

Caixabank SI Impacto o/6o RV, F.I.

Informe de auditoría

Cuentas anuales al 31 de diciembre de 2021

Informe de gestión



Informe de auditoría de cuentas anuales emitido por un auditor independiente

A los partícipes de Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I. por encargo de los administradores de Caixabank Asset Management SGIIC, S.A.U. (la Sociedad gestora):

Informe sobre las cuentas anuales

Opinión

Hemos auditado las cuentas anuales de Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I. (el Fondo), que comprenden el balance a 31 de diciembre de 2021, la cuenta de pérdidas y ganancias, el estado de cambios en el patrimonio neto y la memoria correspondientes al ejercicio terminado en dicha fecha.

En nuestra opinión, las cuentas anuales adjuntas expresan, en todos los aspectos significativos, la imagen fiel del patrimonio y de la situación financiera del Fondo a 31 de diciembre de 2021, así como de sus resultados correspondientes al ejercicio terminado en dicha fecha, de conformidad con el marco normativo de información financiera que resulta de aplicación (que se identifica en la nota 2 de la memoria) y, en particular, con los principios y criterios contables contenidos en el mismo.

Fundamento de la opinión

Hemos llevado a cabo nuestra auditoría de conformidad con la normativa reguladora de la actividad de auditoría de cuentas vigente en España. Nuestras responsabilidades de acuerdo con dichas normas se describen más adelante en la sección *Responsabilidades del auditor en relación con la auditoría de las cuentas anuales* de nuestro informe.

Somos independientes del Fondo de conformidad con los requerimientos de ética, incluidos los de independencia, que son aplicables a nuestra auditoría de las cuentas anuales en España según lo exigido por la normativa reguladora de la actividad de auditoría de cuentas. En este sentido, no hemos prestado servicios distintos a los de la auditoría de cuentas ni han concurrido situaciones o circunstancias que, de acuerdo con lo establecido en la citada normativa reguladora, hayan afectado a la necesaria independencia de modo que se haya visto comprometida.

Consideramos que la evidencia de auditoría que hemos obtenido proporciona una base suficiente y adecuada para nuestra opinión.

Cuestiones clave de la auditoría

Las cuestiones clave de la auditoría son aquellas cuestiones que, según nuestro juicio profesional, han sido de la mayor significatividad en nuestra auditoría de las cuentas anuales del periodo actual. Estas cuestiones han sido tratadas en el contexto de nuestra auditoría de las cuentas anuales en su conjunto, y en la formación de nuestra opinión sobre éstas, y no expresamos una opinión por separado sobre esas cuestiones.

PricewaterhouseCoopers Auditores, S.L., Torre PwC, Pº de la Castellana 259 B, 28046 Madrid, España
Tel.: +34 915 684 400 / +34 902 021 111, Fax: +34 915 685 400, www.pwc.es

1

Cuestiones clave de la auditoría	Modo en el que se han tratado en la auditoría
<p data-bbox="277 454 687 488"><i>Cartera de inversiones financieras</i></p> <p data-bbox="268 517 831 763">De conformidad con la legislación vigente, el objeto social de las Instituciones de Inversión Colectiva es la captación de fondos, bienes o derechos del público para gestionarlos e invertirlos en bienes, derechos, valores u otros instrumentos, financieros o no, siempre que el rendimiento del inversor se establezca en función de los resultados colectivos.</p> <p data-bbox="268 792 823 1070">De acuerdo con la actividad anteriormente descrita, el Patrimonio Neto del Fondo está fundamentalmente invertido en instrumentos financieros. La política contable aplicable a la cartera de inversiones financieras del Fondo se encuentra descrita en la nota 3 de la memoria adjunta y en la nota 6 de la misma, se detalla la cartera de inversiones financieras a 31 de diciembre de 2021.</p> <p data-bbox="268 1099 828 1283">Identificamos esta área como la cuestión clave a considerar en la auditoría del Fondo, por la repercusión que la cartera de inversiones financieras tiene en el cálculo diario de su Patrimonio Neto y, por tanto, del valor liquidativo del mismo.</p>	<p data-bbox="858 517 1453 857">El Fondo mantiene un contrato de gestión con Caixabank Asset Management SGIIC, S.A.U., como Sociedad Gestora. Hemos obtenido un entendimiento de los procedimientos y criterios empleados por la Sociedad Gestora, en la determinación del valor razonable de los instrumentos financieros del Fondo, al objeto de considerar que los anteriores son adecuados y se aplican de manera consistente para todos los activos en cartera de inversiones financieras del Fondo.</p> <p data-bbox="858 887 1445 981">Adicionalmente, hemos realizado procedimientos sobre la cartera de inversiones financieras del Fondo, entre los que destacan los siguientes:</p> <p data-bbox="858 1010 1374 1070"><i>Obtención de confirmaciones de la Entidad Depositaria de los títulos</i></p> <p data-bbox="858 1099 1453 1440">Solicitamos a la Entidad Depositaria, en el desarrollo de sus funciones de vigilancia, supervisión, custodia y administración para el Fondo, las confirmaciones relativas a la existencia de la totalidad de los títulos recogidos en la cartera de inversiones financieras del Fondo a 31 de diciembre de 2021, sin encontrar excepciones o diferencias significativas entre la respuesta recibida de la Entidad Depositaria y los registros contables del Fondo, proporcionados por la Sociedad Gestora del mismo.</p> <p data-bbox="858 1469 1321 1529"><i>Valoración de la cartera de inversiones financieras</i></p> <p data-bbox="858 1559 1445 1805">Comprobamos la valoración de la totalidad de los títulos líquidos negociados en mercados organizados que se encuentran en la cartera de inversiones financieras del Fondo a 31 de diciembre de 2021, mediante la re-ejecución de los cálculos realizados por la Sociedad Gestora y utilizando para ello valores fiables de mercado a la fecha de análisis.</p> <p data-bbox="858 1834 1445 1957">Dichas re-ejecuciones reflejan que las diferencias en las valoraciones obtenidas respecto a las valoraciones registradas en la contabilidad del Fondo, no son significativas.</p>

Otra información: Informe de gestión

La otra información comprende exclusivamente el informe de gestión del ejercicio 2021, cuya formulación es responsabilidad de los administradores de la Sociedad gestora y no forma parte integrante de las cuentas anuales.

Nuestra opinión de auditoría sobre las cuentas anuales no cubre el informe de gestión. Nuestra responsabilidad sobre el informe de gestión, de conformidad con lo exigido por la normativa reguladora de la actividad de auditoría de cuentas, consiste en evaluar e informar sobre la concordancia del informe de gestión con las cuentas anuales, a partir del conocimiento de la entidad obtenido en la realización de la auditoría de las citadas cuentas, así como en evaluar e informar de si el contenido y presentación del informe de gestión son conformes a la normativa que resulta de aplicación. Si, basándonos en el trabajo que hemos realizado, concluimos que existen incorrecciones materiales, estamos obligados a informar de ello.

Sobre la base del trabajo realizado, según lo descrito en el párrafo anterior, la información que contiene el informe de gestión concuerda con la de las cuentas anuales del ejercicio 2021 y su contenido y presentación son conformes a la normativa que resulta de aplicación.

