005 USD	14,47 USD	1.282.877 USD	16,11 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo	Clase de acumulación X USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	52.375.943 USD	19,38 USD
31 de diciembre de 2020	3.832.201 USD	17,16 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Ultra Short Term EUR o Bond Fund

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	1.835.741 CHF	103,17 CHF	24.653 €	99,96 €	380.196.185 €	105,11 €
31 de diciembre de 2020	2.074.998 CHF	102,25 CHF	–	–	188.117.143 €	104,00 €

Periodo 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 acumulación I5 EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 EUR Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	462.584 €	103,20 €	57.752.246 €	103,79 €	210.431.077 €	105,32 €
31 de diciembre de 2020	452.987 €	102,78 €	57.134.292 €	102,68 €	147.478.945 €	104,17 €

Periodo finalizado el	Clase de acumulación U EUR Valor liquidativo	Clase de acumulación U 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 acumulación M USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación M USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	5.073.699 €	103,46 €	767.077 €	105,80 €	–	–
31 de diciembre de 2020	384.498 €	102,42 €	282.469 €	104,59 €	31.060 USD	104,76 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	50.949.927 USD	110,71 USD
31 de diciembre de 2020	51.631.863 USD	109,03 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman EUR o Opportunistic Bond Fund

Periodo 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
30 de junio de 2021	35.133 €	11,71 €	11.177.150 €	11,42 €
31 de diciembre de 2020	35.080 €	11,69 €	11.227.544 €	11,47 €

Neuberger Berman EUR o Bond Absolute Return Fund

Periodo 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 2021	3.461.058 €	10,92 €	14.745.796 €	10,70 €	17.912.608 €	10,91 €
31 de diciembre de 2020	1.428.954 €	10,69 €	14.505.424 €	10,53 €	17.603.374 €	10,67 €

Periodo finalizado el	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	14.359.735 USD	10,92 USD
31 de diciembre de 2020	13.968.385 USD	10,62 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Multi-Style Premia Fund**

Periodo 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 Z USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	-	-	-	-	-	-
31 de diciembre de 2020	23.772 USD	7,92 USD	8.619.709 USD	7,86 USD	908.272 USD	7,58 USD

** La Cartera se liquidó el 24 de febrero de 2021.

Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund

Periodo 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 GBP Valor liquidativo	Clase de acumulación Z GBP Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	649.682 €	9,75 €	27.577 €	10,03 €	166.834 £	9,95 £
31 de diciembre de 2020	407.052 €	9,70 €	27.574 €	10,03 €	354.315 £	9,84 £

Periodo finalizado el	Clase de acumulación I SEK Valor liquidativo	Clase de acumulación I SEK Valor liquidativo de la Acción	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
30 de junio de 2021	80.726.058 SEK	98,11 SEK	276.562 SEK	97,74 SEK	10.758 USD	9,95 USD
31 de diciembre de 2020	5.339.313 SEK	97,37 SEK	275.530 SEK	97,37 SEK	29.604 USD	9,87 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund (cont.)

Periodo 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 2021	17.806.181 USD	10,02 USD	9.523.291 USD	10,05 USD
31 de diciembre de 2020	21.083.766 USD	9,91 USD	9.409.030 USD	9,93 USD

Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund¹

Periodo 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 X USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación X USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	10.547 USD	10,55 USD	14.677.692 USD	10,07 USD	10.356 USD	10,36 USD
31 de diciembre de 2020	10.335 USD	10,33 USD	14.648.526 USD	10,05 USD	10.128 USD	10,13 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación Y USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación Y USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	3.055.209 USD	10,18 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman 5G Connectivity Fund¹

Periodo finalizado el	Clase de acumulación A AUD* Valor liquidativo	Clase de acumulación A AUD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación A CNY* Valor liquidativo	Clase de acumulación A 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 2021	42.330.819 AUD	14,96 AUD	4.575.064 CNY	100,99 CNY	126.099.784 €	15,61 €
31 de diciembre de 2020	24.050.713 AUD	14,24 AUD	–	–	57.903.811 €	14,88 €

Periodo 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 2021	84.748.978 €	15,04 €	102.386.631 €	14,31 €	73.691.095 €	14,33 €
31 de diciembre de 2020	44.220.145 €	13,81 €	24.110.964 €	13,58 €	16.612.665 €	13,10 €

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación A GBP* Valor liquidativo	Clase de acumulación A GBP* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	743.057 €	12,83 €	66.735.803 €	14,89 €	21.709.153 £	15,63 £
31 de diciembre de 2020	607.688 €	12,15 €	31.520.780 €	13,73 €	11.273.925 £	14,84 £

Periodo 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 A HKD* Valor liquidativo	Clase de acumulación A 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 2021	1.018.147 £	12,02 £	143.379.179 HKD	15,85 HKD	103.173.556 SGD	31,39 SGD
31 de diciembre de 2020	26.667 £	11,46 £	68.030.088 HKD	15,03 HKD	61.243.815 SGD	29,80 SGD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman 5G Connectivity Fund¹ (cont.)

Periodo 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 2021	1.107.843.165 USD	16,32 USD	440.542.051 USD	17,30 USD	52.850.633 USD	17,29 USD
31 de diciembre de 2020	665.216.837 USD	15,46 USD	244.969.849 USD	16,32 USD	23.717.213 USD	16,31 USD

Periodo finalizado el	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	Clase de acumulación I5 USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	10.980.065 USD	11,02 USD	135.542.886 USD	11,71 USD	40.097.039 USD	15,93 USD
31 de diciembre de 2020	–	–	45.096.460 USD	11,03 USD	32.102.331 USD	15,00 USD

Periodo finalizado el	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 2021	142.896.175 USD	14,57 USD	1.266.174 USD	10,89 USD
31 de diciembre de 2020	107.572.681 USD	13,86 USD	–	–

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund¹

Periodo finalizado el	Clase de acumulación I JPY* Valor liquidativo	Clase de acumulación I JPY* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto JPY I* Valor liquidativo	Clase de reparto JPY I* Valor liquidativo de la Acción	Clase de acumulación I5 JPY* Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 JPY* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	23.250.430 ¥	1.661,51 ¥	825.776.133 ¥	1.661,52 ¥	3.015.730.098 ¥	10.680,15 ¥
31 de diciembre de 2020	4.452.826 ¥	1.484,28 ¥	737.686.416 ¥	1.484,28 ¥	–	–

Periodo finalizado el	Clase de acumulación Z JPY* Valor liquidativo	Clase de acumulación Z JPY* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	129.437.763 ¥	1.043,50 ¥

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund¹

Periodo 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 I5 EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación I5 EUR* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	15.605.302 CAD	10,40 CAD	3.530.022 €	11,09 €	2.455.543 €	11,46 €
31 de diciembre de 2020	–	–	3.640.342 €	10,77 €	23.086.291 €	11,12 €

Periodo finalizado el	Clase de acumulación M EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación M 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 A USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación A USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	213.890 €	10,82 €	412.927.834 £	11,72 £	459.641 USD	10,93 USD
31 de diciembre de 2020	53.198 €	10,58 €	414.183.815 £	11,33 £	10.611 USD	10,61 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund¹ (cont.)

Periodo 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 2021	135.032 USD	11,73 USD	88.130 USD	11,35 USD	841.365 USD	10,86 USD
31 de diciembre de 2020	34.034 USD	11,34 USD	87.022 USD	11,21 USD	10.586 USD	10,59 USD

Periodo finalizado el	Clase de acumulación Z USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación Z USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	10.991.858 USD	11,80 USD
31 de diciembre de 2020	10.601.478 USD	11,38 USD

Neuberger Berman Global Diversified Income FMP – 2024¹

Periodo 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 reparto I EUR* Valor liquidativo	Clase de reparto I EUR* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	1.279.995 €	10,47 €	255.738 €	10,23 €	1.010.727 €	10,11 €
31 de diciembre de 2020	2.848.113 €	10,46 €	261.930 €	10,48 €	1.034.112 €	10,34 €

Periodo finalizado el	Clase de reparto I GBP* Valor liquidativo	Clase de reparto I GBP* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto A HKD* Valor liquidativo	Clase de reparto A HKD* Valor liquidativo de la Acción	Clase de reparto A SGD* Valor liquidativo	Clase de reparto A SGD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	2.744.061 £	10,28 £	7.638.861 HKD	10,19 HKD	5.607.075 SGD	20,56 SGD
31 de diciembre de 2020	2.910.009 £	10,51 £	7.784.792 HKD	10,38 HKD	5.725.831 SGD	21,00 SGD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Global Diversified Income FMP – 2024¹ (cont.)

Periodo 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 2021	37.472.369 USD	10,57 USD	57.493.112 USD	10,29 USD	6.144.837 USD	10,61 USD
31 de diciembre de 2020	41.650.016 USD	10,51 USD	66.360.371 USD	10,51 USD	6.095.383 USD	10,53 USD

Periodo 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 2021	6.113.055 USD	10,29 USD	22.330.110 USD	10,61 USD	110.988.844 USD	10,29 USD
31 de diciembre de 2020	6.252.478 USD	10,53 USD	22.155.888 USD	10,53 USD	113.502.504 USD	10,53 USD

Neuberger Berman China A-Share Equity Fund¹

Periodo 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 2021	828.947 CNY	123,93 CNY	595.173 USD	13,44 USD	3.359.425 USD	13,43 USD
31 de diciembre de 2020	81.330 CNY	118,25 CNY	1.227.199 USD	12,75 USD	1.249.390 USD	12,75 USD

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman EUR Sustainable Equity Fund²

Periodo 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 M EUR* Valor liquidativo	Clase de acumulación M EUR* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	2.220.052 €	11,46 €	4.699.172 €	11,46 €	18.800 €	11,40 €

Periodo 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 2021	218.753 €	11,38 €	11.371 USD	11,37 USD	11.401 USD	11,40 USD

Periodo 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 2021	11.346 USD	11,35 USD

Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund²

Periodo 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 2021	12.328.305 €	11,50 €	28.691 €	11,42 €	1.214.542 €	11,05 €

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

9. COMPARATIVA DEL PATRIMONIO NETO Y DEL VALOR LIQUIDATIVO (CONT.)

Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund² (cont.)

Periodo 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 I USD* Valor liquidativo	Clase de acumulación I USD* Valor liquidativo de la Acción
30 de junio de 2021	7.870 £	10,90 £	7.875 £	10,91 £	385.190 USD	11,24 USD

Periodo finalizado el	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 2021	5.584.974 USD	11,24 USD	11.127 USD	11,13 USD

* Clase de Acciones lanzada o cerrada durante el actual período contable o el ejercicio anterior.

¹ Cartera lanzada durante el ejercicio contable anterior.

² Cartera lanzada durante el actual período contable.

CORRESPONDIENTE AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021**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.

Para determinar lo que es “observable”, el Consejo de administración debe aplicar sus criterios previa consulta con el Gestor de inversiones.

El valor de las inversiones de las Carteras en valores de renta variable, fondos cotizados, acciones preferentes 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 ofrece este mercado 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 asociada, 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 suelen incluir datos de valores subyacentes, primas de conversión, previos 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.

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021**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.

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).

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 contratos por diferencias ("CFD") se determina principalmente obteniendo valoraciones de servicios independientes de fijación de precios, que se basan en referencias al activo subyacente y el tipo de referencia indicado (datos de Nivel 2).

El valor de los swaps de varianza y volatilidad se determina principalmente obteniendo las valoraciones de servicios independientes de fijación de precios y se basa en los datos de varianza y volatilidad tanto históricos materializados como futuros previstos del activo de referencia (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 valores cotizados adquiridos a través de una operación de inversión privada en renta variable pública (PIPE) normalmente se valoran a un precio de descuento con respecto al precio de mercado de las acciones ordinarias de un emisor. Los descuentos se aplican debido a determinadas restricciones de negociación impuestas o a la falta de capacidad de comercialización previa a la conversión de los valores cotizados. Los datos primarios empleados para determinar el descuento son la duración del período de tiempo de bloqueo y la volatilidad del valor subyacente (datos de Nivel 2).

El Gestor de inversiones ha desarrollado un proceso para revisar periódicamente la información que suministran los servicios independientes de fijación de precios para todo tipo de valores.

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021**10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)****Valor razonable de las inversiones (cont.)**

Las inversiones en empresas de inversión no cotizadas con un valor razonable que pueda determinarse fácilmente se valoran empleando el valor liquidativo de la acción (el "Valor liquidativo") diario del fondo respectivo (datos de Nivel 2).

Si no hay una valoración disponible de un servicio independiente de fijación de precios, o si el Gestor de inversiones tiene 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, el Gestor de inversiones 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 de forma inmediata, 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 del título; 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") abre para desarrollar su actividad habitual. El Consejo de administración ha aprobado el uso de ICE Data Services ("ICE") para ayudar a determinar el valor razonable de valores de renta variable extranjeros cuando los cambios del valor de determinados índices sugieran que los precios de cierre en dichas divisas ya no representan el importe que una Cartera podría esperar recibir 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 el uso de 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 renta variable extranjera y valores 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, el Consejo de administración ha decidido, basándose en los datos disponibles, que es probable que los precios ajustados o evaluados de este modo se acerquen más a los precios que podría obtener un Fondo en 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, o que se aproxime a él.

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

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.

Neuberger Berman High Yield Bond Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	–	17.314.028	–	17.314.028
Bonos de empresa	–	2.925.124.214	–	2.925.124.214
Fondos de inversión	30.771.389	5.427.788	–	36.199.177
Préstamos a plazo	–	123.650.180	6.854.218	130.504.398
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	10.563.969	–	10.563.969
Plusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	–	647.530	–	647.530
Total	30.771.389	3.082.727.709	6.854.218	3.120.353.316

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(12.699.599)	–	(12.699.599)
Total	–	(12.699.599)	–	(12.699.599)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	3.251.196.665	–	3.251.196.665
Fondos de inversión	28.233.977	5.234.595	–	33.468.572
Préstamos a plazo	–	128.792.119	12.141.202	140.933.321
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	100.035.551	–	100.035.551
Plusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	–	899.832	–	899.832
Total	28.233.977	3.486.158.762	12.141.202	3.526.533.941

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(21.902.140)	–	(21.902.140)
Total	–	(21.902.140)	–	(21.902.140)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Diversified Currency Fund*

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	517.360	–	517.360
Total	–	517.360	–	517.360

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(502.532)	–	(502.532)
Total	–	(502.532)	–	(502.532)

*La Cartera se liquidó el 22 de enero de 2021.

Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	703.070.395	–	–	703.070.395
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	425.833	–	425.833
Total	703.070.395	425.833	–	703.496.228

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(549.822)	–	(549.822)
Total	–	(549.822)	–	(549.822)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	609.124.055	–	–	609.124.055
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	2.855.824	–	2.855.824
Total	609.124.055	2.855.824	–	611.979.879

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (cont.)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.008.002)	–	(1.008.002)
Total	–	(1.008.002)	–	(1.008.002)

Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	10.432.467	–	–	10.432.467
Fondos de inversión inmobiliaria	641.572.662	–	–	641.572.662
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	998.003	–	998.003
Total	652.005.129	998.003	–	653.003.132

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.966.646)	–	(1.966.646)
Total	–	(1.966.646)	–	(1.966.646)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	6.294.335	–	–	6.294.335
Fondos de inversión inmobiliaria	338.529.094	–	–	338.529.094
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	4.286.899	–	4.286.899
Total	344.823.429	4.286.899	–	349.110.328

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.306.305)	–	(1.306.305)
Total	–	(1.306.305)	–	(1.306.305)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman China Equity Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	683.750.100	–	–	683.750.100
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	134.019	–	134.019
Total	683.750.100	134.019	–	683.884.119

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(218.645)	–	(218.645)
Total	–	(218.645)	–	(218.645)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	181.048.766	520.036.835	–	701.085.601
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	827.194	–	827.194
Total	181.048.766	520.864.029	–	701.912.795

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(452.722)	–	(452.722)
Total	–	(452.722)	–	(452.722)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	518.891.558	16.446.585	–	535.338.143
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	462.252	–	462.252
Total	518.891.558	16.908.837	–	535.800.395

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(537.755)	–	(537.755)
Total	–	(537.755)	–	(537.755)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	124.950.417	352.146.276	–	477.096.693
Participatory notes	1.801.986	–	–	1.801.986
Fondos de inversión inmobiliaria	–	3.055.157	–	3.055.157
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	2.071.887	–	2.071.887
Total	126.752.403	357.273.320	–	484.025.723

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.018.184)	–	(1.018.184)
Total	–	(1.018.184)	–	(1.018.184)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman US Small Cap Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	786.353.844	4.086.486	–	790.440.330
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	564.471	–	564.471
Total	786.353.844	4.650.957	–	791.004.801

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(724.499)	–	(724.499)
Total	–	(724.499)	–	(724.499)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	580.015.872	1.971.196	–	581.987.068
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	659.502	–	659.502
Total	580.015.872	2.630.698	–	582.646.570

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(216.246)	–	(216.246)
Total	–	(216.246)	–	(216.246)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	590.052.572	–	590.052.572
Fondos de inversión	2.313.056	–	–	2.313.056
Préstamos a plazo	–	48.631.090	4.370.232	53.001.322
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	988.775	–	988.775
Total	2.313.056	639.672.437	4.370.232	646.355.725

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(5.619.042)	–	(5.619.042)
Total	–	(5.619.042)	–	(5.619.042)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	785.484.718	–	785.484.718
Fondos de inversión	2.122.321	–	–	2.122.321
Préstamos a plazo	–	80.429.490	3.861.078	84.290.568
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	20.802.409	–	20.802.409
Total	2.122.321	886.716.617	3.861.078	892.700.016

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(3.224.432)	–	(3.224.432)
Total	–	(3.224.432)	–	(3.224.432)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Global Bond Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de agencias	–	2.826.889	–	2.826.889
Valores respaldados por activos	–	16.578.471	–	16.578.471
Bonos de empresa	–	71.046.756	–	71.046.756
Bonos del Estado	–	102.165.234	–	102.165.234
Valores respaldados por hipotecas	–	28.171.854	–	28.171.854
Bonos del Tesoro	–	1.899.621	–	1.899.621
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	1.320.813	–	1.320.813
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	154.178	–	–	154.178
Plusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	8.937	–	8.937
Total	154.178	224.018.575	–	224.172.753

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.627.095)	–	(1.627.095)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(964.467)	–	–	(964.467)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	(33.394)	–	(33.394)
Total	(964.467)	(1.660.489)	–	(2.624.956)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de agencias	–	2.921.579	–	2.921.579
Valores respaldados por activos	–	17.064.747	–	17.064.747
Bonos de empresa	–	71.418.732	–	71.418.732
Bonos del Estado	–	130.640.678	–	130.640.678
Valores respaldados por hipotecas	–	38.877.565	–	38.877.565
Bonos del Tesoro	–	1.899.489	–	1.899.489
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	3.505.563	–	3.505.563
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	267.222	–	–	267.222
Plusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	13.633	–	13.633
Total	267.222	266.341.986	–	266.609.208

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Global Bond Fund (continued)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(3.495.541)	–	(3.495.541)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(324.024)	–	–	(324.024)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	(41.957)	–	(41.957)
Total	(324.024)	(3.537.498)	–	(3.861.522)

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Certificado de depósito	–	1.503.938	–	1.503.938
Bonos de empresa	–	55.510.934	–	55.510.934
Bonos del Estado	–	2.274.633.510	–	2.274.633.510
Fondos de inversión	–	19.317.150	–	19.317.150
Bonos del Tesoro	–	58.904.800	–	58.904.800
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	44.531.238	–	44.531.238
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	253.444	–	–	253.444
Plusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	14.835.045	–	14.835.045
Total	253.444	2.469.236.615	–	2.469.490.059

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(37.615.421)	–	(37.615.421)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(254.681)	–	–	(254.681)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	(23.149.062)	–	(23.149.062)
Total	(254.681)	(60.764.483)	–	(61.019.164)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	105.161.868	–	105.161.868
Bonos del Estado	–	2.599.905.190	–	2.599.905.190
Fondos de inversión	–	19.095.750	–	19.095.750
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	42.275.179	–	42.275.179
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	282.652	–	–	282.652
Plusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	62.387.937	–	62.387.937
Plusvalía latente sobre contratos de swaps multdivisas	–	390.826	–	390.826
Total	282.652	2.829.216.750	–	2.829.499.402