Responsabilidad de los administradores y del comité de auditoría en relación con las cuentas anuales

Los administradores de la Sociedad gestora son responsables de formular las cuentas anuales adjuntas, de forma que expresen la imagen fiel del patrimonio, de la situación financiera y de los resultados del Fondo, de conformidad con el marco normativo de información financiera aplicable a la entidad en España, y del control interno que consideren necesario para permitir la preparación de cuentas anuales libres de incorrección material, debida a fraude o error.

En la preparación de las cuentas anuales, los administradores de la Sociedad gestora son responsables de la valoración de la capacidad del Fondo para continuar como empresa en funcionamiento, revelando, según corresponda, las cuestiones relacionadas con empresa en funcionamiento y utilizando el principio contable de empresa en funcionamiento excepto si los citados administradores tienen intención de liquidar el Fondo o de cesar sus operaciones, o bien no exista otra alternativa realista.

El comité de auditoría de la Sociedad gestora es responsable de la supervisión del proceso de elaboración y presentación de las cuentas anuales.

Responsabilidades del auditor en relación con la auditoría de las cuentas anuales

Nuestros objetivos son obtener una seguridad razonable de que las cuentas anuales en su conjunto están libres de incorrección material, debida a fraude o error, y emitir un informe de auditoría que contiene nuestra opinión.

Seguridad razonable es un alto grado de seguridad, pero no garantiza que una auditoría realizada de conformidad con la normativa reguladora de la actividad de auditoría de cuentas vigente en España siempre detecte una incorrección material cuando existe. Las incorrecciones pueden deberse a fraude o error y se consideran materiales si, individualmente o de forma agregada, puede preverse razonablemente que influyan en las decisiones económicas que los usuarios toman basándose en las cuentas anuales.

Como parte de una auditoría de conformidad con la normativa reguladora de la actividad de auditoría de cuentas vigente en España, aplicamos nuestro juicio profesional y mantenemos una actitud de escepticismo profesional durante toda la auditoría. También:

- Identificamos y valoramos los riesgos de incorrección material en las cuentas anuales, debida a fraude o error, diseñamos y aplicamos procedimientos de auditoría para responder a dichos riesgos y obtenemos evidencia de auditoría suficiente y adecuada para proporcionar una base para nuestra opinión. El riesgo de no detectar una incorrección material debida a fraude es más elevado que en el caso de una incorrección material debida a error, ya que el fraude puede implicar colusión, falsificación, omisiones deliberadas, manifestaciones intencionadamente erróneas, o la elusión del control interno.
- Obtenemos conocimiento del control interno relevante para la auditoría con el fin de diseñar procedimientos de auditoría que sean adecuados en función de las circunstancias, y no con la finalidad de expresar una opinión sobre la eficacia del control interno de la entidad.
- Evaluamos si las políticas contables aplicadas son adecuadas y la razonabilidad de las estimaciones contables y la correspondiente información revelada por los administradores de la Sociedad gestora.
- Concluimos sobre si es adecuada la utilización, por los administradores de la Sociedad gestora, del principio contable de empresa en funcionamiento y, basándonos en la evidencia de auditoría obtenida, concluimos sobre si existe o no una incertidumbre material relacionada con hechos o con condiciones que pueden generar dudas significativas sobre la capacidad del Fondo para continuar como empresa en funcionamiento. Si concluimos que existe una incertidumbre material, se requiere que llamemos la atención en nuestro informe de auditoría sobre la correspondiente información revelada en las cuentas anuales o, si dichas revelaciones no son adecuadas, que expresemos una opinión modificada. Nuestras conclusiones se basan en la evidencia de auditoría obtenida hasta la fecha de nuestro informe de auditoría. Sin embargo, los hechos o condiciones futuros pueden ser la causa de que el Fondo deje de ser una empresa en funcionamiento.
- Evaluamos la presentación global, la estructura y el contenido de las cuentas anuales, incluida la información revelada, y si las cuentas anuales representan las transacciones y hechos subyacentes de un modo que logran expresar la imagen fiel.

Nos comunicamos con el comité de auditoría de la Sociedad gestora en relación con, entre otras cuestiones, el alcance y el momento de realización de la auditoría planificados y los hallazgos significativos de la auditoría, así como cualquier deficiencia significativa del control interno que identificamos en el transcurso de la auditoría.

También proporcionamos al comité de auditoría de la Sociedad gestora una declaración de que hemos cumplido los requerimientos de ética aplicables, incluidos los de independencia, y nos hemos comunicado con el mismo para informar de aquellas cuestiones que razonablemente puedan suponer una amenaza para nuestra independencia y, en su caso, de las correspondientes salvaguardas.

Entre las cuestiones que han sido objeto de comunicación al comité de auditoría de la Sociedad gestora, determinamos las que han sido de la mayor significatividad en la auditoría de las cuentas anuales del periodo actual y que son, en consecuencia, las cuestiones clave de la auditoría.

Describimos esas cuestiones en nuestro informe de auditoría salvo que las disposiciones legales o reglamentarias prohíban revelar públicamente la cuestión.

Informe sobre otros requerimientos legales y reglamentarios

Informe adicional para el comité de auditoría de la Sociedad gestora

La opinión expresada en este informe es coherente con lo manifestado en nuestro informe adicional para el comité de auditoría de la Sociedad gestora de fecha 22 de marzo de 2022.

Periodo de contratación

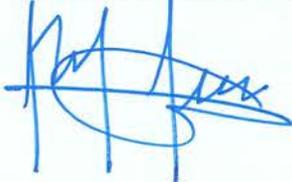
Los administradores de la Sociedad gestora, en la reunión celebrada el 27 de octubre de 2021, nos nombraron como auditores por un periodo de un año para el ejercicio finalizado el 31 de diciembre de 2021.

Con anterioridad, fuimos designados por acuerdos de los administradores de la Sociedad gestora para el periodo de 3 años y hemos venido realizando el trabajo de auditoría de cuentas de forma ininterrumpida desde el ejercicio finalizado el 31 de diciembre de 2017.

Servicios prestados

PricewaterhouseCoopers Auditores, S.L. no ha prestado servicios distintos de la auditoría de cuentas a la entidad auditada.

PricewaterhouseCoopers Auditores, S.L. (S0242)



Raúl Luño Biarge (21641)

30 de marzo de 2022



PricewaterhouseCoopers
Auditores, S.L.

2022 Núm. 20/22/03061

SELLO CORPORATIVO: 96,00 EUR

Informe de auditoría de cuentas sujeto
a la normativa de auditoría de cuentas
española o internacional

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Cuentas anuales al 31 de diciembre de 2021 e
Informe de gestión del ejercicio 2021



CLASE 8.^a



002676038

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Balances al 31 de diciembre de 2021 y 2020
(Expresados en euros)

ACTIVO	2021	2020
Activo no corriente	-	-
Inmovilizado intangible	-	-
Inmovilizado material	-	-
Bienes inmuebles de uso propio	-	-
Mobiliario y enseres	-	-
Activos por impuesto diferido	-	-
Activo corriente	1 616 150 856,64	1 901 521 377,35
Deudores	52 201 206,19	40 021 018,61
Cartera de inversiones financieras	1 448 873 078,25	1 761 337 713,93
Cartera interior	57 081 379,75	233 079 290,16
Valores representativos de deuda	49 924 149,05	233 077 389,32
Instrumentos de patrimonio	7 155 329,86	-
Instituciones de Inversión Colectiva	-	-
Depósitos en Entidades de Crédito	-	-
Derivados	1 900,84	1 900,84
Otros	-	-
Cartera exterior	1 391 904 896,09	1 536 545 034,08
Valores representativos de deuda	875 671 457,05	869 906 546,49
Instrumentos de patrimonio	516 212 278,65	-
Instituciones de Inversión Colectiva	-	666 157 147,74
Depósitos en Entidades de Crédito	-	-
Derivados	21 160,39	481 339,85
Otros	-	-
Intereses de la cartera de inversión	(113 197,59)	(8 286 610,31)
Inversiones morosas, dudosas o en litigio	-	-
Periodificaciones	-	-
Tesorería	115 076 572,20	100 162 644,81
TOTAL ACTIVO	1 616 150 856,64	1 901 521 377,35

Las Notas 1 a 13, descritas en la memoria adjunta, forman parte integrante del balance al 31 de diciembre de 2021.



002676039

CLASE 8.^a

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Balances al 31 de diciembre de 2021 y 2020
(Expresados en euros)

PATRIMONIO Y PASIVO	2021	2020
Patrimonio atribuido a partícipes o accionistas	1 605 941 934,07	1 894 542 425,32
Fondos reembolsables atribuidos a partícipes o accionistas	1 605 941 934,07	1 894 542 425,32
Capital	-	-
Partícipes	1 562 932 853,74	1 941 964 735,78
Prima de emisión	-	-
Reservas	9 662 489,46	9 662 489,46
(Acciones propias)	-	-
Resultados de ejercicios anteriores	-	-
Otras aportaciones de socios	-	-
Resultado del ejercicio	33 346 590,87	(57 084 799,92)
(Dividendo a cuenta)	-	-
Ajustes por cambios de valor en inmovilizado material de uso propio	-	-
Otro patrimonio atribuido	-	-
Pasivo no corriente	-	-
Provisiones a largo plazo	-	-
Deudas a largo plazo	-	-
Pasivos por impuesto diferido	-	-
Pasivo corriente	10 208 922,57	6 978 952,03
Provisiones a corto plazo	-	-
Deudas a corto plazo	-	-
Acreedores	9 696 285,19	2 866 244,68
Pasivos financieros	-	-
Derivados	512 637,38	4 112 707,35
Periodificaciones	-	-
TOTAL PATRIMONIO Y PASIVO	1 616 150 856,64	1 901 521 377,35
CUENTAS DE ORDEN	2021	2020
Cuentas de compromiso	434 390 583,24	1 085 029 901,05
Compromisos por operaciones largas de derivados	153 260 405,35	323 926 770,39
Compromisos por operaciones cortas de derivados	281 130 177,89	761 103 130,66
Otras cuentas de orden	159 317 110,66	103 273 494,36
Valores cedidos en préstamo por la IIC	-	-
Valores aportados como garantía por la IIC	-	-
Valores recibidos en garantía por la IIC	-	-
Capital nominal no suscrito ni en circulación	-	-
Pérdidas fiscales a compensar	159 317 110,66	103 273 494,36
Otros	-	-
TOTAL CUENTAS DE ORDEN	593 707 693,90	1 188 303 395,41

Las Notas 1 a 13, descritas en la memoria adjunta, forman parte integrante del balance al 31 de diciembre de 2021.



CLASE 8.^a



002676040

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Cuentas de pérdidas y ganancias correspondientes a los ejercicios anuales terminados el 31 de diciembre de 2021 y 2020
(Expresadas en euros)

	2021	2020
Comisiones de descuento por suscripciones y/o reembolsos	-	-
Comisiones retrocedidas a la Institución de Inversión Colectiva	32 060,34	76 046,56
Gastos de personal	-	-
Otros gastos de explotación	(28 281 898,53)	(34 387 184,75)
Comisión de gestión	(25 268 044,25)	(30 564 583,83)
Comisión de depositario	(1 822 123,96)	(2 207 230,48)
Ingreso/gasto por compensación compartimento	-	-
Otros	(1 191 730,32)	(1 615 370,44)
Amortización del inmovilizado material	-	-
Excesos de provisiones	-	-
Deterioro y resultados por enajenaciones de inmovilizado	-	-
Resultado de explotación	(28 249 838,19)	(34 311 138,19)
Ingresos financieros	7 558 253,36	14 096 978,16
Gastos financieros	(45 782,22)	(42 537,09)
Variación del valor razonable en instrumentos financieros	(171 279 183,92)	22 884 989,17
Por operaciones de la cartera interior	(4 963 313,70)	2 299 079,46
Por operaciones de la cartera exterior	(166 315 870,22)	20 585 909,71
Por operaciones con derivados	-	-
Otros	-	-
Diferencias de cambio	3 231 844,85	(5 288 309,58)
Deterioro y resultado por enajenaciones de instrumentos financieros	222 233 778,24	(54 424 782,39)
Deterioros	-	-
Resultados por operaciones de la cartera interior	2 793 855,37	(5 329 721,80)
Resultados por operaciones de la cartera exterior	224 149 303,70	(57 212 353,18)
Resultados por operaciones con derivados	(4 671 212,54)	8 083 013,21
Otros	(38 168,29)	34 279,38
Resultado financiero	61 698 910,31	(22 773 661,73)
Resultado antes de impuestos	33 449 072,12	(57 084 799,92)
Impuesto sobre beneficios	(102 481,25)	-
RESULTADO DEL EJERCICIO	33 346 590,87	(57 084 799,92)

Las Notas 1 a 13, descritas en la memoria adjunta, forman parte integrante de la cuenta de pérdidas y ganancias correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021.

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Estado de cambios en el patrimonio neto correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021
(Expresados en euros)

A) Estado de ingresos y gastos reconocidos							
Resultado de la cuenta de pérdidas y ganancias						33 346 590,87	
Total ingresos y gastos imputados directamente en el patrimonio atribuido a participes y accionistas						-	
Total transferencias a la cuenta de pérdidas y ganancias						-	
Total de ingresos y gastos reconocidos						33 346 590,87	
B) Estado total de cambios en el patrimonio neto							
	Participes	Reservas	Resultados de ejercicios anteriores	Resultado del ejercicio	(Dividendo a cuenta)	Otro patrimonio atribuido	Total
Saldos al 31 de diciembre de 2020	1 941 964 735,78	9 662 489,46	-	(57 084 799,92)	-	-	1 894 542 425,32
Ajustes por cambios de criterio	-	-	-	-	-	-	-
Ajustes por errores	-	-	-	-	-	-	-
Saldo ajustado	1 941 964 735,78	9 662 489,46	-	(57 084 799,92)	-	-	1 894 542 425,32
Total ingresos y gastos reconocidos	-	-	-	33 346 590,87	-	-	33 346 590,87
Aplicación del resultado del ejercicio	(57 084 799,92)	-	-	57 084 799,92	-	-	-
Operaciones con participes							
Suscripciones	226 675 945,59	-	-	-	-	-	226 675 945,59
Reembolsos	(548 623 027,71)	-	-	-	-	-	(548 623 027,71)
Otras variaciones del patrimonio	-	-	-	-	-	-	-
Saldos al 31 de diciembre de 2021	1 562 932 853,74	9 662 489,46	-	33 346 590,87	-	-	1 605 941 934,07

Las Notas 1 a 13, descritas en la memoria adjunta, forman parte integrante del estado de cambios en el patrimonio neto correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021.