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(24.402.888)	–	(24.402.888)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(49.513)	–	–	(49.513)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	(20.840.044)	–	(20.840.044)
Total	(49.513)	(45.242.932)	–	(45.292.445)

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	1.337.282.094	–	1.337.282.094
Bonos del Estado	–	2.725.893.602	–	2.725.893.602
Fondos de inversión	–	16.606.500	–	16.606.500
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	18.570.619	–	18.570.619
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	9.166.344	–	–	9.166.344
Total	9.166.344	4.098.352.815	–	4.107.519.159

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(55.049.835)	–	(55.049.835)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(5.515.485)	–	–	(5.515.485)
Total	(5.515.485)	(55.049.835)	–	(60.565.320)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	1.256.273.740	–	1.256.273.740
Bonos del Estado	–	2.492.346.498	–	2.492.346.498
Fondos de inversión	–	16.354.500	–	16.354.500
Bonos del Tesoro	–	24.998.680	–	24.998.680
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	22.396.189	–	22.396.189
Total	–	3.812.369.607	–	3.812.369.607

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(13.490.565)	–	(13.490.565)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(5.095.499)	–	–	(5.095.499)
Total	(5.095.499)	(13.490.565)	–	(18.586.064)

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	144.918.703	–	144.918.703
Bonos del Estado	–	3.704.240	–	3.704.240
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	329.293	–	329.293
Total	–	148.952.236	–	148.952.236

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(3.412.562)	–	(3.412.562)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(302.996)	–	–	(302.996)
Total	(302.996)	(3.412.562)	–	(3.715.558)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	152.782.444	–	152.782.444
Bonos del Estado	–	2.815.132	–	2.815.132
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	1.025.950	–	1.025.950
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	40.212	–	–	40.212
Total	40.212	156.623.526	–	156.663.738

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(189.888)	–	(189.888)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(12.374)	–	–	(12.374)
Total	(12.374)	(189.888)	–	(202.262)

Neuberger Berman Strategic Income Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de agencias	–	1.050.383	–	1.050.383
Valores respaldados por activos	–	88.120.888	–	88.120.888
Bonos de empresa	–	662.682.929	–	662.682.929
Bonos del Estado	–	145.312.448	–	145.312.448
Fondos de inversión	1.046.951	36.569.714	–	37.616.665
Valores respaldados por hipotecas	–	206.494.973	–	206.494.973
Bonos emitidos por organismos municipales	–	19.081.287	–	19.081.287
Préstamos a plazo	–	100.673.413	1.208.551	101.881.964
Bonos del Tesoro	–	8.098.383	–	8.098.383
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	1.527.251	–	1.527.251
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	442.064	–	–	442.064
Contratos de credit default swap al valor razonable	–	2.241.283	–	2.241.283
Plusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	157.837	–	157.837
Plusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	–	869.925	–	869.925
Total	1.489.015	1.272.880.714	1.208.551	1.275.578.280

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(7.177.358)	–	(7.177.358)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(4.851.190)	–	–	(4.851.190)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	(120.939)	–	(120.939)
Total	(4.851.190)	(7.298.297)	–	(12.149.487)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de agencias	–	1.094.749	–	1.094.749
Valores respaldados por activos	–	124.068.006	–	124.068.006
Bonos de empresa	–	617.513.789	–	617.513.789
Valores de renta variable	–	–	2.639	2.639
Bonos del Estado	–	105.061.980	–	105.061.980
Fondos de inversión	–	35.322.907	–	35.322.907
Valores respaldados por hipotecas	–	300.711.231	–	300.711.231
Bonos emitidos por organismos municipales	–	37.206.502	–	37.206.502
Préstamos a plazo	–	90.760.278	3.597.740	94.358.018
Bonos del Tesoro	–	10.826.485	–	10.826.485
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	10.937.578	–	10.937.578
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	1.386.688	–	–	1.386.688
Plusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	298.498	–	298.498
Plusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	–	1.104.055	–	1.104.055
Total	1.386.688	1.334.906.058	3.600.379	1.339.893.125

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.249.882)	–	(1.249.882)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(299.111)	–	–	(299.111)
Total	(299.111)	(1.249.882)	–	(1.548.993)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	4.501.315.572	–	4.501.315.572
Bonos del Estado	–	1.633.286.243	–	1.633.286.243
Fondos de inversión	–	33.213.000	–	33.213.000
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	10.700.497	–	10.700.497
Total	–	6.178.515.312	–	6.178.515.312

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(86.031.501)	–	(86.031.501)
Total	–	(86.031.501)	–	(86.031.501)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	4.156.187.268	–	4.156.187.268
Bonos del Estado	–	1.486.384.044	–	1.486.384.044
Fondos de inversión	–	32.709.000	–	32.709.000
Bonos del Tesoro	–	39.997.889	–	39.997.889
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	54.696.596	–	54.696.596
Total	–	5.769.974.797	–	5.769.974.797

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(6.117.658)	–	(6.117.658)
Total	–	(6.117.658)	–	(6.117.658)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	24.195.596	–	621.863	24.817.459
Participatory notes	2.223	–	–	2.223
Fondos de inversión inmobiliaria	270.464	–	–	270.464
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	307.174	–	307.174
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	288.584	–	–	288.584
Plusvalía latente sobre contratos por diferencias	–	1.272.863	–	1.272.863
Total	24.756.867	1.580.037	621.863	26.958.767

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Contratos de opciones sobre renta variable	(15)	–	–	(15)
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.540.822)	–	(1.540.822)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(32.739)	–	–	(32.739)
Minusvalía latente sobre contratos por diferencias	–	(1.657.673)	–	(1.657.673)
Total	(32.754)	(3.198.495)	–	(3.231.249)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	–	9.991.734	–	9.991.734
Bonos de empresa	–	33.390	–	33.390
Valores de renta variable	16.927.808	1.616.441	616.154	19.160.403
Participatory notes	4.080	–	–	4.080
Fondos de inversión inmobiliaria	332.225	–	–	332.225
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	1.614.143	–	1.614.143
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	67.407	–	–	67.407
Plusvalía latente sobre contratos por diferencias	–	1.569.623	–	1.569.623
Total	17.331.520	14.825.331	616.154	32.773.005

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (cont.)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(180.190)	–	(180.190)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(150.329)	–	–	(150.329)
Minusvalía latente sobre contratos por diferencias	–	(1.491.989)	–	(1.491.989)
Total	(150.329)	(1.672.179)	–	(1.822.508)

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	7.708.663	–	7.708.663
Valores de renta variable	421.457.530	709.384	–	422.166.914
Participatory notes	9.300	–	–	9.300
Contratos de opciones sobre renta variable adquiridas	199.072	–	1.800	200.872
Fondos de inversión inmobiliaria	3.100.632	–	–	3.100.632
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	772.442	–	772.442
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	36.477	–	–	36.477
Plusvalía latente sobre contratos por diferencias	–	854.338	–	854.338
Plusvalía latente total sobre inversión privada en renta variable pública – (PIPE)	–	2.713.336	–	2.713.336
Total	424.803.011	12.758.163	1.800	437.562.974

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Contratos de opciones sobre renta variable	(419.500)	–	(3.200)	(422.700)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	–	(18.439.679)	–	(18.439.679)
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(2.837.191)	–	(2.837.191)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(1.980.867)	–	–	(1.980.867)
Minusvalía latente sobre contratos por diferencias	–	(2.641.767)	–	(2.641.767)
Total	(2.400.367)	(23.918.637)	(3.200)	(26.322.204)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (continued)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	11.310.839	–	11.310.839
Valores de renta variable	333.354.890	–	–	333.354.890
Participatory notes	9.090	–	–	9.090
Contratos de opciones sobre renta variable adquiridas	970.337	–	–	970.337
Contratos de opciones adquiridas	17.370	–	–	17.370
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	6.519.159	–	6.519.159
Plusvalía latente sobre contratos por diferencias	–	764.914	–	764.914
Total	334.351.687	18.594.912	–	352.946.599

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Contratos de opciones sobre renta variable	(335.712)	–	(1.670)	(337.382)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	–	(8.484.006)	–	(8.484.006)
Contratos de opciones sobre índices suscritos	(8.730)	–	–	(8.730)
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo		(510.434)		(510.434)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(834.175)	–	–	(834.175)
Minusvalía latente sobre contratos por diferencias	–	(4.133.903)	–	(4.133.903)
Total	(1.178.617)	(13.128.343)	(1.670)	(14.308.630)

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	368.705.625	–	368.705.625
Bonos del Estado	–	736.863.164	–	736.863.164
Fondos de inversión	–	16.720.213	–	16.720.213
Bonos del Tesoro	–	18.431.185	–	18.431.185
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	16.489.472	–	16.489.472
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	469.897	–	–	469.897
Plusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	3.763.118	–	3.763.118
Total	469.897	1.160.972.777	–	1.161.442.674

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (continued)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(23.527.318)	–	(23.527.318)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(1.132.474)	–	–	(1.132.474)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	(6.372.236)	–	(6.372.236)
Total	(1.132.474)	(29.899.554)	–	(31.032.028)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	425.302.334	–	425.302.334
Bonos del Estado	–	969.305.063	–	969.305.063
Fondos de inversión	–	16.528.577	–	16.528.577
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	16.291.263	–	16.291.263
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	136.616	–	–	136.616
Contratos de credit default swap al valor razonable	–	1.210.775	–	1.210.775
Plusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	18.028.226	–	18.028.226
Plusvalía latente sobre contratos de swaps multidisvisas	–	94.161	–	94.161
Total	136.616	1.446.760.399	–	1.446.897.015

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(9.482.436)	–	(9.482.436)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(300.764)	–	–	(300.764)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	(5.508.076)	–	(5.508.076)
Total	(300.764)	(14.990.512)	–	(15.291.276)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman European High Yield Bond Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	–	419.764	–	419.764
Bonos de empresa	–	30.617.908	–	30.617.908
Préstamos a plazo	–	299.951	–	299.951
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	414.400	–	414.400
Total	–	31.752.023	–	31.752.023

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(207.571)	–	(207.571)
Total	–	(207.571)	–	(207.571)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	30.770.680	–	30.770.680
Préstamos a plazo	–	1.012.382	–	1.012.382
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	561.142	–	561.142
Total	–	32.344.204	–	32.344.204

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.491.943)	–	(1.491.943)
Total	–	(1.491.943)	–	(1.491.943)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	9.189.659	–	–	9.189.659
Fondos de inversión	906.453	–	–	906.453
Fondos de inversión inmobiliaria	187.239	–	–	187.239
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	15.967	–	15.967
Total	10.283.351	15.967	–	10.299.318

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(34.079)	–	(34.079)
Total	–	(34.079)	–	(34.079)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	4.933.257	2.380.422	0	7.313.679
Fondos de inversión	–	409.639	372.572	782.211
Fondos de inversión inmobiliaria	80.253	42.701	–	122.954
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	105.101	–	105.101
Total	5.013.510	2.937.863	372.572	8.323.945

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(62.308)	–	(62.308)
Total	–	(62.308)	–	(62.308)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	3.315.369	–	–	3.315.369
Fondos de inversión inmobiliaria	13.515.542	–	–	13.515.542
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	1.230	–	1.230
Total	16.830.911	1.230	–	16.832.141

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(19.668)	–	(19.668)
Total	–	(19.668)	–	(19.668)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	135.335	1.139.532	–	1.274.867
Fondos de inversión inmobiliaria	3.517.221	1.696.831	–	5.214.052
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	14.778	–	14.778
Total	3.652.556	2.851.141	–	6.503.697

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.674)	–	(1.674)
Total	–	(1.674)	–	(1.674)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	32.652	–	32.652
Valores de renta variable	136.698.335	–	–	136.698.335
Total	136.698.335	32.652	–	136.730.987

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	92.446.153	–	–	92.446.153
Total	92.446.153	–	–	92.446.153

Neuberger Berman Asian Debt - Hard Currency Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	16.086.490	–	16.086.490
Bonos del Estado	–	1.961.624	–	1.961.624
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	23.674	–	23.674
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	20.578	–	–	20.578
Plusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	5	–	5
Total	20.578	18.071.793	–	18.092.371

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(26.996)	–	(26.996)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(30.897)	–	–	(30.897)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	(66)	–	(66)
Total	(30.897)	(27.062)	–	(57.959)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Asian Debt - Hard Currency Fund (continued)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	16.165.622	–	16.165.622
Bonos del Estado	–	1.405.712	–	1.405.712
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	13.033	–	13.033
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	3.305	–	–	3.305
Total	3.305	17.584.367	–	17.587.672

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(9.005)	–	(9.005)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(2.000)	–	–	(2.000)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	(228)	–	(228)
Total	(2.000)	(9.233)	–	(11.233)

Neuberger Berman China Bond Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 CNY	Nivel 2 CNY	Nivel 3 CNY	Total CNY
Activos financieros mantenidos para negociación				
Certificado de depósito	–	97.397.470	–	97.397.470
Bonos de empresa	–	496.296.533	–	496.296.533
Bonos del Estado	–	50.343.835	–	50.343.835
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	6.540.736	–	6.540.736
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	34.121	–	–	34.121
Total	34.121	650.578.574	–	650.612.695

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman China Bond Fund (continued)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 CNY	Nivel 2 CNY	Nivel 3 CNY	Total CNY
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(3.381.257)	–	(3.381.257)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(66.022)	–	–	(66.022)
Total	(66.022)	(3.381.257)	–	(3.447.279)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 CNY	Nivel 2 CNY	Nivel 3 CNY	Total CNY
Activos financieros mantenidos para negociación				
Certificado de depósito	–	118.325.635	–	118.325.635
Bonos de empresa	–	401.909.257	–	401.909.257
Bonos del Estado	–	30.306.840	–	30.306.840
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	11.897.513	–	11.897.513
Total	–	562.439.245	–	562.439.245

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 CNY	Nivel 2 CNY	Nivel 3 CNY	Total CNY
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(3.728.823)	–	(3.728.823)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(31.773)	–	–	(31.773)
Total	(31.773)	(3.728.823)	–	(3.760.596)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	2.074.304.794	–	2.074.304.794
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	7.628.379	–	7.628.379
Total	–	2.081.933.173	–	2.081.933.173

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(10.499.068)	–	(10.499.068)
Total	–	(10.499.068)	–	(10.499.068)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	1.579.693.241	–	1.579.693.241
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	16.081.608	–	16.081.608
Total	–	1.595.774.849	–	1.595.774.849

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(18.919.228)	–	(18.919.228)
Total	–	(18.919.228)	–	(18.919.228)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman US Equity Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	7.142.826	–	–	7.142.826
Fondos de inversión inmobiliaria	104.534	–	–	104.534
Plusvalía latente total sobre inversión privada en renta variable pública – (PIPE)	–	61.664	–	61.664
Total	7.247.360	61.664	–	7.309.024

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	6.401.566	–	–	6.401.566
Total	6.401.566	–	–	6.401.566

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	–	1.509.547	–	1.509.547
Bonos de empresa	–	74.109.163	–	74.109.163
Bonos del Estado	–	243.493	–	243.493
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	436.406	–	436.406
Total	–	76.298.609	–	76.298.609

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund (continued)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(606.503)	–	(606.503)
Total	–	(606.503)	–	(606.503)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	60.194.891	–	60.194.891
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	2.727.651	–	2.727.651
Total	–	62.922.542	–	62.922.542

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(2.192.915)	–	(2.192.915)
Total	–	(2.192.915)	–	(2.192.915)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de agencias	–	412.322	–	412.322
Valores respaldados por activos	–	9.677.680	–	9.677.680
Bonos de empresa	–	43.039.680	–	43.039.680
Bonos del Estado	–	23.374.528	–	23.374.528
Fondos de inversión	4.912.240	–	–	4.912.240
Valores respaldados por hipotecas	–	7.114.124	–	7.114.124
Bonos del Tesoro	–	3.324.336	–	3.324.336
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	1.644.330	–	1.644.330
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	116.108	–	–	116.108
Plusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	–	7.655	–	7.655
Total	5.028.348	88.594.655	–	93.623.003

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.170.537)	–	(1.170.537)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(508.578)	–	–	(508.578)
Contratos de credit default swap al valor razonable	–	(1.327.532)	–	(1.327.532)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	(20.149)	–	(20.149)
Total	(508.578)	(2.518.218)	–	(3.026.796)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de agencias	–	432.625	–	432.625
Valores respaldados por activos	–	9.474.403	–	9.474.403
Bonos de empresa	–	48.214.685	–	48.214.685
Bonos del Estado	–	24.982.554	–	24.982.554
Fondos de inversión	139.429	3.253.850	–	3.393.279
Valores respaldados por hipotecas	–	12.696.516	–	12.696.516
Bonos del Tesoro	–	3.324.105	–	3.324.105
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	3.035.916	–	3.035.916
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	264.132	–	–	264.132
Plusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	–	13.270	–	13.270
Total	403.561	105.427.924	–	105.831.485

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (continued)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(4.914.720)	–	(4.914.720)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(153.665)	–	–	(153.665)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	(30.543)	–	(30.543)
Total	(153.665)	(4.945.263)	–	(5.098.928)

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	7.274.582	–	7.274.582
Valores de renta variable	5.888.380	86.383	–	5.974.763
Bonos del Estado	–	1.015.133	–	1.015.133
Fondos de inversión	905.884	835.286	–	1.741.170
Contratos de opciones adquiridas	777	–	27	804
Fondos de inversión inmobiliaria	1.171.469	–	–	1.171.469
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	158.463	–	158.463
Plusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	–	3.387	–	3.387
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	8.319	–	–	8.319
Total	7.974.829	9.373.234	27	17.348.090

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	–	(2.292)	–	(2.292)
Contratos de opciones sobre índices suscritos	(6.990)	–	–	(6.990)
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(110.088)	–	(110.088)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(30.763)	–	–	(30.763)
Total	(37.753)	(112.380)	–	(150.133)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (continued)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de agencias	–	123.607	–	123.607
Bonos de empresa	–	9.770.415	–	9.770.415
Valores de renta variable	2.349.960	1.161.657	–	3.511.617
Bonos del Estado	–	1.490.380	–	1.490.380
Fondos de inversión	–	1.639.321	–	1.639.321
Contratos de opciones adquiridas	6.448	–	25	6.473
Fondos de inversión inmobiliaria	529.590	34.430	–	564.020
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	382.347	–	382.347
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	1.111	–	–	1.111
Total	2.887.109	14.602.157	25	17.489.291

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Contratos de opciones sobre índices suscritos	(37.573)	–	–	(37.573)
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(585.271)	–	(585.271)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(12.256)	–	–	(12.256)
Total	(49.829)	(585.271)	–	(635.100)

Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Estado	–	311.059.433	–	311.059.433
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	48.372	–	48.372
Total	–	311.107.805	–	311.107.805

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund (continued)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Contratos de opciones sobre índices suscritos	(2.388.323)	–	–	(2.388.323)
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(89.682)	–	(89.682)
Total	(2.388.323)	(89.682)	–	(2.478.005)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Estado	–	174.436.368	–	174.436.368
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	11.122.711	–	11.122.711
Total	–	185.559.079	–	185.559.079

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Contratos de opciones sobre índices suscritos	(2.566.550)	–	–	(2.566.550)
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(9.813.864)	–	(9.813.864)
Total	(2.566.550)	(9.813.864)	–	(12.380.414)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Global Equity Index PutWrite Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Estado	–	15.076.743	–	15.076.743
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	91.462	–	91.462
Total	–	15.168.205	–	15.168.205

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Contratos de opciones sobre índices suscritos	(205.530)	–	–	(205.530)
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(137.852)	–	(137.852)
Total	(205.530)	(137.852)	–	(343.382)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos del Estado	–	25.586.613	–	25.586.613
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	888.223	–	888.223
Total	–	26.474.836	–	26.474.836