CLASE 8.^a



002676041

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Estado de cambios en el patrimonio neto correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2020
(Expresado en euros)



CLASE 8.ª
IMPACTO



002676042

A) Estado de ingresos y gastos reconocidos							
Resultado de la cuenta de pérdidas y ganancias					(57 084 799,92)		
Total ingresos y gastos imputados directamente en el patrimonio atribuido a participes y accionistas					-		
Total transferencias a la cuenta de pérdidas y ganancias					-		
Total de ingresos y gastos reconocidos					(57 084 799,92)		
B) Estado total de cambios en el patrimonio neto							
	Participes	Reservas	Resultados de ejercicios anteriores	Resultado del ejercicio	(Dividendo a cuenta)	Otro patrimonio atribuido	Total
Saldos al 31 de diciembre de 2019	2 306 878 539,27	9 662 489,46	-	198 086 561,68	-	-	2 514 627 590,41
Ajustes por cambios de criterio	-	-	-	-	-	-	-
Ajustes por errores	-	-	-	-	-	-	-
Saldo ajustado	2 306 878 539,27	9 662 489,46	-	198 086 561,68	-	-	2 514 627 590,41
Total ingresos y gastos reconocidos							
Aplicación del resultado del ejercicio	198 086 561,68	-	-	(57 084 799,92)	-	-	(57 084 799,92)
Operaciones con participes				(198 086 561,68)			
Suscripciones	218 493 357,31	-	-	-	-	-	218 493 357,31
Reembolsos	(781 493 722,48)	-	-	-	-	-	(781 493 722,48)
Otras variaciones del patrimonio	-	-	-	-	-	-	-
Saldos al 31 de diciembre de 2020	1 941 964 735,78	9 662 489,46	-	(57 084 799,92)	-	-	1 894 542 425,32



CLASE 8.^a



002676043

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021
(Expresada en euros)

1. Actividad y gestión del riesgo

a) Actividad

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I., en lo sucesivo el Fondo, fue constituido en Madrid el 11 de enero de 2006 bajo la denominación de Caixabank Crecimiento, F.I., modificándose dicha denominación por la actual el 9 de julio de 2021. Tiene su domicilio social en Paseo de la Castellana, 51, Madrid.

El Fondo se encuentra inscrito en el Registro de Fondos de Inversión de la Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV) desde el 23 de enero de 2006 con el número 3.366, adquiriendo, a efectos legales, la consideración de Fondo de Inversión a partir de entonces.

El Fondo se encuentra inscrito en la categoría de armonizados conforme a la definición establecida en el artículo 13 del Real Decreto 1082/2012, y sucesivas modificaciones.

La sociedad Gestora del Fondo creó, el 24 de mayo de 2011, dos clases de series de participaciones en las que se divide el patrimonio atribuido a partícipes del Fondo:

- Clase Estándar: engloba a los partícipes existentes a la fecha de inscripción del folleto del Fondo en los registros de la CNMV y a todos los que suscriban posteriormente a través del comercializador del Fondo.
- Clase Plus: engloba a los partícipes que suscriban a través del comercializador del Fondo.



CLASE 8.ª



002676044

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021

(Expresada en euros)

Con fecha 9 de julio de 2021 la Sociedad Gestora del Fondo decidió crear dos nuevas clases de participaciones:

- Clase Cartera: clase de participaciones que engloba las carteras de inversiones de Clientes con gestión discrecional y/o con asesoramiento independiente encomendada al grupo CaixaBank mediante contrato y para IIC gestionadas por el grupo CaixaBank AM.
- Clase Premium: engloba a los partícipes que suscriban a través del comercializador del Fondo.

De conformidad con lo dispuesto en el artículo 1º de la Ley 35/2003 y sucesivas modificaciones, el objeto social de las Instituciones de Inversión Colectiva es la captación de fondos, bienes o derechos del público para gestionarlos e invertirlos en bienes, derechos, valores u otros instrumentos, financieros o no, siempre que el rendimiento del inversor se establezca en función de los resultados colectivos.

La gestión, administración y representación del Fondo está encomendada a CaixaBank Asset Management SGIIC, S.A.U., sociedad participada al 100% por CaixaBank, S.A., siendo la Entidad Depositaria del Fondo Cecabank, S.A. Dicha Entidad Depositaria debe desarrollar determinadas funciones de vigilancia, supervisión, custodia y administración para el Fondo, de acuerdo a lo establecido en la normativa actualmente en vigor.



CLASE 8.^a



002676045

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021
(Expresada en euros)

El Fondo está sometido a la normativa legal específica de los Fondos de Inversión, recogida principalmente por el Real Decreto 1082/2012, de 13 de julio, y sucesivas modificaciones, por el que se aprueba el Reglamento de desarrollo de la Ley 35/2003 y sucesivas modificaciones, de Instituciones de Inversión Colectiva. Los principales aspectos de esta normativa que le son aplicables son los siguientes:

- El patrimonio mínimo deberá situarse en 3.000.000 euros. No obstante, podrá constituirse con un patrimonio inferior, que no será menor de 300.000 euros, y en el caso de los compartimentos no será menor a 60.000 euros, disponiendo de un plazo de seis meses, contados a partir de la fecha de su inscripción en el registro de la CNMV, para alcanzar el patrimonio mínimo mencionado.
- El número de partícipes del Fondo no podrá ser inferior a 100.

Cuando por circunstancias del mercado o por el obligatorio cumplimiento de la normativa en vigor, el patrimonio o el número de partícipes de un fondo, o de uno de sus compartimentos, descendieran de los mínimos establecidos en el Real Decreto 1082/2012, y sucesivas modificaciones, dichas Instituciones gozarán del plazo de un año, durante el cual podrán continuar operando como tales.

- Los valores mobiliarios y demás activos financieros del Fondo no pueden pignorar ni constituirse en garantía de ninguna clase, salvo para servir de garantía de las operaciones que el Fondo realice en los mercados secundarios oficiales de derivados, y deben estar bajo la custodia de las Entidades legalmente habilitadas para el ejercicio de esta función.
- Se establecen unos porcentajes máximos de obligaciones frente a terceros y de concentración de inversiones.
- El Fondo debe cumplir con un coeficiente mínimo de liquidez del 1% del promedio mensual de su patrimonio, que debe materializarse en efectivo, en depósitos o cuentas a la vista en el Depositario o en otra entidad de crédito si el Depositario no tiene esta consideración, o en compraventas con pacto de recompra a un día de valores de Deuda Pública.
- El Fondo se encuentra sujeto a unos límites generales a la utilización de instrumentos derivados por riesgo de mercado, así como a unos límites por riesgo de contraparte.