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Contratos de opciones sobre índices suscritos	(298.490)	–	–	(298.490)
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(436.062)	–	(436.062)
Total	(298.490)	(436.062)	–	(734.552)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	242.041.808	–	242.041.808
Bonos del Estado	–	4.056.925	–	4.056.925
Bonos del Tesoro	–	859.912.354	–	859.912.354
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	16.251.780	–	16.251.780
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	42.572.912	–	–	42.572.912
Contratos de opciones sobre divisas adquiridas	–	833.840	–	833.840
Contratos de opciones sobre renta variable adquiridas	8.524.275	3.365.505	–	11.889.780
Contratos de opciones adquiridas	14.659.281	137.102	–	14.796.383
Contratos de opciones sobre renta fija adquiridos	15.313	–	–	15.313
Plusvalía latente sobre contratos por diferencias	–	91.194.838	–	91.194.838
Contratos de credit default swap al valor razonable	–	430.448	–	430.448
Plusvalía latente sobre contratos de swaps multdivisas	–	77.228	–	77.228
Plusvalía latente en swaptions adquiridas	–	826.488	–	826.488
Plusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	–	1.046.587	–	1.046.587
Plusvalía latente sobre contratos de swap de varianza	–	204.235	–	204.235
Plusvalía latente sobre contratos de swap de volatilidad	–	904.414	–	904.414
Total	65.771.781	1.221.283.552	–	1.287.055.333

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(35.713.166)	–	(35.713.166)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(11.653.045)	–	–	(11.653.045)
Contratos de opciones sobre índices suscritos	(7.726.239)	(811.562)	–	(8.537.801)
Contratos de opciones sobre divisas suscritos	–	(63.595)	–	(63.595)
Contratos de opciones sobre renta variable suscritos	(217.216)	–	–	(217.216)
Contratos de opciones sobre renta fija suscritos	(2.188)	–	–	(2.188)
Minusvalía latente sobre contratos por diferencias	–	(69.855.525)	(30.794)	(69.886.319)
Contratos de credit default swap al valor razonable	–	(461.769)	–	(461.769)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	–	(5.734.388)	–	(5.734.388)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de varianza	–	(455.667)	–	(455.667)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de volatilidad	–	(1.862.063)	–	(1.862.063)
Total	(19.598.688)	(114.957.735)	(30.794)	(134.587.217)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (continued)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	96.235.725	–	96.235.725
Bonos del Estado	–	5.240.875	–	5.240.875
Bonos del Tesoro	–	904.903.648	–	904.903.648
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	92.810.121	–	92.810.121
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	10.773.165	–	–	10.773.165
Contratos de opciones sobre divisas adquiridas	–	5.769.677	–	5.769.677
Contratos de opciones sobre renta variable adquiridas	7.129.382	–	–	7.129.382
Contratos de opciones adquiridas	24.434.637	–	–	24.434.637
Plusvalía latente sobre contratos por diferencias	–	73.189.583	–	73.189.583
Swaptions comprados	–	1.209.388	–	1.209.388
Total	42.337.184	1.179.359.017	–	1.221.696.201

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(14.640.035)	–	(14.640.035)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(18.758.449)	–	–	(18.758.449)
Contratos de opciones sobre divisas suscritos	–	(4.023.599)	–	(4.023.599)
Contratos de opciones sobre renta variable suscritos	(19.892.508)	–	–	(19.892.508)
Contratos de opciones sobre índices suscritos	(29.901.423)	–	–	(29.901.423)
Minusvalía latente sobre contratos por diferencias	–	(46.841.969)	(31.651)	(46.873.620)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	–	(346.043)	–	(346.043)
Total	(68.552.380)	(65.851.646)	(31.651)	(134.435.677)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	8.005.569	–	8.005.569
Bonos del Estado	–	30.271.190	–	30.271.190
Bonos del Tesoro	–	312.300	–	312.300
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	259.524	–	259.524
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	164.796	–	–	164.796
Plusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	13.549	–	13.549
Total	164.796	38.862.132	–	39.026.928

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(787.194)	–	(787.194)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(63.117)	–	–	(63.117)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	(60.997)	–	(60.997)
Total	(63.117)	(848.191)	–	(911.308)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	1.772.794	–	1.772.794
Bonos del Estado	–	5.748.049	–	5.748.049
Bonos del Tesoro	–	42.189	–	42.189
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	58.867	–	58.867
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	125	–	–	125
Plusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	5.226	–	5.226
Total	125	7.627.125	–	7.627.250

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(50.463)	–	(50.463)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(12.061)	–	–	(12.061)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	(21.157)	–	(21.157)
Total	(12.061)	(71.620)	–	(83.681)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Emerging Markets Sustainable Equity Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	132.070.960	3.549.182	–	135.620.142
Participatory notes	4.370.432	–	–	4.370.432
Total	136.441.392	3.549.182	–	139.990.574

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	38.718.661	104.604.319	–	143.322.980
Participatory notes	9.169.028	–	–	9.169.028
Total	47.887.689	104.604.319	–	152.492.008

Neuberger Berman Global Thematic Equity Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	52.656.255	–	–	52.656.255
Total	52.656.255	–	–	52.656.255

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	25.930.776	1.515.993	–	27.446.769
Total	25.930.776	1.515.993	–	27.446.769

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman CLO Income Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	–	124.201.998	–	124.201.998
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	241.997	–	241.997
Plusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	–	62.113	–	62.113
Total	–	124.506.108	–	124.506.108

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(265.169)	–	(265.169)
Total	–	(265.169)	–	(265.169)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	–	101.110.308	–	101.110.308
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	2.037.641	–	2.037.641
Plusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	–	56.419	–	56.419
Total	–	103.204.368	–	103.204.368

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(342.087)	–	(342.087)
Total	–	(342.087)	–	(342.087)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	173.840.412	–	–	173.840.412
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	12.169	–	12.169
Total	173.840.412	12.169	–	173.852.581

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(45.000)	–	(45.000)
Total	–	(45.000)	–	(45.000)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	65.499.723	6.580.686	–	72.080.409
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	5.739	–	5.739
Total	65.499.723	6.586.425	–	72.086.148

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(731)	–	(731)
Total	–	(731)	–	(731)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	–	116.069.316	–	116.069.316
Bonos de empresa	–	514.254.238	–	514.254.238
Bonos del Estado	–	30.380.878	–	30.380.878
Plusvalía latente sobre contratos de swap sobre inflación	–	423.564	–	423.564
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	451.914	–	451.914
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	91.360	–	–	91.360
Total	91.360	661.579.910	–	661.671.270

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de swap sobre inflación	–	(212.162)	–	(212.162)
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(2.224)	–	(2.224)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(291.472)	–	–	(291.472)
Contratos de credit default swap al valor razonable	–	(1.612.156)	–	(1.612.156)
Total	(291.472)	(1.826.542)	–	(2.118.014)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	–	76.614.927	–	76.614.927
Bonos de empresa	–	305.223.815	–	305.223.815
Bonos del Estado	–	24.088.185	–	24.088.185
Plusvalía latente sobre contratos de swap sobre inflación	–	107.696	–	107.696
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	6.541	–	6.541
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	37.533	–	–	37.533
Total	37.533	406.041.164	–	406.078.697

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund (continued)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de swap sobre inflación	–	(24.738)	–	(24.738)
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.484.963)	–	(1.484.963)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(259.460)	–	–	(259.460)
Total	(259.460)	(1.509.701)	–	(1.769.161)

Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	–	434.721	–	434.721
Bonos de empresa	–	5.147.597	–	5.147.597
Bonos del Estado	–	5.785.452	–	5.785.452
Plusvalía latente sobre contratos de swap sobre inflación	–	17.019	–	17.019
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	3.420	–	–	3.420
Plusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	735	–	735
Total	3.420	11.385.524	–	11.388.944

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de swap sobre inflación	–	(9.383)	–	(9.383)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(9.511)	–	–	(9.511)
Contratos de credit default swap al valor razonable	–	(43.404)	–	(43.404)
Total	(9.511)	(52.787)	–	(62.298)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund (continued)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	–	472.393	–	472.393
Bonos de empresa	–	4.938.292	–	4.938.292
Bonos del Estado	–	5.307.250	–	5.307.250
Plusvalía latente sobre contratos de swap sobre inflación	–	3.077	–	3.077
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	970	–	–	970
Total	970	10.721.012	–	10.721.982

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de swap sobre inflación	–	(3.092)	–	(3.092)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(4.500)	–	–	(4.500)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	(1.721)	–	(1.721)
Total	(4.500)	(4.813)	–	(9.313)

Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	–	3.415.779	–	3.415.779
Bonos de empresa	–	17.740.257	–	17.740.257
Bonos del Estado	–	25.283.619	–	25.283.619
Plusvalía latente sobre contratos de swap sobre inflación	–	81.656	–	81.656
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	152.598	–	152.598
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	3.413	–	–	3.413
Plusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	27.463	–	27.463
Total	3.413	46.701.372	–	46.704.785

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (continued)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de swap sobre inflación	–	(40.335)	–	(40.335)
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo		(49.562)		(49.562)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(105.751)	–	–	(105.751)
Contratos de credit default swap al valor razonable	–	(167.416)	–	(167.416)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	(6.838)	–	(6.838)
Total	(105.751)	(264.151)	–	(369.902)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	–	3.843.675	–	3.843.675
Bonos de empresa	–	20.058.502	–	20.058.502
Bonos del Estado	–	17.731.238	–	17.731.238
Plusvalía latente sobre contratos de swap sobre inflación	–	14.803	–	14.803
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	182.266	–	182.266
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	2.381	–	–	2.381
Total	2.381	41.830.484	–	41.832.865

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de swap sobre inflación	–	(19.735)	–	(19.735)
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(505.459)	–	(505.459)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(56.574)	–	–	(56.574)
Minusvalía latente sobre contratos de swap de tipos de interés	–	(41.614)	–	(41.614)
Total	(56.574)	(566.808)	–	(623.382)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Multi-Style Premia Fund*

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	492.723	–	492.723
Valores de renta variable	61.180	2.419.376	–	2.480.556
Fondos de inversión inmobiliaria	–	40.838	–	40.838
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	106.280	–	106.280
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	34.362	–	–	34.362
Total	95.542	3.059.217	–	3.154.759

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Contratos de opciones sobre renta variable	(9.469)	–	–	(9.469)
Contratos de opciones sobre índices suscritos	(17.405)	–	–	(17.405)
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(90.419)	–	(90.419)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(8.892)	–	–	(8.892)
Minusvalía latente sobre contratos por diferencias	–	(33.360)	–	(33.360)
Total	(35.766)	(123.779)	–	(159.545)

*La Cartera se liquidó el 24 de febrero de 2021.

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	23.346.111	–	23.346.111
Bonos del Estado	–	2.332.357	–	2.332.357
Bonos del Tesoro	–	4.916.296	–	4.916.296
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	2.052.499	–	2.052.499
Total	–	32.647.263	–	32.647.263

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.816.619)	–	(1.816.619)
Total	–	(1.816.619)	–	(1.816.619)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	23.331.319	–	23.331.319
Bonos del Tesoro	–	3.509.768	–	3.509.768
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	5.336.167	–	5.336.167
Total	–	32.177.254	–	32.177.254

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(6.303.252)	–	(6.303.252)
Total	–	(6.303.252)	–	(6.303.252)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund¹

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	17.101.768	–	17.101.768
Préstamos a plazo	–	40.043	–	40.043
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	43.230	–	43.230
Total	–	17.185.041	–	17.185.041

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(8.203)	–	(8.203)
Total	–	(8.203)	–	(8.203)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	14.140.683	–	14.140.683
Préstamos a plazo	–	61.380	–	61.380
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	909	–	909
Total	–	14.202.972	–	14.202.972

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(128.938)	–	(128.938)
Total	–	(128.938)	–	(128.938)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman 5G Connectivity Fund¹

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	2.529.839.039	–	–	2.529.839.039
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	1.455.583	–	1.455.583
Total	2.529.839.039	1.455.583	–	2.531.294.622

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(4.129.358)	–	(4.129.358)
Total	–	(4.129.358)	–	(4.129.358)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	986.652.073	371.867.699	–	1.358.519.772
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	5.884.677	–	5.884.677
Total	986.652.073	377.752.376	–	1.364.404.449

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(592.167)	–	(592.167)
Total	–	(592.167)	–	(592.167)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund¹

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 JPY	Nivel 2 JPY	Nivel 3 JPY	Total JPY
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	3.922.049.400	–	–	3.922.049.400
Total	3.922.049.400	–	–	3.922.049.400

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 JPY	Nivel 2 JPY	Nivel 3 JPY	Total JPY
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	739.400.200	–	–	739.400.200
Total	739.400.200	–	–	739.400.200

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund¹

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores respaldados por activos	–	9.449.243	–	9.449.243
Bonos de empresa	–	529.326.299	–	529.326.299
Bonos del Estado	–	13.626.031	–	13.626.031
Fondos de inversión	479.853	–	–	479.853
Bonos del Tesoro	–	10.999.401	–	10.999.401
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	3.787.040	–	3.787.040
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	93.929	–	–	93.929
Plusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	–	458.246	–	458.246
Total	573.782	567.646.260	–	568.220.042

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(1.428.930)	–	(1.428.930)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(2.821.476)	–	–	(2.821.476)
Total	(2.821.476)	(1.428.930)	–	(4.250.406)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund¹ (cont.)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	546.341.881	–	546.341.881
Bonos del Estado	–	6.832.511	–	6.832.511
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	29.754.464	–	29.754.464
Plusvalía latente sobre contratos de futuros	174.781	–	–	174.781
Plusvalía latente sobre contratos de swap de rentabilidad total	–	302.169	–	302.169
Total	174.781	583.231.025	–	583.405.806

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(3.521.545)	–	(3.521.545)
Minusvalía latente sobre contratos de futuros	(172.207)	–	–	(172.207)
Total	(172.207)	(3.521.545)	–	(3.693.752)

Neuberger Berman Global Diversified Income FMP – 2024¹

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	233.653.261	–	233.653.261
Bonos del Estado	–	11.815.179	–	11.815.179
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	64.447	–	64.447
Total	–	245.532.887	–	245.532.887

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(41.467)	–	(41.467)
Total	–	(41.467)	–	(41.467)

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman Global Diversified Income FMP – 2024¹ (cont.)

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Bonos de empresa	–	245.086.642	–	245.086.642
Bonos del Estado	–	11.113.270	–	11.113.270
Bonos del Tesoro	–	999.998	–	999.998
Plusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	485.739	–	485.739
Total	–	257.685.649	–	257.685.649

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Pasivos financieros mantenidos para negociación				
Minusvalía latente sobre contratos de divisas a plazo	–	(123)	–	(123)
Total	–	(123)	–	(123)

Neuberger Berman China A-Share Equity Fund¹

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 CNY	Nivel 2 CNY	Nivel 3 CNY	Total CNY
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	25.046.907	–	–	25.046.907
Total	25.046.907	–	–	25.046.907

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 31 de diciembre de 2020

	Nivel 1 CNY	Nivel 2 CNY	Nivel 3 CNY	Total CNY
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	14.963.808	283.532	–	15.247.340
Total	14.963.808	283.532	–	15.247.340

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

10. INSTRUMENTOS FINANCIEROS: COMUNICACIÓN DE DATOS (CONT.)

Valor razonable de las inversiones (cont.)

Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund²

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 EUR	Nivel 2 EUR	Nivel 3 EUR	Total EUR
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	7.153.191	–	–	7.153.191
Total	7.153.191	–	–	7.153.191

Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund²

Instrumentos financieros al valor razonable con cambios en resultados

A 30 de junio de 2021

	Nivel 1 USD	Nivel 2 USD	Nivel 3 USD	Total USD
Activos financieros mantenidos para negociación				
Valores de renta variable	21.992.238	–	–	21.992.238
Total	21.992.238	–	–	21.992.238

¹ Cartera lanzada durante el ejercicio contable anterior.² Cartera lanzada durante el actual período contable.

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

11. TIPOS DE CAMBIO

Para convertir los activos y pasivos en divisas se utilizaron los tipos de cambio de cierre del periodo que se indican a continuación, a 30 de junio de 2021:

1 USD = 169,13000 ARS	1 USD = 6,27055 DKK	1 USD = 74,33000 INR	1 USD = 48,81500 PHP	1 USD = 3.560,00000 UGX
1 USD = 1,33200 AUD	1 USD = 57,02000 DOP	1 USD = 110,99000 JPY	1 USD = 3,80700 PLN	1 USD = 43,49500 UYU
1 USD = 5,01785 BRL	1 USD = 15,69500 EGP	1 USD = 107,90000 KES	1 USD = 4,15255 RON	1 USD = 23.008,00000 VND
1 USD = 1,23830 CAD	1 USD = 0,84324 EUR	1 USD = 1.126,15000 KRW	1 USD = 99,17500 RSD	1 USD = 14,27875 ZAR
1 USD = 0,92435 CHF	1 USD = 0,72388 GBP	1 USD = 19,91050 MXN	1 USD = 73,05375 RUB	1 USD = 22,63500 ZMW
1 USD = 728,11000 CLP	1 USD = 5,89000 GHS	1 USD = 4,15150 MYR	1 USD = 8,55215 SEK	
1 USD = 6,46085 CNH	1 USD = 7,76585 HKD	1 USD = 410,00000 NGN	1 USD = 1,34420 SGD	
1 USD = 6,46145 CNY	1 USD = 296,00305 HUF	1 USD = 8,60520 NOK	1 USD = 32,05000 THB	
1 USD = 3.734,00000 COP	1 USD = 14.500,00000 IDR	1 USD = 1,43113 NZD	1 USD = 8,68750 TRY	
1 USD = 21,50855 CZK	1 USD = 3,25850 ILS	1 USD = 3,83250 PEN	1 USD = 27,86250 TWD	
1 EUR = 1,57962 AUD	1 EUR = 7,43625 DKK	1 EUR = 9,20952 HKD	1 EUR = 4,51472 PLN	1 EUR = 1,59409 SGD
1 EUR = 1,09619 CHF	1 EUR = 0,85845 GBP	1 EUR = 10,20491 NOK	1 EUR = 10,14199 SEK	1 EUR = 1,18590 USD
1 CNY = 0,13052 EUR	1 CNY = 0,20805 SGD			
1 CNY = 1,20199 HKD	1 CNY = 0,15478 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 2020:

1 USD = 141.30000 ARS	1 USD = 6,08350 DKK	1 USD = 73,06750 INR	1 USD = 48,02350 PHP	1 USD = 28,33500 UAH
1 USD = 1,29592 AUD	1 USD = 58,14500 DOP	1 USD = 103,24500 JPY	1 USD = 3,72600 PLN	1 USD = 42,47500 UYU
1 USD = 5,19420 BRL	1 USD = 15,73000 EGP	1 USD = 109,20000 KES	1 USD = 3,97815 RON	1 USD = 14,68875 ZAR
1 USD = 1,27400 CAD	1 USD = 0,81729 EUR	1 USD = 1.086,30000 KRW	1 USD = 96,08000 RSD	1 USD = 21,16500 ZMW
1 USD = 0,88395 CHF	1 USD = 0,73156 GBP	1 USD = 19,92550 MXN	1 USD = 73.96440 RUB	
1 USD = 710,50000 CLP	1 USD = 5,86500 GHS	1 USD = 4,02250 MYR	1 USD = 8,21255 SEK	
1 USD = 6,49665 CNH	1 USD = 7,75385 HKD	1 USD = 394.75000 NGN	1 USD = 1,32165 SGD	
1 USD = 6,53980 CNY	1 USD = 296,42025 HUF	1 USD = 8,56195 NOK	1 USD = 29,96000 THB	
1 USD = 3.420,50000 COP	1 USD = 14050.00000 IDR	1 USD = 1,38889 NZD	1 USD = 7,43250 TRY	
1 USD = 21.46375 CZK	1 USD = 3,21080 ILS	1 USD = 3,61730 PEN	1 USD = 28,09800 TWD	
1 EUR = 1,58563 AUD	1 EUR = 0,89509 GBP	1 EUR = 10,04847 SEK	1 EUR = 1,22355 USD	
1 EUR = 1,08156 CHF	1 EUR = 4,55895 PLN	1 EUR = 1,61710 SGD		
1 CNY = 0,12580 EUR	1 CNY = 0,20344 SGD			
1 CNY = 1,19352 HKD	1 CNY = 0,15393 USD			