CLASE 8.^a



002676046

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021 (Expresada en euros)

Según el Folleto del Fondo, la Sociedad Gestora percibirá una comisión anual en concepto de gastos de gestión que no excederá del 2,25% sobre el Patrimonio del Fondo.

Igualmente, el Folleto del Fondo establece una remuneración de la Entidad Depositaria que no podrá exceder del 0,20% anual del patrimonio custodiado.

Durante los ejercicios 2021 y 2020, el Fondo aplica una comisión diferente para cada clase y unas comisiones de gestión, depósito, suscripción y reembolso tal y como se detalla a continuación:

	Estándar	Plus	Cartera (*)	Premium (*)
Comisión de gestión	1,600%	1,325%	0,55%	1,125%
Comisión de depósito	0,110%	0,100%	0,02%	0,100%

(*) Las comisiones de gestión y depositaria de las clases Cartera y Premium han sido aplicadas desde la fecha de creación de dichas clases, eso es, a partir del 9 de julio de 2021, inclusive.

Durante el ejercicio 2021 y 2020 la Sociedad Gestora no ha aplicado a los partícipes del Fondo comisión sobre el importe de las participaciones suscritas, ni sobre el importe de las participaciones reembolsadas.

En el Folleto del Fondo se establece una inversión mínima inicial de 600 euros para la clase Estándar, 50.000 euros para la clase Plus y 300.000 euros para la clase Premium, importe que no será de aplicación para los Fondos gestionados por Caixabank Asset Management SGIIC, S.A.U. Para la clase Cartera, no hay inversión mínima inicial.

La inversión mínima a mantener será de 6 euros para la clase Estándar, importe que no será de aplicación a los partícipes que lo fueran antes del 24 de mayo de 2011, inclusive, 50.000 euros para la clase Plus, importe que no será de aplicación a los partícipes que lo fueran antes del 2 de junio de 2010 ni a los Fondos gestionados por Caixabank Asset Management, SGIIC, S.A.U., y en los supuestos en los que como consecuencia de la orden de reembolso de un partícipe su posición en el fondo descienda por debajo de la inversión mínima a mantener establecido en el folleto, la Sociedad Gestora procederá a reembolsarle la totalidad de las participaciones. La inversión mínima a mantener será de 300.000 euros para la clase Premium. La clase Cartera no tiene inversión mínima a mantener.



002676047

CLASE 8.^a
INSTRUMENTOS**Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.****Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021**
(Expresada en euros)

Por otra parte, el Fondo percibe devoluciones de comisiones de otras sociedades gestoras por las inversiones realizadas en Fondos de Inversión gestionados por estas últimas. Dichas devoluciones, las cuales se encuentran registradas, entre otros conceptos, en el epígrafe de "Comisiones retrocedidas a la Institución de Inversión Colectiva" de la cuenta de pérdidas y ganancias adjunta ascienden a 32.060,34 euros a 31 de diciembre de 2021 y 76.046,56 euros a 31 de diciembre de 2020.

b) Gestión del riesgo

La política de inversión del Fondo, así como la descripción de los principales riesgos asociados, se detallan en el folleto registrado y a disposición del público en el registro correspondiente de la CNMV.

Debido a la operativa en mercados financieros del Fondo, los principales riesgos a los que se encuentra expuesta son los siguientes:

- **Riesgo de crédito:** El riesgo de crédito representa las pérdidas que sufriría el Fondo en el caso de que alguna contraparte incumpliese sus obligaciones contractuales de pago con el mismo. Dicho riesgo se vería mitigado con los límites a la inversión y concentración de riesgos antes descritos. La cuantificación del riesgo de crédito consecuencia del incumplimiento de las obligaciones de pago se efectúa a través de CreditManager (aplicativo de riesgos de la sociedad gestora). Este Credit VaR se calcula con una periodicidad mensual, probabilidad del 95% y 99% y el horizonte temporal es de un año. En estos mismos informes se detalla la calidad crediticia de la cartera de renta fija privada para cada una de las instituciones.
- **Riesgo de liquidez:** En el caso de que el Fondo invirtiese en valores de baja capitalización o en mercados con una reducida dimensión y limitado volumen de contratación, o inversión en otras Instituciones de Inversión Colectiva con liquidez inferior a la del Fondo, las inversiones podrían quedar privadas de liquidez. Por este motivo, la sociedad gestora del Fondo gestiona el riesgo de liquidez inherente a la actividad para asegurar el cumplimiento de los coeficientes de liquidez y garantizar los reembolsos de los partícipes.



CLASE 8.^a



002676048

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021
(Expresada en euros)

Es por este motivo por el que, desde una doble perspectiva, se establecen mecanismos de control tanto previos a la inversión, como posteriores a la misma, que garantizan o limitan hasta niveles razonables el riesgo de liquidez que pueden asumir las carteras gestionadas:

- Con carácter previo a la inversión, se han elaborado diferentes marcos o universos de inversión autorizados para las distintas tipologías de activos cuya función consiste en acotar o limitar la gestión, orientándola hacia activos que cumplen una serie de requisitos mínimos que garanticen su solvencia y liquidez. Dependiendo de la tipología de activos se exigen criterios mínimos de capitalización, geográficos, de liquidez, calidad crediticia, etc.
- Con carácter posterior a la inversión y de manera periódica, los departamentos de Valoración y Control de Riesgos elaboran distintos informes orientados a la gestión de este riesgo. Estos informes muestran el grado de liquidez que tienen las instituciones de inversión colectiva en función de la tipología de sus activos en cartera así como el estado o peso que representan aquellos que, por diferentes motivos, son difícilmente liquidables en periodos razonables.
- Riesgo de mercado: El riesgo de mercado representa la pérdida que pueden experimentar las carteras de las Instituciones de Inversión Colectiva como consecuencia de movimientos adversos en los precios de mercado. Los factores de riesgo más significativos podrían agruparse en los siguientes:
 - Riesgo en activos de renta fija: La variación del precio de este tipo de activos y por tanto, su riesgo, se puede segregar en un doble componente:
 - Riesgo de tipo de interés: derivado de la variación o fluctuación de los tipos de interés. El impacto en el precio de los bonos es reducido en activos con vencimiento a corto plazo y elevado en activos a largo plazo. Este impacto se estima de manera aproximada a partir de la duración, duración modificada o sensibilidad y ajustando por convexidad.
 - Riesgo de spread: como consecuencia del riesgo específico o asociado al propio emisor. Este riesgo se expresa en términos de spread sobre la curva de valoración y tiene impacto directo en la valoración del activo.



CLASE 8.^a



002676049

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021
(Expresada en euros)

- Riesgo de tipo de cambio: la inversión en activos denominados en divisas distintas del euro conlleva un riesgo derivado de la fluctuación que pueden experimentar los tipos de cambio.
- Riesgo en activos de renta variable o activos vinculados a índices bursátiles: la inversión en instrumentos de renta variable conlleva que la rentabilidad del Fondo se vea afectada por la volatilidad de los mercados en los que invierte. Adicionalmente, la inversión en mercados considerados emergentes puede conllevar, en su caso, riesgos de nacionalización o expropiación de activos o imprevistos de índole político que pueden afectar al valor de las inversiones, haciéndolas más volátiles.