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021

11. TIPOS DE CAMBIO (CONT.)

ARS	Peso argentino	HUF	Forint húngaro	RUB	Rublo ruso
AUD	Dólar australiano	IDR	Rupia indonesia	SEK	Corona sueca
BRL	Real brasileño	ILS	Shekel israelí	SGD	Dólar de Singapur
CAD	Dólar canadiense	INR	Rupia india	THB	Baht tailandés
CHF	Franco suizo	JPY	Yen japonés (JPY)	TRY	Lira turca
CLP	Peso chileno	KES	Chelín keniano	TWD	Nuevo dólar taiwanés
*CNH	Yuan renminbi chino	KRW	Won de Corea del Sur	UAH	Hryvnia ucraniana
*CNY	Yuan renminbi chino	MXN	Peso mexicano	USD	Dólar estadounidense (\$)
COP	Peso colombiano	MYR	Ringgit malayo	UYU	Peso uruguayo
CZK	Corona checa	NGN	Naira nigeriana	VND	Dong vietnamita
DKK	Corona danesa	NOK	Corona noruega	ZAR	Rand sudafricano
DOP	Peso dominicano	NZD	Dólar de Nueva Zelanda	ZMW	Kwacha zambiano
EGP	Libra egipcia	PEN	Sol peruano		
EUR	Euro (EUR)	PHP	Peso filipino		
GBP	Libra esterlina (GBP)	PLN	Zloty polaco		
GHS	Cedi ghanés	RON	Nuevo leu rumano		
HKD	Dólar de Hong Kong	RSD	Dinar serbio		

*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, se han convertido a dólares estadounidenses los resultados de determinadas Carteras 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 2021	31 de diciembre 2020	30 de junio 2021	30 de junio 2020
Neuberger Berman European High Yield Bond Fund	1 USD = 0,84324 EUR	1 USD = 0,81729 EUR	1 USD = 0,82988 EUR	1 USD = 0,90740 EUR
Neuberger Berman China Bond Fund	1 USD = 6,46145 CNY	1 USD = 6,53980 CNY	1 USD = 6,47040 CNY	1 USD = 7,03230 CNY
Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund	1 USD = 0,84324 EUR	1 USD = 0,81729 EUR	1 USD = 0,82988 EUR	1 USD = 0,90740 EUR
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	1 USD = 0,84324 EUR	1 USD = 0,81729 EUR	1 USD = 0,82988 EUR	1 USD = 0,90740 EUR
Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund	1 USD = 0,84324 EUR	1 USD = 0,81729 EUR	1 USD = 0,82988 EUR	1 USD = 0,90740 EUR
Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund	1 USD = 0,84324 EUR	1 USD = 0,81729 EUR	1 USD = 0,82988 EUR	1 USD = 0,90740 EUR
Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund	1 USD = 0,84324 EUR	1 USD = 0,81729 EUR	1 USD = 0,82988 EUR	1 USD = 0,90740 EUR
Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund	1 USD = 110,99000 JPY	1 USD = 103,24500 JPY	1 USD = 107,74700 JPY	1 USD = 107,55000 JPY
Neuberger Berman China A-Share Equity Fund	1 USD = 6,46145 CNY	1 USD = 6,53980 CNY	1 USD = 6,47040 CNY	N/A
Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund	1 USD = 0,84324 EUR	N/A	1 USD = 0,83222 EUR	N/A

Se deriva un ajuste cambiario teórico de USD (100.304.264) (30 de junio de 2020: (1.091.185 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.

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021**13. ACUERDOS DE COMISIONES EN ESPECIE**

El Gestor de inversiones y otras partes 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. El Gestor de inversiones considera que dichos acuerdos benefician a las Carteras y tiene el convencimiento de haber recibido la mejor ejecución en nombre de las Carteras.

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 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 del Gestor 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 (1) una comisión por préstamo de valores y (ii) todo ingreso derivado de los valores.

Por cada Cartera que participe en Contratos de préstamo de valores, la Sociedad recibirá una garantía que equivalga, como mínimo, al 102% del valor de los valores prestados. Las Carteras pueden suscribir Contratos de préstamo de valores por los que (i) en todo momento, tienen derecho a reclamar la devolución de los valores prestados o rescindir cualquier operación de préstamo de valores, y (ii) las operaciones no comprometan la gestión de los activos de la Cartera con arreglo a su política de inversión. Salvo que se indique otra cosa en el Suplemento pertinente, la proporción máxima del valor liquidativo de la Cartera que puede estar sujeto a Contratos de préstamo de valores es el 50%, y la proporción prevista del valor liquidativo de la Cartera que estará sujeta a Contratos de préstamo de valores es de entre el 0% y el 1%.

La Sociedad ha nombrado a Brown Brothers Harriman & Co. (el "Agente de préstamo") como entidad encargada de los Contratos de préstamo de valores, concretamente, de la selección de las contrapartes, previa aprobación de la Sociedad, y la gestión de la garantía. Las Carteras que celebren Contratos de préstamo de valores percibirán todos los ingresos que estos generen, una vez deducidos los costes operativos directos e indirectos, lo que supondrá el 90% de los ingresos totales generados. El 10% restante se abonará al Agente de préstamo en concepto de retribución por los costes operativos directos e indirectos derivados de la prestación de sus servicios y la garantía que otorgue. Los ingresos por préstamo de valores que perciban las Carteras durante el período se reflejan por separado en la Cuenta de pérdidas y ganancias.

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021**15. GESTIÓN EFICIENTE DE LA CARTERA (CONT.)**

A 30 de junio de 2021, el valor del saldo vivo de los títulos cedidos en préstamo y el valor de la garantía en forma de valores registrada por las Carteras eran los siguientes:

Cartera	Divisa	Valor del saldo vivo de los títulos cedidos en préstamo	Valor de la garantía	% de la garantía mantenida
Neuberger Berman High Yield Bond Fund	USD	60.831.541	63.884.300	105%
Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund	USD	4.872.419	5.116.614	105%
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund	USD	273.964	287.680	105%
Neuberger Berman Strategic Income Fund	USD	7.583.144	7.963.452	105%
Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	USD	517.595	543.620	105%
Neuberger Berman European High Yield Bond Fund	EUR	685.585	719.910	105%
Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund	EUR	15.388.177	16.161.924	105%
Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund	USD	858.675	901.837	105%
Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund	USD	232.502	244.193	105%
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	EUR	6.223.466	6.535.354	105%
Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund	EUR	204.885	215.143	105%

A 30 de junio de 2020, el valor del saldo vivo de los títulos cedidos en préstamo y el valor de la garantía en forma de valores registrada por las Carteras eran los siguientes:

Cartera	Divisa	Valor del saldo vivo de los títulos cedidos en préstamo	Valor de la garantía	% de la garantía mantenida
Neuberger Berman High Yield Bond Fund	USD	14.820.628	15.561.702	105%
Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund	USD	3.655.266	3.838.029	105%
Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund	USD	4.587.042	4.816.414	105%
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund	USD	231.385	333.100	144%
Neuberger Berman Strategic Income Fund	USD	1.127.728	1.184.118	105%
Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	USD	11.000.685	12.016.230	109%
Neuberger Berman US Long Short Equity Fund	USD	463.964	487.163	105%
Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund	USD	486.440	510.763	105%
Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund	USD	43.507	45.682	105%
Neuberger Berman China Bond Fund	CNY	16.028.751	16.830.239	105%
Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund	EUR	185.065	266.417	144%
Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund	USD	108.904	156.777	144%
Neuberger Berman Emerging Markets Sustainable Equity Fund	USD	1.306.557	1.371.885	105%

Durante el semestre finalizado el 30 de junio de 2021, la Sociedad no participó en operaciones de recompra (30 de junio de 2020: igual).

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021**16. LÍNEA DE CRÉDITO**

Según la reunión del Consejo de 20 de junio de 2016, se han hecho acuerdos con The Bank of Tokyo Mitsubishi UFJ Ltd y con un sindicato de otros bancos (conjuntamente los "Prestamistas") a fin de facilitar un servicio de liquidez comprometido, hasta un importe máximo de 500.000.000 USD (el "Servicio") a la Sociedad con respecto a las Carteras 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. A partir del 4 de octubre de 2018, el importe máximo del servicio de liquidez comprometido se ha incrementado de 500.000.000 USD a 600.000.000 USD. El 27 de marzo de 2020, el importe máximo del servicio de liquidez comprometido se había incrementado de 600.000.000 USD a 975.000.000 USD. El 1 de octubre de 2020, el importe máximo del servicio de liquidez comprometido se había reducido de 975.000.000 USD a 750.000.000 USD. El coste de la comisión de compromiso se ha modificado en consonancia.

A 30 de junio de 2021 y a 31 de diciembre de 2020 no existían préstamos pendientes de amortización en virtud del Servicio. Durante el semestre finalizado el 30 de junio de 2021 y el ejercicio cerrado el 31 de diciembre de 2020, ninguna de las Carteras recurrió a la línea de crédito.

El Servicio se renovó el 1 de octubre de 2020 para un período de 364 días.

17. COMPROMISOS DE PRÉSTAMO NO FINANCIADOS

A 30 de junio de 2021, la Sociedad mantenía los siguientes compromisos de préstamos no financiados:

Nombre de la cartera	Nombre del valor	Compromiso no financiado USD	Valor razonable USD
Neuberger Berman High Yield Bond Fund	National Mentor Holdings Inc	311.130	312.015
Neuberger Berman High Yield Bond Fund	Redstone Holdco 2 LP	2.430.348	2.429.340
Neuberger Berman High Yield Bond Fund	Service Logic Acquisition Inc	1.316.060	1.323.463
Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund	Constant Contact Inc	209.647	209.385
Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund	National Mentor Holdings Inc	24.065	24.134
Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund	Redstone Holdco 2 LP	1.067.497	1.067.054
Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund	Service Logic Acquisition Inc	343.791	345.725
Neuberger Berman Strategic Income Fund	Hertz Corp	166.162	167.166
Neuberger Berman Strategic Income Fund	Redstone Holdco 2 LP	206.748	206.663
Neuberger Berman Strategic Income Fund	Tricorbrown Holdings Inc	83.963	83.459

18. CIFRAS COMPARATIVAS

Las cifras utilizadas a efectos comparativos en las cuentas son las del semestre finalizado el 30 de junio de 2020 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 2020 en el caso del Balance.

19. ACONTECIMIENTOS SIGNIFICATIVOS DURANTE EL PERIODO

El brote del nuevo coronavirus en muchos países ha supuesto, entre otras cosas, una interrupción de los viajes y las cadenas de suministro globales. Esta circunstancia ha provocado un impacto negativo en la actividad comercial global, el sector del transporte y los precios de las materias primas en el sector energético. El virus ha afectado, y podría seguir afectando, a las economías de muchos países y empresas individuales, así como a los mercados globales de valores y materias primas, con efectos negativos en la liquidez y la volatilidad. La evolución y la inestabilidad de esta situación impide prever sus repercusiones finales, algo que podría seguir teniendo un efecto pernicioso en las condiciones económicas y de mercado a escala global. Dichas condiciones (que pueden incidir en los distintos sectores, industrias o regiones) han afectado a los emisores de los valores que mantienen las Carteras y podrían seguir haciéndolo.

Neuberger Berman Diversified Currency Fund se liquidó el 22 de enero de 2021.

El Banco Central registró el 1 de febrero de 2021 un nuevo Folleto y Suplementos del Folleto.

Neuberger Berman Multi-Style Premia Fund se liquidó el 24 de febrero de 2021.

Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund y Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund se lanzaron el 24 de febrero de 2021.

CORRESPONDIENTES AL SEMESTRE FINALIZADO EL 30 DE JUNIO DE 2021**19. ACONTECIMIENTOS SIGNIFICATIVOS DURANTE EL PERIODO (CONT.)**

El Banco Central registró el 1 de marzo de 2021 un nuevo Folleto y Suplementos del Folleto.

Con efecto a partir del 31 de marzo de 2021, LCJ Investments SA cesó en sus funciones de Subasesor no afiliado de la Sociedad.

El Banco Central registró el 6 de mayo de 2021 un nuevo Suplemento del Folleto relativo a el cambio de denominación del Neuberger Berman Systematic Global Equity Fund por el de Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund.

Con efecto a partir del 19 de junio de 2021, Good Hill Partners LP cesó en sus funciones de Subasesor no afiliado de la Sociedad.

El Reglamento (UE) del Parlamento Europeo y del Consejo sobre divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros («SFDR») entró en vigor el 10 de marzo de 2021 al nivel 1 («Nivel 1 del SFDR»). El SFDR tiene como objetivo: (i) definir un enfoque armonizado respecto a la divulgación de información relativa a la sostenibilidad a los inversores por parte de los participantes de los mercados financieros en el sector de servicios financieros de la Unión Europea; y (ii) lograr mayor transparencia sobre cómo los participantes de los mercados financieros integran los riesgos de sostenibilidad en sus respectivas decisiones y tienen en cuenta las incidencias adversas en materia de sostenibilidad en el proceso de inversión.

A efectos del SFDR, Neuberger Berman Europe Limited («NBEL») es un participante de los mercados financieras y las Carteras son productos financieros. Con fecha 1 de marzo de 2021, las divulgaciones de información sobre los productos financieros de la Sociedad conforme al Nivel 1 del SFDR se incluyeron en el Anexo VI «Sustainable Finance Disclosure Regulation» del folleto de la Sociedad. Las divulgaciones de información del participante en los mercados financieros NBEL explica cómo se tienen en cuenta los criterios medioambientales, sociales y de gobierno corporativo («ESG») en el proceso de toma de decisiones de inversión, y está disponible en www.nb.com.

Las normas técnicas de regulación, o el Nivel 2 del SFDR, que complementará al Nivel 1 del SFDR estableciendo divulgaciones de información más detalladas que deban realizarse en relación con los participantes en los mercados financieros y productos financieros afectados por el Reglamento, son un texto provisional y entrará en vigor el 1 de julio de 2022.

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 PERIODO

El Neuberger Berman BD LLC fue nombrado Entidad comercializadora de la Sociedad con efecto a partir del 1 de julio de 2021.

El Neuberger Berman East Asia Limited fue nombrado Gestor delegado de inversiones de la Sociedad con efecto a partir del 1 de julio de 2021.

El Banco Central registró el 1 de julio de 2021 un nuevo Folleto y Suplementos del Folleto.

El Neuberger Berman Europe Limited fue nombrado Entidad Comercializadora y Gestor delegado de inversiones de la Sociedad con efecto a partir del 1 de julio de 2021.

El Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited fue nombrado Sociedad gestora de la Sociedad con efecto a partir del 1 de julio de 2021.

Neuberger Berman InnovAsia 5G Fund se lanzó el 14 de julio de 2021.

Todos los componentes de la Cartera dejaron de cotizar en Euronext Dublin con efectos a partir del 12 de agosto de 2021.

Salvo por lo anteriormente indicado, no se ha producido ningún 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 24 de agosto de 2021.

Anexo I

RATIOS DE GASTOS TOTALES

Los ratios de gastos totales («TER») correspondientes al semestre finalizado el 30 de junio de 2021 se basan en los 12 meses anteriores a las fechas señaladas a continuación:

30 de junio de 2021

Neuberger Berman High Yield Bond Fund

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de reparto (mensual) A AUD	1,35%	1,34%
Clase de acumulación A AUD	1,34%	1,34%
Clase de reparto (mensual) B AUD	2,96%	2,96%
Clase de acumulación B AUD	2,95%	2,95%
Clase de reparto (mensual) C2 AUD	2,96%	2,96%
Clase de reparto (mensual) E AUD	2,96%	2,96%
Clase de acumulación E AUD	2,96%	2,96%
Clase de reparto I AUD	0,74%	0,74%
Clase de reparto (mensual) T AUD	1,96%	1,96%
Clase de reparto (semanal) T AUD	1,96%	1,96%
Clase de acumulación T AUD	1,96%	1,96%
Clase de reparto (mensual) A CAD	1,34%	1,33%
Clase de acumulación A CHF	1,34%	1,34%
Clase de acumulación I CHF	0,74%	0,74%
Clase de reparto I CHF	0,75%	0,74%
Clase de acumulación I2 EUR	0,65%	0,64%
Clase de reparto (mensual) A CNY	1,34%	1,34%
Clase de reparto (semanal) A CNY	1,34%	1,34%
Clase de reparto (mensual) I CNY	0,73%	0,72%
Clase de reparto (mensual) T CNY	1,98%	1,98%
Clase de reparto (mensual) A EUR	1,35%	1,34%
Clase de acumulación A EUR	1,34%	1,34%
Clase de reparto A EUR	1,34%	1,34%
Clase de acumulación I EUR	0,74%	0,74%
Clase de reparto I EUR	0,74%	0,74%
Clase de acumulación I2 EUR	0,64%	0,64%
Clase de reparto I2 EUR	0,65%	0,64%
Clase de acumulación I5 EUR	0,45%	0,44%
Clase de acumulación M EUR	1,96%	1,96%
Clase de reparto M EUR	1,96%	1,96%
Clase de acumulación Z EUR	0,15%	0,14%
Clase de reparto (mensual) A GBP	1,34%	1,34%
Clase de acumulación A GBP	1,35%	1,34%
Clase de reparto A GBP	1,34%	1,34%
Clase de acumulación I GBP	0,74%	0,74%
Clase de reparto I GBP	0,75%	0,74%
Clase de acumulación I2 GBP	0,65%	0,64%
Clase de reparto I2 GBP	0,65%	0,64%
Clase de acumulación Z GBP	0,15%	0,14%
Clase de reparto (mensual) A HKD	1,35%	1,34%
Clase de acumulación A HKD	1,34%	1,34%
Clase de acumulación A SEK	1,35%	1,34%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2021 (cont.)

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,34%	1,34%
Clase de acumulación A SGD	1,34%	1,34%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,34%	1,34%
Clase de reparto (semanal) A USD	1,34%	1,34%
Clase de acumulación A USD	1,34%	1,34%
Clase de reparto A USD	1,34%	1,34%
Clase de reparto (mensual) B USD	2,96%	2,96%
Clase de acumulación B USD	2,96%	2,95%
Clase de acumulación C USD	1,96%	1,96%
Clase de reparto C USD	1,96%	1,96%
Clase de acumulación C1 USD	2,36%	2,36%
Clase de reparto C1 USD	2,36%	2,36%
Clase de reparto (mensual) C2 USD	2,96%	2,96%
Clase de acumulación C2 USD	2,96%	2,96%
Clase de reparto (mensual) E USD	2,96%	2,96%
Clase de acumulación E USD	2,96%	2,96%
Clase de reparto (mensual) I USD	0,74%	0,74%
Clase de acumulación I USD	0,75%	0,74%
Clase de reparto I USD	0,75%	0,74%
Clase de reparto (mensual) I2 USD	0,65%	0,64%
Clase de acumulación I2 USD	0,64%	0,64%
Clase de reparto I2 USD	0,64%	0,64%
Clase de reparto (mensual) I4 USD	0,50%	0,50%
Clase de acumulación M USD	1,96%	1,96%
Clase de reparto M USD	1,94%	1,94%
Clase de acumulación P USD	0,71%	0,71%
Clase de reparto (mensual) T USD	1,96%	1,96%
Clase de reparto (semanal) T USD	1,96%	1,96%
Clase de acumulación T USD	1,96%	1,96%
Clase de reparto (mensual) U USD	1,05%	1,04%
Clase de acumulación U USD	1,05%	1,04%
Clase de acumulación Z USD	0,14%	0,14%
Clase de reparto (mensual) A ZAR	1,34%	1,34%
Clase de reparto (mensual) B ZAR	2,96%	2,96%
Clase de reparto (mensual) C2 ZAR	2,96%	2,96%
Clase de reparto (mensual) E ZAR	2,96%	2,96%
Clase de acumulación E ZAR	2,96%	2,96%
Clase de reparto (mensual) T ZAR	1,96%	1,96%
Clase de acumulación T ZAR	1,96%	1,96%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2021 (cont.)

Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación E AUD	3,01%	3,01%
Clase de acumulación T AUD	2,01%	2,01%
Clase de acumulación 1A EUR	1,90%	1,90%
Clase de acumulación 1I EUR	1,06%	1,06%
Clase de acumulación I3 EUR	0,70%	0,70%
Clase de acumulación M EUR	2,92%	2,92%
Clase de reparto sin cobertura I3 GBP	0,67%	0,67%
Clase de acumulación A SGD	1,89%	1,89%
Clase de acumulación 1A USD	1,90%	1,90%
Clase de acumulación 1I USD	1,05%	1,05%
Clase de reparto 1I USD	1,05%	1,05%
Clase de acumulación B USD	3,01%	3,01%
Clase de acumulación C1 USD	2,91%	2,91%
Clase de acumulación C2 USD	3,01%	3,01%
Clase de acumulación E USD	3,02%	3,02%
Clase de acumulación I3 USD	0,70%	0,70%
Clase de reparto I3 USD	0,69%	0,69%
Clase de acumulación M USD	2,91%	2,91%
Clase de acumulación P USD	0,98%	0,98%
Clase de acumulación T USD	2,02%	2,02%
Clase de acumulación U USD	1,45%	1,45%
Clase de acumulación Z USD	0,19%	0,19%
Clase de acumulación B ZAR	3,01%	3,01%
Clase de acumulación C2 ZAR	3,01%	3,01%
Clase de acumulación E ZAR	3,01%	3,01%
Clase de acumulación T ZAR	2,02%	2,02%

Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund

Clase de reparto (mensual) A AUD	1,89%	1,80%
Clase de reparto (mensual) B AUD	3,23%	3,10%
Clase de acumulación B AUD	3,24%	3,10%
Clase de reparto (mensual) C2 AUD	3,27%	3,10%
Clase de acumulación C2 AUD	3,28%	3,10%
Clase de reparto (mensual) E AUD	3,27%	3,10%
Clase de acumulación E AUD	3,24%	3,10%
Clase de reparto (mensual) T AUD	2,23%	2,10%
Clase de acumulación T AUD	2,25%	2,10%
Clase de acumulación A CHF	1,94%	1,80%
Clase de acumulación A EUR	1,82%	1,78%
Clase de acumulación I EUR	1,11%	1,05%
Clase de acumulación M EUR	2,88%	2,80%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2021 (cont.)

Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de reparto (mensual) A HKD	1,92%	1,80%
Clase de acumulación A SGD	1,94%	1,80%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,92%	1,80%
Clase de acumulación A USD	1,92%	1,80%
Clase de reparto A USD	1,92%	1,80%
Clase de reparto (mensual) B USD	3,25%	3,10%
Clase de acumulación B USD	3,23%	3,10%
Clase de acumulación C1 USD	2,95%	2,80%
Clase de reparto (mensual) C2 USD	3,21%	3,10%
Clase de acumulación C2 USD	3,26%	3,10%
Clase de reparto (mensual) E USD	3,26%	3,10%
Clase de acumulación E USD	3,26%	3,10%
Clase de reparto (mensual) I USD	1,14%	1,05%
Clase de acumulación I USD	1,17%	1,05%
Clase de reparto I USD	1,09%	1,05%
Clase de acumulación I2 USD	0,98%	0,88%
Clase de acumulación M USD	2,94%	2,80%
Clase de reparto (mensual) T USD	2,23%	2,10%
Clase de acumulación T USD	2,24%	2,10%
Clase de acumulación Z USD	0,42%	0,30%
Clase de reparto (mensual) B ZAR	3,24%	3,10%
Clase de acumulación B ZAR	3,24%	3,10%
Clase de reparto (mensual) C2 ZAR	3,25%	3,10%
Clase de acumulación C2 ZAR	3,27%	3,09%
Clase de reparto (mensual) E ZAR	3,27%	3,10%
Clase de acumulación E ZAR	3,24%	3,10%
Clase de reparto (mensual) T ZAR	2,22%	2,10%
Clase de acumulación T ZAR	2,24%	2,10%

Neuberger Berman China Equity Fund

Clase de acumulación I CHF	1,26%	1,26%
Clase de acumulación A EUR	1,99%	1,99%
Clase de acumulación I EUR	1,24%	1,24%
Clase de acumulación I4 EUR	1,24%	1,24%
Clase de acumulación M EUR	3,01%	3,01%
Clase de acumulación Z EUR	0,14%	0,14%
Clase de reparto A GBP	1,99%	1,99%
Clase de reparto sin cobertura I2 GBP	1,02%	1,02%
Clase de acumulación I4 GBP	1,24%	1,24%
Clase de reparto I4 GBP	1,24%	1,24%
Clase de acumulación A HKD	1,99%	1,99%
Clase de acumulación A SGD	2,00%	2,00%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2021 (cont.)

Neuberger Berman China Equity Fund (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación A USD	1,99%	1,99%
Clase de reparto A USD	1,99%	1,99%
Clase de acumulación I USD	1,24%	1,24%
Clase de acumulación I2 USD	1,02%	1,02%
Clase de reparto I4 USD	1,24%	1,24%
Clase de acumulación M USD	3,01%	3,01%
Clase de acumulación U USD	1,59%	1,59%
Clase de acumulación Z USD	0,15%	0,15%

Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund

Clase de acumulación B AUD	3,25%	3,25%
Clase de acumulación C2 AUD	3,30%	3,28%
Clase de acumulación E AUD	3,27%	3,27%
Clase de acumulación T AUD	2,27%	2,26%
Clase de reparto sin cobertura I CAD	1,25%	1,25%
Clase de acumulación I EUR	1,24%	1,24%
Clase de acumulación M EUR	3,27%	3,26%
Clase de acumulación Z EUR	0,23%	0,23%
Clase de acumulación I GBP	1,25%	1,25%
Clase de acumulación Z GBP	0,25%	0,25%
Clase de acumulación I JPY	1,25%	1,25%
Clase de acumulación A USD	2,25%	2,25%
Clase de acumulación B USD	3,26%	3,26%
Clase de acumulación C1 USD	3,26%	3,26%
Clase de acumulación C2 USD	3,26%	3,26%
Clase de acumulación E USD	3,28%	3,27%
Clase de acumulación I USD	1,25%	1,25%
Clase de acumulación M USD	3,25%	3,25%
Clase de acumulación T USD	2,27%	2,27%
Clase de acumulación Z USD	0,25%	0,25%
Clase de acumulación B ZAR	3,25%	3,25%
Clase de acumulación C2 ZAR	3,25%	3,25%
Clase de acumulación E ZAR	3,26%	3,25%
Clase de acumulación T ZAR	2,27%	2,26%

Neuberger Berman US Small Cap Fund

Clase de acumulación B AUD	2,99%	2,99%
Clase de acumulación C2 AUD	3,01%	3,01%
Clase de acumulación E AUD	2,97%	2,97%
Clase de acumulación T AUD	1,99%	1,99%
Clase de acumulación A EUR	1,84%	1,84%
Clase de acumulación sin cobertura A EUR	1,84%	1,84%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2021 (cont.)

Neuberger Berman US Small Cap Fund (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación I EUR	1,00%	1,00%
Clase de acumulación sin cobertura I EUR	1,02%	1,02%
Clase de acumulación sin cobertura I2 EUR	0,86%	0,86%
Clase de acumulación M EUR	2,89%	2,89%
Clase de acumulación Z EUR	0,17%	0,17%
Clase de reparto I JPY	1,03%	1,03%
Clase de acumulación A USD	1,86%	1,86%
Clase de reparto A USD	1,86%	1,86%
Clase de acumulación B USD	2,99%	2,99%
Clase de acumulación C2 USD	2,98%	2,98%
Clase de acumulación E USD	2,97%	2,97%
Clase de acumulación I USD	1,03%	1,03%
Clase de reparto I USD	1,02%	1,02%
Clase de acumulación I3 USD	0,78%	0,78%
Clase de acumulación M USD	2,88%	2,88%
Clase de acumulación T USD	1,99%	1,99%
Clase de acumulación Z USD	0,16%	0,16%
Clase de acumulación E ZAR	2,97%	2,97%
Clase de acumulación T ZAR	1,98%	1,98%

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund

Clase de reparto (mensual) A AUD	1,35%	1,34%
Clase de acumulación A CHF	1,34%	1,34%
Clase de acumulación I CHF	0,74%	0,74%
Clase de reparto (mensual) A CNY	1,34%	1,34%
Clase de acumulación A EUR	1,34%	1,34%
Clase de reparto A EUR	1,34%	1,34%
Clase de acumulación I EUR	0,74%	0,74%
Clase de acumulación I2 EUR	0,65%	0,64%
Clase de reparto I2 EUR	0,64%	0,64%
Clase de reparto I3 EUR	0,57%	0,56%
Clase de acumulación M EUR	1,96%	1,96%
Clase de reparto M EUR	1,96%	1,96%
Clase de acumulación I GBP	0,74%	0,74%
Clase de reparto I GBP	0,74%	0,74%
Clase de acumulación I2 GBP	0,64%	0,64%
Clase de reparto I2 GBP	0,65%	0,64%
Clase de acumulación I JPY	0,74%	0,74%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,35%	1,35%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,34%	1,34%
Clase de acumulación A USD	1,34%	1,34%
Clase de reparto A USD	1,34%	1,34%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2021 (cont.)

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación C USD	1,96%	1,96%
Clase de reparto C USD	1,96%	1,96%
Clase de acumulación C1 USD	2,36%	2,36%
Clase de acumulación I USD	0,74%	0,74%
Clase de reparto I USD	0,74%	0,74%
Clase de acumulación I2 USD	0,64%	0,64%
Clase de reparto I2 USD	0,64%	0,64%
Clase de acumulación M USD	1,96%	1,96%
Clase de reparto M USD	1,96%	1,96%
Clase de acumulación Z USD	0,15%	0,14%

Neuberger Berman Global Bond Fund

Clase de reparto (mensual) T AUD	1,21%	1,20%
Clase de acumulación A USD	1,04%	1,00%
Clase de acumulación C1 USD	2,05%	2,00%
Clase de acumulación I USD	0,63%	0,60%
Clase de acumulación M USD	1,65%	1,60%
Clase de reparto (mensual) T USD	1,21%	1,20%
Clase de acumulación Z USD	0,24%	0,20%
Clase de reparto (mensual) T ZAR	1,21%	1,20%

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund

Clase de reparto (mensual) B AUD	3,03%	3,00%
Clase de acumulación B AUD	3,03%	3,00%
Clase de reparto (mensual) C2 AUD	3,03%	3,00%
Clase de acumulación C2 AUD	3,03%	3,00%
Clase de reparto (mensual) E AUD	3,03%	2,99%
Clase de acumulación E AUD	3,03%	2,99%
Clase de reparto (mensual) T AUD	2,03%	2,00%
Clase de acumulación T AUD	2,03%	2,00%
Clase de acumulación A EUR	1,71%	1,70%
Clase de acumulación I EUR	0,96%	0,95%
Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,96%	0,95%
Clase de acumulación sin cobertura I2 EUR	0,81%	0,80%
Clase de reparto sin cobertura I3 EUR	0,74%	0,73%
Clase de reparto sin cobertura I4 EUR	0,66%	0,65%
Clase de acumulación sin cobertura M EUR	2,53%	2,50%
Clase de reparto sin cobertura M EUR	2,53%	2,50%
Clase de acumulación sin cobertura Y EUR	0,57%	0,56%
Clase de acumulación I GBP	0,96%	0,95%
Clase de acumulación sin cobertura I4 GBP	0,66%	0,65%
Clase de reparto sin cobertura I4 GBP	0,66%	0,65%
Clase de acumulación sin cobertura Y GBP	0,57%	0,56%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2021 (cont.)

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación A SEK	1,71%	1,70%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,71%	1,70%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,71%	1,70%
Clase de acumulación A USD	1,71%	1,70%
Clase de reparto (mensual) B USD	3,03%	3,00%
Clase de acumulación B USD	3,03%	3,00%
Clase de acumulación C1 USD	2,73%	2,70%
Clase de reparto (mensual) C2 USD	3,03%	3,00%
Clase de acumulación C2 USD	3,03%	3,00%
Clase de reparto (mensual) E USD	3,03%	3,00%
Clase de acumulación E USD	3,03%	2,99%
Clase de acumulación I USD	0,96%	0,95%
Clase de reparto I USD	0,96%	0,95%
Clase de acumulación I2 USD	0,81%	0,80%
Clase de acumulación I5 USD	0,59%	0,57%
Clase de reparto M USD	2,51%	2,50%
Clase de reparto (mensual) T USD	2,03%	2,00%
Clase de acumulación T USD	2,03%	2,00%
Clase de acumulación X USD	0,59%	0,47%
Clase de acumulación Y USD	0,57%	0,56%
Clase de reparto (mensual) B ZAR	3,03%	3,00%
Clase de acumulación B ZAR	3,02%	3,00%
Clase de reparto (mensual) C2 ZAR	3,03%	2,99%
Clase de acumulación C2 ZAR	3,03%	3,00%
Clase de reparto (mensual) E ZAR	3,03%	3,00%
Clase de acumulación E ZAR	3,03%	3,00%
Clase de reparto (mensual) T ZAR	2,03%	2,00%
Clase de acumulación T ZAR	2,03%	2,00%

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund

Clase de reparto (mensual) A AUD	1,51%	1,51%
Clase de reparto I AUD	0,81%	0,81%
Clase de acumulación I2 EUR	0,67%	0,67%
Clase de acumulación P CHF	0,77%	0,77%
Clase de reparto (mensual) A EUR	1,51%	1,51%
Clase de acumulación A EUR	1,51%	1,51%
Clase de acumulación I EUR	0,81%	0,81%
Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,82%	0,82%
Clase de reparto I EUR	0,81%	0,81%
Clase de acumulación I2 EUR	0,67%	0,67%
Clase de reparto I2 EUR	0,67%	0,67%
Clase de acumulación I3 EUR	0,60%	0,60%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2021 (cont.)

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación sin cobertura I3 EUR	0,60%	0,60%
Clase de reparto I3 EUR	0,61%	0,61%
Clase de acumulación I4 EUR	0,53%	0,53%
Clase de acumulación M EUR	2,33%	2,33%
Clase de reparto M EUR	2,33%	2,33%
Clase de acumulación P EUR	0,77%	0,77%
Clase de acumulación Z EUR	0,11%	0,11%
Clase de acumulación I GBP	0,81%	0,81%
Clase de reparto I GBP	0,81%	0,81%
Clase de acumulación I2 GBP	0,67%	0,67%
Clase de reparto I2 GBP	0,67%	0,67%
Clase de acumulación P GBP	0,77%	0,77%
Clase de reparto (mensual) A HKD	1,52%	1,52%
Clase de acumulación I JPY	0,81%	0,81%
Clase de acumulación A SEK	1,51%	1,51%
Clase de acumulación sin cobertura I SEK	0,81%	0,81%
Clase de acumulación I2 SEK	0,66%	0,66%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,51%	1,51%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,51%	1,51%
Clase de acumulación A USD	1,51%	1,51%
Clase de reparto A USD	1,46%	1,46%
Clase de acumulación C1 USD	2,53%	2,53%
Clase de acumulación I USD	0,81%	0,81%
Clase de reparto I USD	0,81%	0,81%
Clase de acumulación I2 USD	0,66%	0,66%
Clase de reparto I2 USD	0,67%	0,67%
Clase de reparto I3 USD	0,60%	0,60%
Clase de acumulación M USD	2,33%	2,33%
Clase de reparto M USD	2,33%	2,33%
Clase de acumulación P USD	0,78%	0,78%
Clase de acumulación Z USD	0,11%	0,11%

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund

Clase de acumulación A CHF	1,98%	1,80%
Clase de acumulación I CHF	1,18%	1,00%
Clase de acumulación I4 CHF	0,86%	0,68%
Clase de acumulación I5 CHF	0,78%	0,60%
Clase de acumulación A EUR	2,00%	1,80%
Clase de acumulación I EUR	1,18%	1,00%
Clase de reparto I EUR	1,19%	1,00%
Clase de acumulación I3 EUR	0,86%	0,68%
Clase de acumulación I5 EUR	0,77%	0,60%
Clase de acumulación M EUR	2,79%	2,60%
Clase de reparto M EUR	2,79%	2,60%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2021 (cont.)

Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación X EUR	0,84%	0,58%
Clase de acumulación I GBP	1,18%	1,00%
Clase de acumulación A SEK	1,98%	1,80%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,97%	1,80%
Clase de acumulación A USD	1,97%	1,80%
Clase de acumulación C1 USD	3,00%	2,80%
Clase de acumulación I USD	1,18%	1,00%
Clase de reparto I USD	1,18%	1,00%
Clase de acumulación I2 USD	1,02%	0,84%
Clase de acumulación I5 USD	0,77%	0,60%
Clase de acumulación M USD	2,79%	2,60%
Clase de reparto M USD	2,79%	2,60%

Neuberger Berman Strategic Income Fund

Clase de reparto (mensual) A AUD	1,16%	1,16%
Clase de reparto (mensual) Z AUD	0,16%	0,16%
Clase de reparto (mensual) A EUR	1,16%	1,16%
Clase de acumulación A EUR	1,15%	1,15%
Clase de acumulación I EUR	0,65%	0,65%
Clase de acumulación M EUR	1,77%	1,77%
Clase de reparto M EUR	1,78%	1,78%
Clase de reparto (mensual) A GBP	1,15%	1,15%
Clase de reparto (mensual) A HKD	1,15%	1,15%
Clase de acumulación I JPY	0,66%	0,66%
Clase de acumulación sin cobertura I JPY	0,66%	0,66%
Clase de reparto CG I JPY	0,66%	0,66%
Clase de reparto I JPY	0,66%	0,66%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,16%	1,16%
Clase de acumulación A SGD	1,15%	1,15%
Clase de reparto (mensual) I SGD	0,66%	0,66%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,16%	1,16%
Clase de acumulación A USD	1,16%	1,16%
Clase de reparto A USD	1,16%	1,16%
Clase de acumulación C1 USD	2,17%	2,17%
Clase de acumulación I USD	0,66%	0,66%
Clase de reparto I USD	0,66%	0,66%
Clase de acumulación M USD	1,77%	1,77%
Clase de reparto M USD	1,77%	1,77%
Clase de acumulación Z USD	0,16%	0,16%

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund

Clase de reparto (mensual) A AUD	1,10%	1,10%
Clase de reparto (mensual) A CAD	1,09%	1,09%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2021 (cont.)

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación A CHF	1,10%	1,10%
Clase de reparto A CHF	1,10%	1,10%
Clase de acumulación I CHF	0,60%	0,60%
Clase de reparto I CHF	0,60%	0,60%
Clase de acumulación I2 EUR	0,50%	0,50%
Clase de reparto I2 CHF	0,50%	0,50%
Clase de acumulación I5 CHF	0,35%	0,35%
Clase de acumulación P CHF	0,57%	0,57%
Clase de reparto P CHF	0,56%	0,56%
Clase de acumulación A EUR	1,10%	1,10%
Clase de reparto A EUR	1,10%	1,10%
Clase de acumulación I EUR	0,60%	0,60%
Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,59%	0,59%
Clase de reparto I EUR	0,60%	0,60%
Clase de acumulación I2 EUR	0,50%	0,50%
Clase de reparto I2 EUR	0,51%	0,51%
Clase de acumulación I5 EUR	0,35%	0,35%
Clase de acumulación M EUR	1,72%	1,72%
Clase de reparto M EUR	1,72%	1,72%
Clase de acumulación P EUR	0,57%	0,57%
Clase de acumulación U EUR	0,85%	0,85%
Clase de reparto X EUR	0,50%	0,50%
Clase de acumulación A GBP	1,10%	1,10%
Clase de acumulación I GBP	0,60%	0,60%
Clase de reparto I GBP	0,62%	0,62%
Clase de acumulación I2 GBP	0,50%	0,50%
Clase de reparto I2 GBP	0,50%	0,50%
Clase de reparto I5 GBP	0,35%	0,35%
Clase de acumulación P GBP	0,58%	0,58%
Clase de reparto P GBP	0,57%	0,57%
Clase de acumulación I JPY	0,60%	0,60%
Clase de reparto I JPY	0,60%	0,60%
Clase de acumulación A SEK	1,10%	1,10%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,10%	1,10%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,10%	1,10%
Clase de acumulación A USD	1,10%	1,10%
Clase de reparto A USD	1,10%	1,10%
Clase de acumulación C1 USD	2,11%	2,11%
Clase de reparto C1 USD	2,12%	2,12%
Clase de acumulación I USD	0,60%	0,60%
Clase de reparto I USD	0,60%	0,60%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2021 (cont.)