El riesgo total de mercado se mide o cuantifica en términos de VaR el cual nos indica cual es la pérdida máxima esperada de una cartera, con una probabilidad determinada y un horizonte temporal definido. Estos cálculos se hacen con una periodicidad diaria, empleando la metodología paramétrica y asignando los siguientes parámetros:

- Nivel de Confianza: 99%
- Decay Factor: ($\lambda = 0.94$)
- Horizonte temporal: 1 día.

El riesgo de mercado se segrega por factores de riesgo: Renta Variable, Renta Fija (Tipos de Interés + Spread) y Tipos de Cambio. Adicionalmente, su cálculo se obtiene por las otras dos metodologías como son la histórica y Monte Carlo.

Los riesgos inherentes a las inversiones mantenidas por el Fondo se encuentran descritos en el Folleto informativo, según lo establecido en la normativa aplicable.

- Riesgo de sostenibilidad: La Sociedad Gestora del Fondo tiene en cuenta los riesgos de sostenibilidad en las decisiones de inversión. El riesgo de sostenibilidad de las inversiones dependerá, entre otros, del tipo de emisor, el sector de actividad o su localización geográfica. De este modo, las inversiones que presenten un mayor riesgo de sostenibilidad pueden ocasionar una disminución del precio de los activos subyacentes y, por tanto, afectar negativamente al valor liquidativo de la participación del Fondo.
- Riesgo operacional: aquel que puede provocar pérdidas como resultado de errores humanos, procesos internos inadecuados o defectuosos, fallos en los sistemas o como consecuencia de acontecimientos externos.



CLASE 8.^a
IMPUESTO



002676050

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021
(Expresada en euros)

La Sociedad Gestora tiene establecidos los mecanismos necesarios para controlar la exposición a los riesgos de mercado, crédito y liquidez, así como el referido al riesgo operacional. En este sentido, el control de los coeficientes normativos mencionados en el apartado 1.a), anterior, limitan la exposición a dichos riesgos.

Durante el ejercicio 2021, el COVID-19 ha seguido extendiéndose por todo el mundo. A la fecha de formulación de estas cuentas anuales, este evento sigue afectando significativamente a la actividad económica a nivel mundial y, como resultado, podría afectar a las operaciones y resultados financieros del Fondo. La medida en la que el Coronavirus pudiera impactar en los resultados seguirá dependiendo de la evolución de las acciones que se están realizando para contener la pandemia. Dicha evolución no se puede predecir de forma fiable. No obstante, estimamos que, debido a la gestión de la cartera de inversiones realizada por la Sociedad Gestora, el efecto que pueda tener la crisis provocada por el COVID-19, no debería tener un impacto significativo sobre dicha cartera de inversiones.

2. Bases de presentación de las cuentas anuales

a) Imagen fiel

Las cuentas anuales, formuladas por los Administradores de la Sociedad Gestora del Fondo, han sido preparadas a partir de los registros contables del Fondo, habiéndose aplicado las disposiciones legales vigentes en materia contable que le son aplicables, con el objeto de mostrar la imagen fiel de su patrimonio, de su situación financiera y de sus resultados.

Las cuentas anuales adjuntas se encuentran pendientes de aprobación por el Consejo de Administración de la Sociedad Gestora, si bien los Administradores estiman que serán aprobadas sin modificaciones significativas.

b) Principios contables

Para la elaboración de estas cuentas anuales se han seguido los principios y criterios contables y de clasificación recogidos, fundamentalmente, en la Circular 3/2008 de la CNMV y sucesivas modificaciones. Los principios más significativos se describen en la Nota 3. No existe ningún principio contable de aplicación obligatoria que, siendo significativo su efecto sobre estas cuentas anuales, se haya dejado de aplicar.



CLASE 8.^a



002676051

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021
(Expresada en euros)

c) Comparabilidad

Las cuentas anuales al 31 de diciembre de 2021 se presentan atendiendo a la estructura y principios contables establecidos en la normativa vigente de la CNMV.

Los Administradores de la Sociedad Gestora presentan, a efectos comparativos, con cada una de las partidas del balance, de la cuenta de pérdidas y ganancias y del estado de cambios en el patrimonio neto, además de las cifras del ejercicio 2021, las correspondientes al ejercicio anterior.

No se han producido modificaciones contables que afecten significativamente a la comparación entre las cuentas anuales de los ejercicios 2021 y 2020.

d) Estimaciones contables y corrección de errores

En determinadas ocasiones los Administradores de la Sociedad Gestora han realizado estimaciones para obtener la valoración de algunos activos, pasivos, ingresos, gastos y compromisos que figuran registrados en las cuentas anuales. Dichas estimaciones se refieren, principalmente, al valor razonable y a las posibles pérdidas por deterioro de determinados activos financieros, si las hubiera. Aun cuando éstas se consideren las mejores estimaciones posibles, en base a la información existente en el momento del cálculo, acontecimientos futuros podrían obligar a modificarlas prospectivamente, de acuerdo con la normativa vigente.

En cualquier caso, el valor liquidativo del Fondo se verá afectado por las fluctuaciones de los precios del mercado y otros riesgos asociados a las inversiones financieras.

No existen cambios en las estimaciones contables ni errores que se hubieran producido en ejercicios anteriores y hayan sido detectados durante los ejercicios 2021 y 2020.

Las cifras contenidas en los documentos que componen estas cuentas anuales, el balance, la cuenta de pérdidas y ganancias, el estado de cambios en el patrimonio neto y esta memoria, están expresadas en euros, excepto cuando se indique expresamente.



CLASE 8.^a
ESTADÍSTICA



002676052

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021
(Expresada en euros)

3. Resumen de los principios contables y normas de valoración más significativos

Los principios contables más significativos aplicados en la formulación de estas cuentas anuales han sido los siguientes:

a) Principio de empresa en funcionamiento

En la elaboración de las cuentas anuales se ha considerado que la gestión del Fondo continuará en el futuro previsible. Por tanto, la aplicación de las normas contables no está encaminada a determinar el valor del patrimonio a efectos de su transmisión global o parcial ni el importe resultante en caso de su liquidación.

b) Principio del devengo

Los ingresos y gastos se registran contablemente en función del periodo en que se devengan, con independencia de cuando se produce su cobro o pago efectivo.

c) Deudores

La valoración inicial se realiza por su valor razonable que, salvo evidencia en contrario, es el precio de la transacción, que equivale al valor razonable de la contraprestación entregada más los costes de transacción que les sean directamente atribuibles.

La valoración posterior se hace a su coste amortizado. Los intereses devengados se contabilizan en la cuenta de pérdidas y ganancias aplicando el método del tipo de interés efectivo. No obstante, aquellas partidas cuyo importe se espere recibir en un plazo de tiempo inferior a un año se valoran por su valor nominal.

Las pérdidas por deterioro del valor de las partidas a cobrar se calculan teniendo en cuenta los flujos de efectivo futuros estimados, descontados al tipo de interés efectivo calculado en el momento del reconocimiento. Las correcciones valorativas por deterioro así como su reversión se reconocen como un gasto o un ingreso en la cuenta de pérdidas y ganancias.