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación I2 USD	0,50%	0,50%
Clase de reparto I2 USD	0,50%	0,50%
Clase de acumulación I5 USD	0,35%	0,35%
Clase de reparto I5 USD	0,35%	0,35%
Clase de acumulación M USD	1,72%	1,72%
Clase de reparto M USD	1,72%	1,72%
Clase de acumulación P USD	0,57%	0,57%
Clase de acumulación Z USD	0,10%	0,10%

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund

Clase de acumulación I CHF	2,55%	1,95%
Clase de acumulación A EUR	3,29%	2,70%
Clase de acumulación I EUR	2,55%	1,95%
Clase de acumulación I2 EUR	2,39%	1,80%
Clase de acumulación M EUR	4,10%	3,50%
Clase de acumulación Z EUR	1,78%	1,20%
Clase de acumulación Z GBP	1,78%	1,20%
Clase de acumulación I JPY	2,53%	1,95%
Clase de acumulación A USD	3,29%	2,70%
Clase de acumulación I USD	2,53%	1,95%
Clase de acumulación Z USD	1,78%	1,20%

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund

Clase de acumulación A EUR	2,43%	2,43%
Clase de acumulación I EUR	1,55%	1,55%
Clase de acumulación I3 EUR	1,14%	1,14%
Clase de acumulación sin cobertura I3 EUR	1,15%	1,15%
Clase de acumulación M EUR	3,28%	3,28%
Clase de acumulación sin cobertura I3 GBP	1,18%	1,18%
Clase de reparto I3 GBP	1,10%	1,10%
Clase de acumulación A1 SGD	2,21%	2,21%
Clase de acumulación A (PF) USD	1,90%	1,90%
Clase de acumulación A USD	2,45%	2,45%
Clase de acumulación A1 USD	2,21%	2,21%
Clase de acumulación C1 USD	3,47%	3,47%
Clase de reparto I (PF) USD	1,21%	1,21%
Clase de acumulación I USD	1,56%	1,56%
Clase de acumulación I3 USD	1,13%	1,13%
Clase de acumulación M USD	3,27%	3,27%
Clase de acumulación U USD	2,01%	2,01%
Clase de acumulación Z USD	0,22%	0,22%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2021 (cont.)

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de reparto I3 AUD	0,65%	0,65%
Clase de acumulación A EUR	1,57%	1,57%
Clase de acumulación I EUR	0,86%	0,86%
Clase de reparto I EUR	0,87%	0,87%
Clase de acumulación I2 EUR	0,72%	0,72%
Clase de reparto I2 EUR	0,73%	0,73%
Clase de reparto I3 EUR	0,65%	0,65%
Clase de acumulación sin cobertura I4 EUR	0,59%	0,59%
Clase de acumulación I5 EUR	0,51%	0,51%
Clase de acumulación M EUR	2,38%	2,38%
Clase de reparto M EUR	2,38%	2,38%
Clase de acumulación Z EUR	0,16%	0,16%
Clase de acumulación I GBP	0,86%	0,86%
Clase de acumulación sin cobertura I GBP	0,86%	0,86%
Clase de reparto I GBP	0,86%	0,86%
Clase de reparto sin cobertura I GBP	0,87%	0,87%
Clase de acumulación P GBP	0,83%	0,83%
Clase de acumulación sin cobertura P GBP	0,83%	0,83%
Clase de acumulación Z GBP	0,16%	0,16%
Clase de acumulación U NOK	1,21%	1,21%
Clase de acumulación A SEK	1,56%	1,56%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,56%	1,56%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,56%	1,56%
Clase de acumulación A USD	1,56%	1,56%
Clase de acumulación C1 USD	2,58%	2,58%
Clase de acumulación I USD	0,87%	0,87%
Clase de reparto I USD	0,86%	0,86%
Clase de acumulación I2 USD	0,69%	0,69%
Clase de reparto I2 USD	0,72%	0,72%
Clase de acumulación I3 USD	0,65%	0,65%
Clase de acumulación M USD	2,38%	2,38%
Clase de reparto M USD	2,38%	2,38%
Clase de acumulación Z USD	0,16%	0,16%

Neuberger Berman European High Yield Bond Fund

Clase de acumulación A EUR	2,00%	1,40%
Clase de acumulación I EUR	1,39%	0,80%
Clase de acumulación I5 EUR	1,10%	0,50%
Clase de acumulación M EUR	2,61%	2,00%
Clase de reparto M EUR	2,61%	2,00%
Clase de acumulación X EUR	0,99%	0,40%
Clase de reparto (mensual) A SGD	2,26%	1,40%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,97%	1,40%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2021 (cont.)

Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación A USD	2,02%	1,40%
Clase de acumulación I USD	1,39%	0,80%
Clase de acumulación I5 USD	1,10%	0,50%
Clase de acumulación X USD	0,99%	0,40%
Clase de acumulación Z USD	0,80%	0,20%

Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund

Clase de acumulación M EUR	4,71%	2,33%
Clase de acumulación A USD	3,62%	1,46%
Clase de acumulación I USD	3,15%	0,92%
Clase de acumulación Z USD	2,73%	0,30%

Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund

Clase de acumulación M EUR	4,87%	2,80%
Clase de acumulación sin cobertura Z EUR	2,99%	0,30%
Clase de acumulación Z GBP	2,55%	0,30%
Clase de acumulación A USD	4,00%	1,80%
Clase de acumulación CI USD	4,95%	2,80%
Clase de acumulación I USD	3,06%	1,05%
Clase de acumulación I2 USD	2,81%	0,90%
Clase de reparto I5 USD	1,74%	0,67%
Clase de acumulación M USD	5,03%	2,80%
Clase de acumulación Z USD	2,55%	0,30%

Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund

Clase de acumulación sin cobertura I GBP	1,00%	1,00%
Clase de acumulación A USD	1,89%	1,89%
Clase de acumulación I USD	1,06%	1,06%
Clase de acumulación M USD	2,95%	2,95%

Neuberger Berman Asian Debt - Hard Currency Fund

Clase de reparto (mensual) A SGD	2,29%	1,40%
Clase de reparto (mensual) A USD	2,26%	1,40%
Clase de acumulación A USD	2,22%	1,40%
Clase de acumulación C1 USD	3,23%	2,40%
Clase de acumulación I USD	1,70%	0,80%
Clase de reparto I USD	1,67%	0,80%
Clase de acumulación M USD	2,88%	2,00%
Clase de acumulación X USD	1,25%	0,40%

Neuberger Berman China Bond Fund

Clase de reparto (mensual) A CNY	1,80%	1,50%
----------------------------------	-------	-------

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2021 (cont.)

Neuberger Berman China Bond Fund (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de reparto I CNY	1,06%	0,85%
Clase de acumulación Z CNY	0,40%	0,20%
Clase de acumulación I EUR	1,02%	0,85%
Clase de acumulación sin cobertura I EUR	1,09%	0,85%
Clase de acumulación I2 GBP	0,89%	0,72%
Clase de acumulación sin cobertura I3 GBP	0,85%	0,65%
Clase de reparto sin cobertura (mensual) A SGD	1,61%	1,50%
Clase de acumulación sin cobertura I USD	1,08%	0,85%
Clase de acumulación sin cobertura M USD	2,44%	2,29%
Clase de acumulación Z USD	0,39%	0,20%
Clase de acumulación sin cobertura Z USD	0,40%	0,20%

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund

Clase de reparto (mensual) A AUD	1,31%	1,31%
Clase de acumulación P CHF	0,68%	0,68%
Clase de reparto P CHF	0,69%	0,69%
Clase de reparto (mensual) A EUR	1,31%	1,31%
Clase de acumulación A EUR	1,31%	1,31%
Clase de acumulación I EUR	0,72%	0,72%
Clase de reparto I EUR	0,72%	0,72%
Clase de acumulación I2 EUR	0,60%	0,60%
Clase de reparto I2 EUR	0,58%	0,58%
Clase de acumulación I3 EUR	0,54%	0,54%
Clase de acumulación I5 EUR	0,40%	0,40%
Clase de acumulación M EUR	1,93%	1,93%
Clase de reparto M EUR	1,93%	1,93%
Clase de acumulación P EUR	0,68%	0,68%
Clase de reparto P EUR	0,68%	0,68%
Clase de acumulación I GBP	0,71%	0,71%
Clase de acumulación I2 GBP	0,60%	0,60%
Clase de reparto I2 GBP	0,59%	0,59%
Clase de acumulación P GBP	0,68%	0,68%
Clase de reparto P GBP	0,68%	0,68%
Clase de reparto (mensual) A HKD	1,31%	1,31%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,31%	1,31%
Clase de reparto (mensual) A USD	1,31%	1,31%
Clase de acumulación A USD	1,31%	1,31%
Clase de reparto A USD	1,27%	1,27%
Clase de acumulación C1 USD	2,33%	2,33%
Clase de acumulación I USD	0,71%	0,71%
Clase de reparto I USD	0,70%	0,70%
Clase de acumulación I2 USD	0,60%	0,60%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2021 (cont.)

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de reparto I2 USD	0,59%	0,59%
Clase de acumulación M USD	1,93%	1,93%
Clase de reparto M USD	1,93%	1,93%
Clase de acumulación P USD	0,68%	0,68%
Clase de acumulación Z USD	0,12%	0,12%

Neuberger Berman US Equity Fund

Clase de acumulación A USD	3,49%	1,69%
Clase de acumulación I USD	2,60%	0,95%
Clase de reparto I USD	2,67%	0,95%

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund

Clase de acumulación Z (PF) EUR	0,61%	0,30%
Clase de acumulación A USD	1,66%	1,40%
Clase de acumulación C1 USD	2,72%	2,40%
Clase de acumulación I USD	1,09%	0,80%
Clase de acumulación M USD	2,29%	2,00%
Clase de reparto M USD	2,32%	2,00%
Clase de acumulación P USD	1,08%	0,77%
Clase de acumulación X USD	0,63%	0,40%
Clase de acumulación Z USD	0,51%	0,20%

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund

Clase de acumulación I EUR	0,82%	0,60%
Clase de acumulación P GBP	0,81%	0,58%
Clase de acumulación A USD	1,23%	1,00%
Clase de acumulación C1 USD	2,25%	2,00%
Clase de acumulación I USD	0,83%	0,60%
Clase de reparto I USD	0,83%	0,60%
Clase de acumulación I2 USD	0,75%	0,52%
Clase de acumulación M USD	1,85%	1,60%
Clase de acumulación Z USD	0,44%	0,20%

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund

Clase de reparto A EUR	3,52%	1,50%
Clase de acumulación I EUR	2,87%	0,85%
Clase de acumulación M EUR	4,39%	2,30%
Clase de reparto M EUR	4,35%	2,30%
Clase de reparto P GBP	2,86%	0,82%
Clase de acumulación A USD	3,57%	1,50%
Clase de acumulación C1 USD	4,59%	2,50%
Clase de acumulación I USD	2,91%	0,85%
Clase de reparto I USD	2,90%	0,85%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2021 (cont.)

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación M USD	4,37%	2,30%

Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund

Clase de acumulación I EUR	0,78%	0,78%
Clase de acumulación I4 EUR	0,54%	0,54%
Clase de acumulación M EUR	2,19%	2,19%
Clase de acumulación sin cobertura I GBP	0,74%	0,74%
Clase de acumulación I3 GBP	0,53%	0,53%
Clase de acumulación I4 GBP	0,54%	0,54%
Clase de acumulación sin cobertura I4 GBP	0,54%	0,54%
Clase de reparto I4 GBP	0,52%	0,52%
Clase de reparto (mensual) A SGD	1,37%	1,37%
Clase de acumulación A USD	1,37%	1,37%
Clase de acumulación C1 USD	2,39%	2,39%
Clase de reparto (mensual) I USD	0,78%	0,78%
Clase de acumulación I USD	0,77%	0,77%
Clase de acumulación I3 USD	0,60%	0,60%
Clase de acumulación I4 USD	0,54%	0,54%
Clase de acumulación M USD	2,20%	2,20%
Clase de acumulación P USD	0,73%	0,73%
Clase de acumulación Z USD	0,18%	0,18%

Neuberger Berman Global Equity Index PutWrite Fund

Clase de acumulación I5 CHF	1,63%	0,52%
Clase de reparto I5 CHF	1,65%	0,52%
Clase de acumulación I EUR	1,95%	0,85%
Clase de acumulación I5 EUR	1,60%	0,52%
Clase de acumulación M EUR	3,47%	2,30%
Clase de acumulación X EUR	2,50%	1,34%
Clase de acumulación Z EUR	1,39%	0,20%
Clase de acumulación I GBP	2,03%	0,85%
Clase de acumulación A USD	2,68%	1,50%
Clase de acumulación I USD	1,78%	0,85%
Clase de reparto (mensual) I5 USD	1,66%	0,52%
Clase de acumulación I5 USD	1,68%	0,52%
Clase de reparto I5 USD	1,75%	0,52%
Clase de reparto (mensual) X USD	2,50%	1,34%
Clase de acumulación X USD	2,52%	1,34%
Clase de acumulación Z USD	1,34%	0,20%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2021 (cont.)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación I CHF	0,93%	0,93%
Clase de acumulación I5 CHF	0,56%	0,56%
Clase de acumulación A EUR	1,68%	1,68%
Clase de acumulación I EUR	0,93%	0,93%
Clase de acumulación I2 EUR	0,78%	0,78%
Clase de acumulación I5 EUR	0,56%	0,56%
Clase de acumulación M EUR	2,49%	2,49%
Clase de acumulación I GBP	0,93%	0,93%
Clase de acumulación I2 GBP	0,78%	0,78%
Clase de acumulación I5 GBP	0,55%	0,55%
Clase de acumulación P GBP	0,89%	0,89%
Clase de acumulación Z GBP	0,18%	0,18%
Clase de acumulación A SGD	1,67%	1,67%
Clase de acumulación A USD	1,68%	1,68%
Clase de acumulación C1 USD	2,70%	2,69%
Clase de acumulación I USD	0,93%	0,93%
Clase de acumulación I2 USD	0,78%	0,78%
Clase de acumulación I5 USD	0,56%	0,56%
Clase de acumulación M USD	2,50%	2,49%
Clase de acumulación P USD	0,89%	0,89%
Clase de acumulación Z USD	0,19%	0,19%

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund

Clase de acumulación I2 AUD	1,26%	0,68%
Clase de acumulación I NOK	1,73%	0,80%
Clase de acumulación I USD	3,19%	0,80%
Clase de acumulación I2 USD	1,20%	0,68%
Clase de acumulación I5 USD	1,93%	0,50%
Clase de acumulación Z USD	2,29%	0,20%

Neuberger Berman Emerging Markets Sustainable Equity Fund

Clase de acumulación sin cobertura I EUR	1,20%	1,13%
Clase de acumulación sin cobertura I JPY	1,20%	1,13%
Clase de acumulación I USD	1,20%	1,13%
Clase de reparto I USD	1,19%	1,14%
Clase de acumulación I5 USD	0,80%	0,73%

Neuberger Berman Global Thematic Equity Fund

Clase de acumulación sin cobertura M EUR	3,57%	3,30%
Clase de acumulación A USD	2,64%	2,30%
Clase de acumulación C1 USD	3,67%	3,30%
Clase de acumulación I USD	1,58%	1,30%
Clase de acumulación M USD	3,61%	3,30%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2021 (cont.)

Neuberger Berman CLO Income Fund

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación I EUR	0,96%	0,96%
Clase de reparto I2 EUR	0,80%	0,80%
Clase de reparto I2 GBP	0,79%	0,79%
Clase de reparto I5 GBP	0,59%	0,59%
Clase de acumulación Z GBP	0,20%	0,20%
Clase de acumulación I SEK	0,95%	0,95%
Clase de acumulación I USD	0,95%	0,95%
Clase de reparto I2 USD	0,79%	0,79%
Clase de reparto I5 USD	0,58%	0,58%
Clase de acumulación Z USD	0,20%	0,20%

Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund

Clase de acumulación A EUR	2,13%	1,98%
Clase de acumulación I EUR	1,10%	1,10%
Clase de acumulación sin cobertura I EUR	1,16%	1,11%
Clase de acumulación sin cobertura M EUR	2,90%	2,78%
Clase de acumulación A USD	2,11%	1,97%
Clase de acumulación C1 USD	3,10%	2,98%
Clase de acumulación I USD	1,22%	1,12%
Clase de reparto I USD	1,39%	1,14%
Clase de acumulación M USD	2,79%	2,76%
Clase de acumulación X USD	1,82%	1,79%

Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund

Clase de acumulación U CHF	0,42%	0,39%
Clase de acumulación A EUR	0,45%	0,45%
Clase de acumulación I EUR	0,32%	0,29%
Clase de reparto I EUR	0,32%	0,29%
Clase de acumulación I2 EUR	0,29%	0,25%
Clase de acumulación I5 EUR	0,22%	0,19%
Clase de acumulación U EUR	0,40%	0,39%
Clase de acumulación Z EUR	0,12%	0,10%
Clase de acumulación Z USD	0,14%	0,10%

Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund

Clase de acumulación I EUR	1,67%	0,55%
Clase de reparto I EUR	1,66%	0,55%

Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund

Clase de acumulación I EUR	0,95%	0,65%
Clase de reparto I EUR	0,96%	0,65%
Clase de acumulación I5 EUR	0,74%	0,43%
Clase de acumulación Z USD	0,51%	0,20%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2021 (cont.)

Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación I EUR	1,41%	0,80%
Clase de acumulación M EUR	2,68%	2,10%
Clase de acumulación Z GBP	0,86%	0,20%
Clase de acumulación I SEK	1,28%	0,80%
Clase de reparto I SEK	1,42%	0,80%
Clase de acumulación I USD	1,46%	0,80%
Clase de acumulación X USD	1,02%	0,40%
Clase de acumulación Z USD	0,85%	0,20%

Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund¹

Clase de acumulación I USD	1,73%	0,80%
Clase de reparto I USD	1,75%	0,80%
Clase de acumulación X USD	1,51%	0,40%
Clase de acumulación Y USD	1,07%	0,37%

Neuberger Berman 5G Connectivity Fund¹

Clase de acumulación A AUD	1,80%	1,80%
Clase de acumulación A CNY	1,80%	1,80%
Clase de acumulación A EUR	1,80%	1,80%
Clase de acumulación sin cobertura A EUR	1,80%	1,80%
Clase de acumulación I EUR	0,95%	0,95%
Clase de acumulación sin cobertura I EUR	0,96%	0,96%
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	1,80%	1,80%
Clase de acumulación sin cobertura I GBP	0,95%	0,95%
Clase de acumulación A HKD	1,80%	1,80%
Clase de acumulación A SGD	1,80%	1,80%
Clase de acumulación A USD	1,80%	1,80%
Clase de acumulación I USD	0,96%	0,96%
Clase de reparto I USD	0,96%	0,96%
Clase de acumulación I2 USD	0,78%	0,78%
Clase de acumulación I3 USD	0,70%	0,70%
Clase de acumulación I5 USD	0,53%	0,53%
Clase de acumulación M USD	2,62%	2,62%
Clase de acumulación Z USD	0,10%	0,10%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2021 (cont.)

Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund¹

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación I JPY	1,93%	1,15%
Clase de reparto I JPY	2,54%	1,15%
Clase de acumulación I5 JPY	0,88%	0,73%
Clase de acumulación Z JPY	0,47%	0,30%

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund¹

Clase de acumulación I5 CAD	0,40%	0,40%
Clase de acumulación I EUR	0,70%	0,70%
Clase de acumulación I5 EUR	0,41%	0,41%
Clase de acumulación M EUR	2,12%	2,12%
Clase de acumulación I5 GBP	0,40%	0,40%
Clase de acumulación A USD	1,30%	1,30%
Clase de acumulación I USD	0,70%	0,70%
Clase de reparto I USD	0,71%	0,71%
Clase de acumulación M USD	2,12%	2,12%
Clase de acumulación Z USD	0,12%	0,12%

Neuberger Berman Global Diversified Income FMP – 2024¹

Clase de acumulación A EUR	0,88%	0,88%
Clase de reparto A EUR	0,88%	0,88%
Clase de reparto I EUR	0,48%	0,48%
Clase de reparto I GBP	0,48%	0,48%
Clase de reparto A HKD	0,88%	0,88%
Clase de reparto A SGD	0,88%	0,88%
Clase de acumulación A USD	0,88%	0,88%
Clase de reparto A USD	0,88%	0,88%
Clase de acumulación I USD	0,48%	0,48%
Clase de reparto I USD	0,49%	0,48%
Clase de acumulación X USD	0,53%	0,53%
Clase de reparto X USD	0,53%	0,53%

Neuberger Berman China A-Share Equity Fund¹

Clase de acumulación I CNY	6,45%	1,20%
Clase de acumulación sin cobertura I USD	9,90%	1,20%
Clase de reparto sin cobertura I USD	10,68%	1,20%

Anexo I (cont.)

RATIOS DE GASTOS TOTALES (CONT.)

30 de junio de 2021 (cont.)

Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund²

Clase de Acciones	TER porcentual anualizado (Sin renuncia a comisiones)	TER porcentual anualizado (Con renuncia a comisiones)
Clase de acumulación I EUR	2,58%	0,80%
Clase de reparto I EUR	2,77%	0,80%
Clase de acumulación M EUR	4,48%	2,50%
Clase de acumulación Z EUR	1,96%	0,20%
Clase de acumulación sin cobertura A USD	3,50%	1,70%
Clase de acumulación sin cobertura I USD	2,61%	0,80%
Clase de acumulación sin cobertura M USD	4,34%	2,50%

Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund²

Clase de acumulación sin cobertura I5 EUR	1,26%	0,50%
Clase de acumulación sin cobertura M EUR	3,31%	2,50%
Clase de acumulación sin cobertura Z EUR	0,86%	0,20%
Clase de acumulación sin cobertura I GBP	1,47%	0,80%
Clase de acumulación sin cobertura I5 GBP	1,17%	0,50%
Clase de acumulación I USD	1,51%	0,80%
Clase de reparto I USD	1,60%	0,80%
Clase de acumulación M USD	3,27%	2,50%

¹ Cartera lanzada durante el ejercicio contable anterior.² Cartera lanzada durante el actual periodo contable.

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 30 de junio de 2021, las siguientes Carteras mantenían swaps de rentabilidad total como tipos de instrumento en el ámbito de aplicación del Reglamento sobre operaciones de financiación de valores:

Neuberger Berman High Yield Bond Fund
 Neuberger Berman Strategic Income Fund
 Neuberger Berman US Long Short Equity Fund
 Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund
 Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund
 Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund
 Neuberger Berman CLO Income Fund
 Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund

Neuberger Berman High Yield Bond Fund

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en swaps de rentabilidad total a 30 de junio de 2021 es el siguiente:

Tipo de activo	Importe en USD	Proporción del VL (%)
Swaps de rentabilidad total - Activos	647.530	0,02

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 cualquier garantía de efectivo reutilizada.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2021, 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 2021 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en USD
JPMorgan Chase Bank	647.530

Custodia de la garantía recibida:

A 30 de junio de 2021, 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 o recibidas para el conjunto de los swaps de rentabilidad total a 30 de junio de 2021 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							
JPMorgan Chase Bank	Garantía en efectivo	(340.000)	N/A	N/A	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.

** No existe calificación crediticia para los activos o los pasivos en efectivo. 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 todas las posiciones de swaps de rentabilidad total a 30 de junio de 2021 se situaba entre 1 y 3 meses.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (cont.)

Custodia de la garantía otorgada:

No existían garantías mantenidas en cuentas separadas, conjuntas o de otro tipo a 30 de junio de 2021.

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 periodo analizado.

Neuberger Berman Strategic Income Fund

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en swaps de rentabilidad total a 30 de junio de 2021 es el siguiente:

Tipo de activo	Importe en USD	Proporción del VL (%)
Swaps de rentabilidad total – Activos	869.925	0,06

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 cualquier garantía de efectivo reutilizada.

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2021, 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 2021 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en USD
Goldman Sachs International	292.769
JPMorgan Chase Bank	577.156

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Neuberger Berman Strategic Income Fund (cont.)

Custodia de la garantía recibida:

A 30 de junio de 2021, 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 o recibidas para el conjunto de los swaps de rentabilidad total a 30 de junio de 2021 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	5.710.000	N/A	N/A	USD	Reino Unido	OTC
JPMorgan Chase Bank	Garantía en efectivo	(880.000)	N/A	N/A	USD	Estados Unidos	OTC

El vencimiento de las posiciones en swaps de rentabilidad total a 30 de junio de 2021 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	-	-	-	713.757	-	156.168	-
Swaps de rentabilidad total - Pasivos	-	-	-	-	-	-	-

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Neuberger Berman Strategic Income Fund (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 2021 es la siguiente:

	%
Cuentas separadas	0%
Cuentas conjuntas	0%
Otras	100%
	100%

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 periodo analizado.

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en swaps de rentabilidad total a 30 de junio de 2021 es el siguiente:

Tipo de activo	Importe en USD	Proporción del VL (%)
Swaps de rentabilidad total – Pasivos	18.439.679	3,90

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 cualquier garantía de efectivo reutilizada.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (cont.)

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2021, 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 2021 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en USD
Goldman Sachs International	1.421.956
JPMorgan Chase Bank	17.017.723

Custodia de la garantía recibida:

A fecha de 30 de junio de 2021, 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 2021 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	2.040.000	N/A	N/A	USD	Reino Unido	OTC
JPMorgan Chase Bank	Garantía en efectivo	25.710.000	N/A	N/A	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.

** No existe calificación crediticia para los activos o los pasivos en efectivo. 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.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (cont.)

Datos agregados de las operaciones (cont.):

El vencimiento de las posiciones en swaps de rentabilidad total a 30 de junio de 2021 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	-	-	-	-	-	-	-
Swaps de rentabilidad total - Pasivos	-	-	-	5.924.097	11.169.052	1.346.530	-

Custodia de la garantía otorgada:

La proporción de la garantía mantenida en cuentas separadas, conjuntas o de otro tipo a 30 de junio de 2021 es la siguiente:

	%
Cuentas separadas	0%
Cuentas conjuntas	0%
Otras	100%
	100%

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 periodo analizado.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en swaps de rentabilidad total a 30 de junio de 2021 es el siguiente:

Tipo de activo	Importe en USD	Proporción del VL (%)
Swaps de rentabilidad total – Activos	7.655	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 cualquier garantía de efectivo reutilizada.

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2021, 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 2021 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en USD
Citibank NA	7.655

Custodia de la garantía recibida:

A fecha de 30 de junio de 2021, el Depositario no había recibido ni mantenía garantía alguna.

Datos agregados de las transacciones:

A 30 de junio de 2021 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 2021 se situaba entre 3 meses y 1 año.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (cont.)

Custodia de la garantía otorgada:

No existían garantías mantenidas en cuentas separadas, conjuntas o de otro tipo a 30 de junio de 2021.

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 periodo analizado.

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en swaps de rentabilidad total a 30 de junio de 2021 es el siguiente:

Tipo de activo	Importe en USD	Proporción del VL (%)
Swaps de rentabilidad total - Activos	3.387	0,02
Swaps de rentabilidad total - Pasivos	2.292	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 cualquier garantía de efectivo reutilizada.

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2021, 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 2021 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en USD
Goldman Sachs International	5.679

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (cont.)

Custodia de la garantía recibida:

A fecha de 30 de junio de 2021, el Depositario no había recibido ni mantenía garantía alguna.

Datos agregados de las transacciones:

A 30 de junio de 2021 no había posiciones de garantías (incluido el efectivo) pignoradas o (recibidas) para todos los swaps de rentabilidad total.

El vencimiento de las posiciones en swaps de rentabilidad total a 30 de junio de 2021 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	-	-	-	3.387	-	-	-
Swaps de rentabilidad total - Pasivos	-	-	-	2.292	-	-	-

Custodia de la garantía otorgada:

No existían garantías mantenidas en cuentas separadas, conjuntas o de otro tipo a 30 de junio de 2021.

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 periodo analizado.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en swaps de rentabilidad total a 30 de junio de 2021 es el siguiente:

Tipo de activo	Importe en USD	Proporción del VL (%)
Swaps de rentabilidad total – Activos	1.046.587	0,06
Swaps de rentabilidad total – Pasivos	5.734.388	0,28

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 cualquier garantía de efectivo reutilizada.

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2021, 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 2021 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en USD
Goldman Sachs International	865.776
JPMorgan Chase Bank	858.233
Morgan Stanley	5.056.966

Custodia de la garantía recibida:

A 30 de junio de 2021, 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.)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (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 2021 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	(3.486.902)	N/A	N/A	USD	Reino Unido	OTC
Morgan Stanley	Garantía en efectivo	1.900.000	N/A	N/A	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.

** No existe calificación crediticia para los activos o los pasivos en efectivo. 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 2021 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	-	-	-	-	130.452	916.135	-
Swaps de rentabilidad total - Pasivos	-	-	-	-	24.748	5.709.640	-

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (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 2021 es la siguiente:

	%
Cuentas separadas	0%
Cuentas conjuntas	0%
Otras	100%
	100%

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 periodo analizado.

Neuberger Berman CLO Income Fund

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en swaps de rentabilidad total a 30 de junio de 2021 es el siguiente:

Tipo de activo	Importe en USD	Proporción del VL (%)
Swaps de rentabilidad total – Activos	62.113	0,05

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 cualquier garantía de efectivo reutilizada.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Neuberger Berman CLO Income Fund (cont.)

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2021, 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 2021 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en USD
Goldman Sachs International	62.113

Custodia de la garantía recibida:

A fecha de 30 de junio de 2021, el Depositario no había recibido ni mantenía garantía alguna.

Datos agregados de las transacciones:

A 30 de junio de 2021 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 2021 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 2021.

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 periodo analizado.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund

Datos globales:

El importe de los activos invertidos en swaps de rentabilidad total a 30 de junio de 2021 es el siguiente:

Tipo de activo	Importe en USD	Proporción del VL (%)
Swaps de rentabilidad total – Activos	458.246	0,08

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 cualquier garantía de efectivo reutilizada.

Datos sobre concentración:

A 30 de junio de 2021, 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 2021 eran las siguientes:

Contraparte	Importe en USD
Goldman Sachs International	318.252
JPMorgan Chase Bank	139.994

Custodia de la garantía recibida:

A fecha de 30 de junio de 2021, el Depositario no había recibido ni mantenía garantía alguna.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund (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 2021 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	6.830.000	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.

** No existe calificación crediticia para los activos o los pasivos en efectivo. 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 2021 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	-	-	-	271.430	-	186.816	-
Swaps de rentabilidad total - Pasivos	-	-	-	-	-	-	-

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund (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 2021 es la siguiente:

	%
Cuentas separadas	0%
Cuentas conjuntas	0%
Otras	100%
	100%

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 periodo analizado.

A 30 de junio de 2021, las siguientes Carteras habían participado en operaciones de préstamo de valores:

Neuberger Berman High Yield Bond Fund
 Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund
 Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund
 Neuberger Berman Strategic Income Fund
 Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund
 Neuberger Berman European High Yield Bond Fund
 Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund
 Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund
 Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund
 Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund
 Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund

Durante el semestre finalizado el 30 de junio de 2021, Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund, Neuberger Berman Global Bond Fund, Neuberger Berman Emerging Market Corporate Debt Fund, Neuberger Berman US Long Short Equity Fund, Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund, Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund, Neuberger Berman Asian Debt - Hard Currency Fund, Neuberger Berman China Bond Fund, Neuberger Berman Multi-Style Premia Fund y Neuberger Berman Global Flexible Credit Fund participaron en operaciones de préstamo de valores, pero a 30 de junio de 2021 no tenían ningún valor en préstamo.

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Datos globales:

Importe de los títulos cedidos en préstamo

A continuación se indica el valor total de los títulos cedidos en préstamo como proporción de los activos totales susceptibles de préstamo de las Carteras a 30 de junio de 2021.

Cartera	% de activos totales susceptibles de préstamo
Neuberger Berman High Yield Bond Fund	2,06%
Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund	0,77%
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund	0,01%
Neuberger Berman Strategic Income Fund	0,40%
Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	0,01%
Neuberger Berman European High Yield Bond Fund	1,90%
Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund	0,89%
Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund	1,16%
Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund	0,26%
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	1,53%
Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund	0,65%

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Datos globales (cont.):

Importe de los activos comprometidos en operaciones de préstamo de valores

En la siguiente tabla se recoge el valor total de los activos comprometidos en operaciones de préstamo de valores a 30 de junio de 2020:

Cartera	Moneda de la cartera	Valor de mercado de los títulos cedidos en préstamo	Proporción del VL (%)
Neuberger Berman High Yield Bond Fund	USD	60.831.541	1,81%
Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund	USD	4.872.419	0,74%
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund	USD	273.964	0,01%
Neuberger Berman Strategic Income Fund	USD	7.583.144	0,56%
Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	USD	517.595	0,01%
Neuberger Berman European High Yield Bond Fund	EUR	685.585	2,09%
Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund	EUR	15.388.177	0,70%
Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund	USD	858.675	1,08%
Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund	USD	232.502	0,24%
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	EUR	6.223.466	0,88%
Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund	EUR	204.885	0,42%

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Datos sobre concentración:

Diez principales emisores de garantías

En las siguientes tablas se recogen los diez principales emisores por valor de garantías distintas del efectivo recibidas por las Carteras en las operaciones de préstamo de valores a 30 de junio de 2021:

Neuberger Berman High Yield Bond Fund

Emisor	Valor de la garantía distinta del efectivo USD
United States Government	63.884.300

Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund

Emisor	Valor de la garantía distinta del efectivo USD
United States Government	5.116.614

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund

Emisor	Valor de la garantía distinta del efectivo USD
United States Government	287.680

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Datos sobre concentración (cont.)

Diez principales emisores de garantías (cont.)

Neuberger Berman Strategic Income Fund

Emisor	Valor de la garantía distinta del efectivo USD
United States Government	6.848.317
Gobierno de los Países Bajos	1.115.029
Gobierno de Francia	106

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund

Emisor	Valor de la garantía distinta del efectivo USD
United States Government	543.620

Neuberger Berman European High Yield Bond Fund

Emisor	Valor de la garantía distinta del efectivo EUR
Gobierno de Alemania	286.865
Gobierno de Francia	286.734
United States Government	146.261
Gobierno de los Países Bajos	50

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Datos sobre concentración (cont.)

Diez principales emisores de garantías (cont.)

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund

Emisor	Valor de la garantía distinta del efectivo EUR
United States Government	16.161.924

Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund

Emisor	Valor de la garantía distinta del efectivo USD
United States Government	901.837

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund

Emisor	Valor de la garantía distinta del efectivo USD
United States Government	244.193

Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund

Emisor	Valor de la garantía distinta del efectivo EUR
United States Government	6.535.354

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Datos sobre concentración (cont.)

Diez principales emisores de garantías (cont.)

Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund

Emisor	Valor de la garantía distinta del efectivo EUR
Gobierno de los Países Bajos	215.123
Gobierno de Francia	20

Diez principales contrapartes

En la siguiente tabla se recogen las diez principales contrapartes de las operaciones de préstamo de valores a 30 de junio de 2021:

Cartera	Contraparte	Valor de mercado de los títulos cedidos en préstamo	Proporción del VL (%)
Neuberger Berman High Yield Bond Fund	Barclays Capital Securities Ltd	33.436.582 USD	1,00%
	Goldman Sachs International	27.394.959 USD	0,82%
Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund	Barclays Capital Securities Ltd	1.203.733 USD	0,18%
	Goldman Sachs International	3.668.686 USD	0,56%
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund	Goldman Sachs International	273.964 USD	0,01%
Neuberger Berman Strategic Income Fund	Barclays Capital Securities Ltd	3.044.757 USD	0,22%
	Goldman Sachs International	3.476.421 USD	0,26%
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	1.061.966 USD	0,08%
Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	Barclays Capital Securities Ltd	517.595 USD	0,01%
Neuberger Berman European High Yield Bond Fund	Goldman Sachs International	139.199 EUR	0,42%
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	546.386 EUR	1,67%
Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund	Barclays Capital Securities Ltd	15.388.177 EUR	0,70%
Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund	Barclays Capital Securities Ltd	795.521 USD	1,01%
	Goldman Sachs International	63.154 USD	0,08%
Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund	Barclays Capital Securities Ltd	232.502 USD	0,24%
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	Barclays Capital Securities Ltd	1.450.195 EUR	0,20%
	Goldman Sachs International	4.773.271 EUR	0,67%
Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	204.885 EUR	0,42%

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Datos agregados de las transacciones:

Tipo y calidad de la garantía

Las garantías recibidas por las Carteras en relación con las operaciones de préstamo de valores a 30 de junio de 2021 son en forma de títulos de deuda con calificación crediticia de grado de inversión.

Vencimiento de la garantía

En la tabla siguiente se recoge un análisis del vencimiento de las garantías recibidas en relación con las operaciones de préstamo de valores a 30 de junio de 2021.

Cartera	Garantía en efectivo		Garantía distinta del efectivo			
	menos de 1 día	1 a 7 días	1 a 4 semanas	1 a 3 meses	3 a 12 meses	más de 1 año
Neuberger Berman High Yield Bond Fund	-	-	-	-	-	63.884.300 USD
Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund	-	-	-	-	-	5.116.614 USD
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund	-	-	-	-	-	287.680 USD
Neuberger Berman Strategic Income Fund	-	-	-	-	1.115.029 USD	6.848.423 USD
Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	-	-	-	-	-	543.620 USD
Neuberger Berman European High Yield Bond Fund	-	-	-	-	10 EUR	719.900 EUR
Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund	-	-	-	-	-	16.161.924 EUR
Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund	-	-	-	-	-	901.837 USD
Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund	-	-	-	-	-	244.193 USD
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	-	-	-	-	-	6.535.354 EUR
Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund	-	-	-	-	215.123 EUR	20 EUR

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Datos agregados de las operaciones (cont.):

Moneda de la garantía

En la tabla siguiente se recoge la moneda de las garantías recibidas en relación con las operaciones de préstamo de valores a 30 de junio de 2021.

Cartera	Divisa	Valor de la garantía	
		EUR	USD
Neuberger Berman High Yield Bond Fund	USD	-	63.884.300
Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund	USD	-	5.116.614
Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund	USD	-	287.680
Neuberger Berman Strategic Income Fund	USD	1.115.134	6.848.318
Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	USD	-	543.620
Neuberger Berman European High Yield Bond Fund	EUR	573.649	146.261
Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund	EUR	-	16.161.924
Neuberger Berman Global High Yield Bond Fund	USD	-	901.837
Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund	USD	-	244.193
Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	EUR	-	6.535.354
Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund	EUR	215.143	-

Vencimiento de los contratos de préstamo de valores

Las operaciones de préstamo de valores de la Sociedad tienen un vencimiento abierto.

País de establecimiento de las contrapartes

En la siguiente tabla se recogen los datos del país de constitución de las contrapartes en las operaciones de préstamo de valores:

Contraparte	País de constitución
Barclays Capital Securities Ltd	Reino Unido
Credit Suisse Securities (Europe) Ltd	Reino Unido
Goldman Sachs International	Reino Unido

Anexo II (cont.)

REGLAMENTO SOBRE OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES (CONT.)

Datos agregados de las operaciones (cont.):

Liquidación y compensación

Todas las carteras que participan en contratos de préstamo de valores utilizan el sistema tripartito de liquidación y compensación.

Reutilización de la garantía

A 30 de junio de 2021, la Sociedad no había recibido garantías en efectivo en relación con las operaciones de préstamo de valores. Las garantías distintas del efectivo no pueden venderse, pignorarse o reinvertirse.