CLASE 8.^a



002676053

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021
(Expresada en euros)

d) Cartera de inversiones financieras

Los activos de la cartera de inversiones financieras han sido considerados como activos financieros a valor razonable con cambios en la cuenta de pérdidas y ganancias. Los principales productos financieros recogidos en la cartera, así como la determinación de su valor razonable se describen a continuación:

- Valores representativos de deuda: valores que suponen una deuda para su emisor y que devengan una remuneración consistente en un interés establecido contractualmente.

El valor razonable de los valores representativos de deuda cotizados se determina por los precios de cotización en un mercado, siempre y cuando éste sea activo y los precios se obtengan de forma consistente. Cuando no estén disponibles precios de cotización el valor razonable se corresponde con el precio de la transacción más reciente siempre que no haya habido un cambio significativo en las circunstancias económicas desde el momento de la transacción.

En caso de que no exista mercado activo para el instrumento de deuda se aplican técnicas de valoración, como precios suministrados por intermediarios, emisores o difusores de información, utilización de transacciones recientes de mercado realizadas en condiciones de independencia mutua entre partes interesadas y debidamente informadas si están disponibles, valor razonable en el momento actual de otro instrumento que sea sustancialmente el mismo o modelos de descuento de flujos y valoración de opciones en su caso.

El valor razonable de los valores representativos de deuda no cotizados se define como el precio que iguale el rendimiento interno de la inversión a los tipos de interés de mercado vigentes en cada momento de la Deuda Pública asimilable por sus características financieras, incrementado en una prima o margen que sea representativo del grado de liquidez, condiciones concretas de la emisión, solvencia del emisor y, en su caso, riesgo país.

Los intereses devengados no cobrados de valores representativos de deuda se periodifican de acuerdo con el tipo de interés efectivo y forman parte del resultado del ejercicio.

- Instrumentos de patrimonio: instrumentos financieros emitidos por otras entidades, tales como acciones y cuotas participativas, que tienen la naturaleza de instrumentos de capital para el emisor.



CLASE 8.^a



002676054

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021
(Expresada en euros)

El valor razonable de los instrumentos de patrimonio cotizados lo establece el cambio oficial de cierre del día de la fecha del balance, si existe, o inmediato hábil anterior o el cambio medio ponderado si no existiera precio oficial de cierre.

El valor razonable de los instrumentos de patrimonio no cotizados se considera el valor teórico que corresponda a dichas inversiones en el patrimonio contable ajustado de la entidad o grupo consolidado, corregido por el importe de las plusvalías o minusvalías tácitas, netas de impuestos, existentes en el momento de la valoración.

- Depósitos en entidades de crédito: depósitos que el Fondo mantiene en entidades de crédito, a excepción de los saldos que se recogen en el epígrafe de "Tesorería".

Se considera valor razonable el precio que iguala el rendimiento interno de la inversión a los tipos de mercado vigentes en cada momento.

- Acciones o participaciones de otras Instituciones de Inversión Colectiva: su valor razonable se establece en función del valor liquidativo o valor de cotización del día de referencia. En el caso de que para el día de referencia no se calculara un valor liquidativo, se utiliza el último valor liquidativo disponible. Para las inversiones en Instituciones de Inversión Colectiva de Inversión Libre, Instituciones de Inversión Colectiva de Instituciones de Inversión Colectiva de Inversión Libre e Instituciones de Inversión Colectiva extranjeras similares, se utilizan, en su caso, valores liquidativos estimados.
- Derivados: incluye, entre otros, las diferencias de valor en los contratos de futuros y forwards, las primas pagadas/cobradas por warrants y opciones compradas/emittidas, cobros o pagos asociados a los contratos de permuta financiera, así como las inversiones en productos estructurados.

El valor del cambio oficial de cierre el día de referencia determina su valor razonable. Para los no negociados en mercados organizados, la Sociedad Gestora establece un modelo de valoración en función de las condiciones específicas establecidas en la Circular 6/2010 de la CNMV., y sucesivas modificaciones.



CLASE 8.^a



002676055

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021
(Expresada en euros)

Los activos en los que concurra un deterioro notorio e irreparable de su inversión, se darán de baja con cargo a la cuenta de pérdidas y ganancias.

Los activos y pasivos financieros se dan de baja en el balance cuando se traspasan, sustancialmente, todos los riesgos y beneficios inherentes a la propiedad de los mismos.

e) Adquisición y cesión temporal de activos

Las adquisiciones temporales de activos o adquisiciones con pacto de retrocesión se contabilizan por el importe efectivo desembolsado, cualesquiera que sean los instrumentos subyacentes, en la cuenta de activo correspondiente.

La diferencia entre este importe y el precio de retrocesión se imputa como ingreso en la cuenta de pérdidas y ganancias utilizando el método del tipo de interés efectivo.

Las diferencias de valor razonable se imputan en la cuenta de pérdidas y ganancias en el epígrafe de "Variación del valor razonable en instrumentos financieros".

La cesión en firme del activo adquirido temporalmente se registra como pasivo financiero a valor razonable con cambios en pérdidas y ganancias.

f) Instrumentos de patrimonio

Los instrumentos de patrimonio cotizados se registran en el momento de su contratación por el valor razonable de la contraprestación entregada, incluyendo los costes de transacción explícitos directamente atribuibles a la operación.

Las diferencias que surjan como consecuencia de los cambios en el valor razonable de estos activos se reflejan en la cuenta de pérdidas y ganancias de la siguiente forma: las diferencias negativas o diferencias positivas se registran bajo el epígrafe de "Deterioro y resultado por enajenaciones de instrumentos financieros" o de "Variación del valor razonable en instrumentos financieros por operaciones de la cartera interior o exterior", según los cambios se hayan liquidado o no, utilizando como contrapartida la cuenta de "Instrumentos de patrimonio", de la cartera interior o exterior del activo del balance.



CLASE 8.ª



002676056

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021
(Expresada en euros)

g) Valores representativos de deuda

Los valores representativos de deuda se registran en el momento de su liquidación por el valor razonable de la contraprestación entregada, incluyendo los costes de transacción explícitos directamente atribuibles a la operación.

Las diferencias que surjan como consecuencia de los cambios en el valor razonable de estos activos se reflejan en la cuenta de pérdidas y ganancias de la siguiente forma: las diferencias negativas o diferencias positivas se registran bajo el epígrafe de "Deterioro y resultado por enajenaciones de instrumentos financieros" o de "Variación del valor razonable en instrumentos financieros por operaciones de la cartera interior o exterior", según los activos se hayan liquidado o no, utilizando como contrapartida la cuenta de "Valores representativos de deuda", de la cartera interior o exterior del activo del balance.

h) Operaciones de derivados, excepto permutas financieras

Las operaciones de derivados se registran en el momento de su contratación y hasta el momento de cierre de la posición o el vencimiento del contrato, en el epígrafe correspondiente de cuentas de orden, por el importe nominal comprometido.

Los fondos depositados en concepto de garantía tienen la consideración contable de depósito cedido, registrándose en el capítulo correspondiente del epígrafe de "Deudores" del activo en el balance.