Custodia de la garantía

Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited, el Depositario, custodia las garantías, en su caso.

Garantía otorgada

A 30 de junio de 2021 no se habían otorgado garantías en relación con las operaciones de préstamo de valores.

Rentabilidad y coste

Las Carteras que participen en operaciones de préstamo de valores percibirán todos los ingresos que estas generen, una vez deducidos los costes operativos directos e indirectos, lo que supondrá el 90% de los ingresos totales generados. El 10% restante se abonará al Agente de préstamo en concepto de retribución por los costes operativos directos e indirectos derivados de la prestación de sus servicios y la garantía que otorgue. Los ingresos por préstamo de valores que perciban las Carteras durante el período se reflejan por separado en la Cuenta de pérdidas y ganancias.

Anexo III

GLOSARIO DE ÍNDICES

Bloomberg Barclays Euro Aggregate Bond Index (Total Return, Hedged, EUR)

El índice es un índice de referencia que mide la rentabilidad del mercado de bonos de tipo fijo denominados en euros y con categoría de inversión, incluyendo bonos de deuda pública, relacionados con el gobierno, corporativos y emisiones titulizadas. La inclusión en el índice se basa en la divisa en la que está denominado un bono y no en el país de riesgo del emisor.

Bloomberg Barclays 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 Barclays US Aggregate Bond Index, el Bloomberg Barclays Pan-European Aggregate Bond Index y el Bloomberg Barclays Asian-Pacific Aggregate Index. Además de los valores de estos tres índices, el Bloomberg Barclays Global Aggregate Index 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 Barclays Global Aggregate Index (Total Return, USD Hedged)

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 Barclays US Aggregate Bond Index, el Bloomberg Barclays Pan-European Aggregate Bond Index y el Bloomberg Barclays Asian-Pacific Aggregate Index. Además de los valores de estos tres índices, el Bloomberg Barclays Global Aggregate Index 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 dólares estadounidenses.

Bloomberg Barclays 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 ("MBS") (bonos de titulización hipotecaria pass-through de tipo ajustable ("ARM"), tanto de tipo fijo como híbridas, emitidos por agencia), valores respaldados por activos ("ABS") y valores respaldados por hipotecas comerciales ("CMBS") (emitidos y no emitidos por agencia)

CBOE MSCI EAFE PutWrite Index

El índice se ha diseñado para reproducir la evolución de una estrategia de inversión pasiva hipotética que cobra primas por la suscripción de una opción de venta at the money (ATM) sobre el índice MXEA con periodicidad mensual y mantiene una cuenta del mercado monetario renovable invertida en letras del Tesoro a un mes para cubrir el pasivo derivado de la posición en la opción de venta en corto sobre el MXEA. El índice es un índice de rentabilidad total que se reequilibra mensualmente.

CBOE MSCI Emerging Markets PutWrite Index

El índice se ha diseñado para reproducir la evolución de una estrategia de inversión pasiva hipotética que cobra primas por la suscripción de una opción de venta at the money (ATM) sobre el índice MXEF con periodicidad mensual y mantiene una cuenta del mercado monetario renovable invertida en letras del Tesoro a un mes para cubrir el pasivo derivado de la posición en la opción de venta en corto sobre el MXEF. El índice es un índice de rentabilidad total que se reequilibra mensualmente.

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.

Anexo III (cont.)

GLOSARIO DE ÍNDICES (CONT.)

CBOE Russell 2000 One-Week PutWrite Index	El índice sigue la rentabilidad de una estrategia hipotética que vende una opción de venta sobre el Russell 2000 Index at-the-money semanalmente. La opción de venta sobre el Russell 2000 suscrita tiene vencimiento a una semana. La opción de venta sobre el Russell 2000 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.
CBOE Russell 2000 PutWrite Index	El índice sigue una estrategia hipotética de opciones de venta a corto plazo que vende una opción de venta sobre el Russell 2000 at-the-Money mensualmente. La opción de venta sobre el Russell 2000 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 (CNY, Total Return)	El índice incluye bonos de deuda pública china de tipo fijo anotados en cuenta con un vencimiento inicial superior a un año e inferior o igual a siete años, bonos de tipo fijo emitidos por los tres bancos institucionales chinos con un vencimiento inicial superior a un año e igual o inferior a siete años y bonos chinos de tipo fijo y cupón cero con un vencimiento inicial igual o inferior a un año. 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 Index (USD Total Return, Net of Tax)	El índice está diseñado para representar las tendencias generales de las acciones inmobiliarias admisibles de todo el mundo. Las actividades relevantes se definen como sigue: propiedad, venta y construcción de inmuebles generadores de rentas. Las series de índices abarcan índices globales, de países desarrollados y emergentes, así como el mercado AIM del Reino Unido. El FTSE EPRA Nareit Global Index está diseñado para reproducir la rentabilidad de sociedades inmobiliarias cotizadas y REIT tanto de mercados desarrollados como emergentes.
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 fondos de inversión inmobiliarios (REIT) de capital estadounidenses cotizados 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	El índice comprende estrategias de cobertura de renta variable. Estas estrategias mantienen posiciones tanto largas como cortas, fundamentalmente en valores de renta variable y derivados de renta variable. Para adoptar una decisión de inversión se pueden utilizar muchos procesos de inversión distintos, incluidas técnicas tanto cuantitativas como fundamentales; las estrategias pueden estar muy diversificadas o muy centradas en sectores concretos y pueden presentar grandes oscilaciones en términos de niveles de exposición neta, apalancamiento utilizado, periodo de tenencia, concentraciones de capitalizaciones bursátiles y rangos de valoración de las carteras típicas. 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%. Los fondos integrantes se seleccionan de un conjunto admisible de más de 7.500 fondos de todo el mundo que presentan información a la base de datos Hedge Fund Research ("HFR"). Los fondos integrantes deben satisfacer todos los criterios siguientes: presentar información con una periodicidad mensual; comunicar la rentabilidad con todas las comisiones descontadas; estar denominados en dólares estadounidenses; ser activos y aceptar nuevas inversiones; tener un historial mínimo de 24 meses; y el gestor del fondo debe tener al menos 50 millones de USD de activos gestionados. El índice se reequilibra con una periodicidad trimestral.

Anexo III (cont.)

GLOSARIO DE ÍNDICES (CONT.)

HFRX Global Hedge Fund Index (USD)

El índice está diseñado para ser representativo de la composición general del universo de los hedge funds. Comprende todas las estrategias de hedge funds admisibles, incluyendo, a título meramente enunciativo, el arbitraje de bonos convertibles, valores en mora, cobertura de renta variable, estrategias neutrales en renta variable, basadas en acontecimientos especiales, macroeconómicas, arbitraje de fusiones y arbitraje de valor relativo. La ponderación de los activos en las estrategias se basa en la distribución de activos en la industria de los hedge funds. Los fondos integrantes se seleccionan de un conjunto admisible de más de 7.500 fondos de todo el mundo que presentan información a la base de datos Hedge Fund Research ("HFR"). Los fondos integrantes deben satisfacer todos los criterios siguientes: presentar información con una periodicidad mensual; comunicar la rentabilidad con todas las comisiones descontadas; estar denominados en dólares estadounidenses; ser activos y aceptar nuevas inversiones; tener un historial mínimo de 24 meses; y el gestor del fondo debe tener al menos 50 millones de USD de activos gestionados. El índice se reequilibra con una periodicidad trimestral.

ICE BofA European Currency Non-Financial High Yield 3% Constrained Index (Total Return, EUR)

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%. Los componentes del índice están ponderados por capitalización, basándose en su capital circulante actual, y la asignación total a un emisor individual no deberá superar el 3%. Los emisores que exceden de esta cifra se limitan al 3% y el valor nominal de cada uno de sus bonos se ajusta de forma proporcional. De forma similar, los valores nominales de los bonos de todos los demás emisores que se sitúan por debajo del límite del 3% se incrementan de forma proporcional. En caso de que haya menos de 34 emisores en el índice, se les asigna una ponderación equitativa a cada uno de ellos y los valores nominales de sus respectivos bonos se incrementan o reducen de forma proporcional.

ICE BofA Global High Yield Constrained Index (Total Return, Hedged, USD)

El índice contiene todos los valores del ICE BofA Global High Yield Index, pero con un límite de exposición al emisor del 2%. Los componentes del índice están ponderados por capitalización, basándose en su capital circulante actual, y la asignación total a un emisor individual no deberá superar el 2%. Los emisores que exceden de esta cifra se limitan al 2% y el valor nominal de cada uno de sus bonos se ajusta de forma proporcional. De forma similar, los valores nominales de los bonos de todos los demás emisores que se sitúan por debajo del límite del 2% se incrementan de forma proporcional. En caso de que haya menos de 50 emisores en el índice, se les asigna una ponderación equitativa a cada uno de ellos y los valores nominales de sus respectivos bonos se incrementan o reducen de forma proporcional.

ICE BofA Global Hybrid Non-Financial 5% Constrained Custom Index (EUR Total Return, Hedged)

El índice reproduce la rentabilidad de la deuda corporativa híbrida no financiera con categoría de inversión emitida por suscripción pública en los principales mercados domésticos y de eurobonos. El índice se calcula en función de la rentabilidad total. Se puede solicitar más información para obtener una descripción completa del índice de referencia.

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 Libor hasta un vencimiento prefijado. El índice 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 categoría 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 una exposición al riesgo de los países de las divisas del G10, Europa Occidental o territorios de Estados Unidos y Europa Oriental. Los valores en situación de impago están excluidos del índice. Los componentes del índice están ponderados por capitalización y la asignación total a un emisor individual no deberá superar el 2%.

Anexo III (cont.)

GLOSARIO DE ÍNDICES (CONT.)

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.

El índice 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 categoría 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. Para ser considerado para su inclusión, el país deberá formar parte de la zona euro al comienzo del mes.

ICE BofA 0-3 Month US Treasury Bill Index

El ICE BofA 0-3 Month US Treasury Bill Index es un subconjunto del ICE BofA US Treasury Bill Index que incluye todos los valores con un plazo hasta el vencimiento inferior a tres meses.

El ICE BofA US Treasury Bill Index reproduce la rentabilidad de los bonos del Tesoro a corto plazo denominados en dólares estadounidenses emitidos por suscripción pública en el mercado doméstico de Estados Unidos. Los valores admisibles deben tener un plazo hasta el vencimiento de al menos un mes y un capital circulante mínimo de 1.000 millones de USD. Se excluyen los valores emitidos o comercializados principalmente para inversores minoristas. Los componentes del índice están ponderados por capitalización de mercado. El interés devengado se calcula suponiendo la fecha de liquidación del día siguiente. Los flujos de efectivo de los pagos de los bonos que se reciben durante el mes se retienen en el índice hasta el cierre del periodo y a continuación se retiran dentro del proceso de reequilibrio. El efectivo no genera ningún ingreso por reinversión mientras se retiene en el índice. La información relativa a los precios de los bonos que forman parte del índice, los plazos y convenios se facilita en la BofA Bond Index Guide, a la que se puede acceder desde nuestra página web de acceso público (<https://indices.theice.com>). Alternativamente, esta información se puede obtener enviando una solicitud a iceindices@theice.com. El reequilibrio del índice se produce el último día natural del mes, en función de la información disponible hasta el tercer día hábil (inclusive) anterior al último día hábil del mes. Para que puedan ser consideradas para el siguiente mes, las emisiones nuevas se deben liquidar como máximo en la fecha de reequilibrio del cierre del mes natural. No se pueden introducir cambios en las posiciones en cartera salvo en las fechas de reequilibrio del cierre del mes.

ICE BofA 3-Month US Treasury Bill Index

El índice se compone de una única emisión comprada al comienzo del mes y mantenida durante la totalidad del periodo. Al cierre del mes la emisión se vende y se pasa a una nueva emisión seleccionada. La emisión seleccionada en cada proceso de reequilibrio al cierre del mes es la letra del Tesoro a corto plazo circulante con vencimiento más próximo (pero no superior) a un periodo de tres meses desde la fecha de reequilibrio.

JP Morgan Asia Credit Index (Total Return, USD) (JACI)

El índice reproduce la rentabilidad total de instrumentos de deuda denominados en dólares estadounidenses y negociados de forma activa en la región de Asia (excluyendo Japón). The JP Morgan Asia Credit Index ("JACI") reproduce la rentabilidad total del mercado asiático de bonos de tipo fijo denominados en dólares. 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. El índice se calcula en función de la rentabilidad total. Se puede solicitar más información para obtener una descripción completa del índice de referencia.

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.

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.

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 están ponderada por capitalización bursátil y la ponderación máxima de un país está limitada al 10%.

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 49 índices de países (23 desarrollados y 26 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: Argentina, Brasil, Chile, China, Colombia, República Checa, Egipto, Grecia, Hungría, India, Indonesia, Corea, Malasia, México, Pakistán, Perú, Filipinas, Polonia, Catar, Rusia, Arabia Saudita, Sudáfrica, Taiwán, Tailandia, Turquía y los EAU. Las acciones A chinas se incluyen a partir del 1 de junio de 2018 y están parcialmente representadas al 15% de su capitalización bursátil ajustada por flotación libre desde agosto 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.

MSCI China A Onshore Index (Total Return, CNY)

El índice está integrado por empresas de gran y mediana capitalización de China que cotizan en las Bolsas de Shanghai y Shenzhen. El índice se basa en la metodología de los índices MSCI Global Investable Market Indexes ("GIMI"), un enfoque completo y sistemático para la construcción de índices que proporciona una perspectiva global de las diferentes regiones, así como de las variaciones de las capitalizaciones bursátiles, sectores y estilos. Esta metodología pretende proporcionar cobertura exhaustiva del conjunto de oportunidades de inversión relevante, prestando especial atención a la liquidez del índice, la idoneidad para la inversión y para la replicación. El índice se revisa con una periodicidad trimestral (en febrero, mayo, agosto y noviembre), con el fin de reflejar la evolución de los mercados de renta variable subyacentes de forma oportuna y limitando, al mismo tiempo, una rotación innecesaria en el índice.

Anexo III (cont.)

GLOSARIO DE ÍNDICES (CONT.)

MSCI China Net Index

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 valores chinos fácilmente accesibles para inversores no nacionales. El índice incluye valores de renta variable emitidos por empresas constituidas en la República Popular China ("RPC") y cotizados en forma de acciones B chinas en la Bolsa de Shanghai (en USD) en la Bolsa de Shenzhen (en HKD) o acciones H chinas cotizadas en la Bolsa de Hong Kong (en HKD) y en otros mercados extranjeros. También incluye Red-Chips y P-Chips, que son empresas no constituidas en la RPC y que cotizan en la Bolsa de Hong Kong. Las Red-Chips incluyen empresas directa o indirectamente controladas por organizaciones o sociedades que son propiedad del Estado, de provincias o municipios de la RPC. Las P-Chips incluyen sociedades chinas de titularidad no estatal constituidas fuera de China continental y negociadas en Hong Kong. El índice comprende acciones chinas cotizadas en Estados Unidos.

Las acciones A chinas se incluyen a partir del 1 de junio de 2018 y están parcialmente representadas al 15% de su capitalización bursátil ajustada por flotación libre. A partir de agosto 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.

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 países emergentes. El índice se compone de los siguientes 26 índices de países de mercados emergentes: Argentina, Brasil, Chile, China, Colombia, República Checa, Egipto, Grecia, Hungría, India, Indonesia, Corea, Malasia, México, Pakistán, Perú, Filipinas, Polonia, Catar, Rusia, Arabia Saudita, Sudáfrica, Taiwán, Tailandia, Turquía y los EAU. Las acciones A chinas se incluyen a partir del 1 de junio de 2018 y están parcialmente representadas al 15% de su capitalización bursátil ajustada por flotación libre desde agosto 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.

MSCI Europe Index (Total Return, Net of Tax, EUR)

El MSCI Europe Index está integrado por empresas de gran y mediana capitalización de 15 países ubicados en mercados desarrollados (MD) de Europa*. Con 434 componentes, el índice comprende aproximadamente el 85% de la capitalización bursátil ajustada por flotación libre de todo el universo de renta variable de mercados desarrollados europeos.

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. Con 974 componentes, el índice representa aproximadamente el 14% de la capitalización bursátil ajustada por flotación libre del universo de renta variable japonesa.

MSCI World Index (Total Return, Net of Tax, USD)

El índice está integrado por empresas de gran y mediana capitalización de 23 países ubicados en mercados desarrollados (MD)*. Con 1.586 componentes, el índice cubre aproximadamente el 85% de la capitalización bursátil ajustada por flotación libre de cada país.

* Los países ubicados en MD 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.

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 somete a un proceso de reequilibrio con una periodicidad anual, en el mes de junio.

Anexo III (cont.)

GLOSARIO DE ÍNDICES (CONT.)

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 somete a un proceso de reequilibrio con una periodicidad anual, en el mes de junio.

S&P 500® Index (Total Return, Net of Tax, USD)

El índice S&P 500 es un índice ponderado por capitalización bursátil que está integrado por 500 títulos elegidos en función su tamaño del mercado, liquidez y representación del sector industrial. Se ha construido para representar una amplia variedad de segmentos industriales de la economía estadounidense. El índice S&P 500 se centra en el segmento de gran capitalización del mercado y cubre el 80% de la capitalización del mercado estadounidense. Entre los criterios de inclusión se incluyen la estabilidad financiera (para minimizar la rotación en el índice) y una elevada actividad de negociación (indicativa de una amplia liquidez y precios de la acción eficientes), y las acciones ordinarias se someten a un cribado para eliminar empresas con un número muy reducido de accionistas. Se eliminan del índice las empresas inmersas en fusiones, adquisiciones, recompras apalancadas, procedimientos concursales (presentación de solicitud de reorganización según el Capítulo 11 de la ley estadounidense o cualquier plan de recapitalización aprobado por los accionistas que cambie el coeficiente de endeudamiento de la empresa) y reestructuraciones, así como aquellas que dejen de ser representativas de su grupo industrial.

Media ponderada de 2/3 Morgan Emerging Markets Bond Index Global Diversified Investment Grade Index (USD Total Return) y 1/3 JP Morgan GBI EM Global Diversified Index 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 (USD total return) (anteriormente descrito) y 1/3 del JP Morgan GBI-EM Global Diversified Index Investment Grade 15% Cap Index (USD unhedged total return) (anteriormente descrito), y se somete a reequilibrio con una periodicidad mensual.

50% JP Morgan GBI Emerging Markets Global Diversified (Total Return, Unhedged, USD), en un 25% del JP Morgan EMBI Global Diversified (Total Return, USD) y 25% JP Morgan CEMBI Diversified (Total Return, USD) (el "Índice"),

El índice combinado se compone de un 25% del JP Morgan Emerging Markets Bond Index Global Diversified (anteriormente descrito), un 25% del JP Morgan Emerging Markets Corporate Bond Index Diversified (anteriormente descrito) y un 50% del JP Morgan GBI EM Global Diversified Index (anteriormente descrito), y se somete a reequilibrio con una periodicidad mensual.

50% CBOE S&P 500® PutWrite Index, 35% MSCI EAFE PutWrite Index, y 15% CBOE MSCI Emerging Markets PutWrite Index

El índice combinado se compone de un 50% del CBOE S&P 500 PutWrite Index (anteriormente descrito), un 35% del MSCI EAFE PutWrite Index (anteriormente descrito) y un 15% del CBOE MSCI Emerging Markets PutWrite Index, y se somete a reequilibrio con una periodicidad mensual.

42.5% CBOE S&P 500 One-Week PutWrite Index / 42.5% CBOE S&P 500 PutWrite Index / 7.5% CBOE Russell 2000 One-Week PutWrite Index / 7.5% CBOE Russell 2000 PutWrite Index.

El índice combinado se compone de un 42,5% del CBOE S&P 500 One-Week PutWrite Index (anteriormente descrito), un 42,5% CBOE S&P 500 PutWrite Index (anteriormente descrito), un 7,5% del CBOE Russell 2000 One-Week PutWrite Index (anteriormente descrito) y un 7,5% del CBOE Russell 2000 PutWrite Index (anteriormente descrito) y se reajusta mensualmente.