El valor razonable de los valores aportados en garantía se registra en cuentas de orden en el epígrafe de "Valores aportados como garantía por la Institución de Inversión Colectiva".

Las primas resultantes de las opciones compradas o emitidas se reflejan en el epígrafe de "Derivados" del activo o pasivo del balance, en la fecha de ejecución de la operación.

Las diferencias que surjan como consecuencia de los cambios en el valor razonable de estos activos se reflejan en la cuenta de pérdidas y ganancias de la siguiente forma: las diferencias negativas o diferencias positivas se registran bajo el epígrafe de "Resultados por operaciones con derivados" o de "Variación del valor razonable en instrumentos financieros por operaciones con derivados", según éstos se hayan liquidado o no, utilizando como contrapartida el epígrafe de "Derivados", de la cartera interior o exterior del activo o del pasivo corriente del balance.



CLASE 8.^a
EJERCICIO



002676057

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021

(Expresada en euros)

i) Operaciones de permuta financiera

Las operaciones de permuta financiera se registran en el momento de su contratación y hasta el momento de cierre de la posición o vencimiento de contrato, en los epígrafes de "Compromisos por operaciones largas de derivados" o de "Compromisos por operaciones cortas de derivados" de las cuentas de orden, según su naturaleza y por el importe nominal comprometido. La contrapartida de los cobros o pagos asociados a cada contrato se registran en el epígrafe de "Derivados" de la cartera interior o exterior del activo o del pasivo corriente del balance, según corresponda.

En los epígrafes de "Resultado por operaciones con derivados" o de "Variación del valor razonable en instrumentos financieros - Por operaciones con derivados", dependiendo de si los cambios de valor se han liquidado o no, se registran las diferencias que resultan como consecuencia de los cambios en el valor razonable de estos contratos. La contrapartida de estas cuentas se registra en el epígrafe de "Derivados" de la cartera interior o exterior del activo o del pasivo corriente, según su saldo, del balance, hasta la fecha de su liquidación.

En aquellos casos en que el contrato presente una liquidación diaria, las correspondientes diferencias se contabilizarán en el epígrafe de "Resultados por operaciones con derivados" de la cuenta de pérdidas y ganancias.

j) Moneda extranjera

En el caso de partidas monetarias que sean tesorería, débitos y créditos, las diferencias de cambio, tanto positivas como negativas, se reconocen en la cuenta de pérdidas y ganancias bajo el epígrafe de "Diferencias de cambio".

Para el resto de partidas monetarias y no monetarias que forman parte de la cartera de instrumentos financieros, las diferencias de cambio se tratan conjuntamente con las pérdidas y ganancias derivadas de la valoración.



002676058

CLASE 8.^a

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021
(Expresada en euros)

k) Valor liquidativo de las participaciones

La determinación del patrimonio del Fondo a los efectos del cálculo del valor liquidativo de las correspondientes participaciones que lo componen, se realiza de acuerdo con los criterios establecidos en la Circular 6/2008, de la CNMV, y sucesivas modificaciones.

l) Suscripciones y reembolsos

Las suscripciones y reembolsos de participaciones se contabilizan por el importe efectivamente suscrito o reembolsado con abono o cargo, respectivamente, al capítulo de "Partícipes" de pasivo del balance del Fondo.

De conformidad con el Reglamento de Gestión del Fondo, el precio de las participaciones será el valor liquidativo correspondiente al mismo día de la solicitud del interesado, determinándose de este modo tanto el número de participaciones suscritas o reembolsadas, como el efectivo a reembolsar en su caso. Durante el periodo que media entre la solicitud y la determinación efectiva del precio de las participaciones, el importe solicitado se registra en el capítulo de "Solicitudes de suscripción pendientes de asignar participaciones" del pasivo del balance del Fondo.

m) Impuesto sobre beneficios

La cuenta de pérdidas y ganancias recoge el gasto por el Impuesto sobre beneficios, en cuyo cálculo se contempla el efecto del diferimiento de las diferencias producidas entre la base imponible del impuesto y el resultado contable antes de aplicar el impuesto que revierte en periodos subsiguientes.

Los pasivos por impuestos diferidos se reconocen siempre, en cambio los activos por impuestos diferidos sólo se reconocen en la medida en que resulte probable que la Institución disponga de ganancias fiscales futuras que permitan la aplicación de estos activos.

Los derechos a compensar en ejercicios posteriores por las pérdidas fiscales no dan lugar al reconocimiento de un activo por impuesto diferido en ningún caso y sólo se reconocen mediante la compensación del gasto por impuesto con la frecuencia del cálculo del valor liquidativo. Las pérdidas fiscales que puedan compensarse se registran en el epígrafe de "Cuentas de orden - Pérdidas fiscales a compensar".



CLASE 8.^a



002676059

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021
(Expresada en euros)

4. Deudores

El desglose de este epígrafe, al 31 de diciembre de 2021 y 2020, es el siguiente:

	2021	2020
Depósitos de garantía	9 277 013,68	30 257 234,95
Administraciones Públicas deudoras	41 405 745,21	8 874 485,02
Operaciones pendientes de liquidar	1 518 447,30	889 186,10
Otros	-	112,54
	<u>52 201 206,19</u>	<u>40 021 018,61</u>

El capítulo "Depósitos de garantía" al 31 de diciembre de 2021 y 2020 recoge los importes registrados para garantizar los futuros financieros en Cecabank, S.A.

El capítulo de "Administraciones Públicas deudoras" al 31 de diciembre de 2021 y 2020 recoge las retenciones sobre intereses y otros rendimientos de capital mobiliario.

El capítulo de "Operaciones pendiente de liquidar" a 31 de diciembre de 2021 y 2020 recoge, principalmente, el importe de los deudores por venta de valores y el importe de los dividendos pendientes de cobro.



CLASE 8.^a



002676060

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021

(Expresada en euros)

5. Acreedores

El desglose de este epígrafe, al 31 de diciembre de 2021 y 2020, es el siguiente:

	2021	2020
Administraciones Públicas acreedoras	265 365,35	175 292,30
Operaciones pendientes de liquidar	7 231 269,76	3 393,22
Otros	2 199 650,08	2 687 559,16
	<u>9 696 285,19</u>	<u>2 866 244,68</u>

El capítulo de "Administraciones Públicas acreedoras" al 31 de diciembre de 2021 y 2020 se desglosa tal y como sigue:

	2021	2020
Retenciones practicadas en el ejercicio sobre intereses y otros rendimientos de capital mobiliario	162 884,10	175 292,30
Impuesto sobre beneficios devengado en el ejercicio	102 481,25	-
	<u>265 365,35</u>	<u>175 292,30</u>

El capítulo de "Operaciones pendientes de liquidar" al 31 de diciembre de 2021 y 2020 recoge, principalmente, los importes pendientes de pago por compra de valores y los importes pendientes de pago por el importe de los gastos por remuneración negativa en concepto de barridos de cuenta, respectivamente.

El capítulo de "Acreedores - Otros" recoge, principalmente, el importe de las comisiones de gestión y depositaría, así como los gastos de auditoría pendientes de pago al cierre del ejercicio correspondiente.

Durante los ejercicios 2021 y 2020, el Fondo no ha realizado pagos que acumularan aplazamientos superiores a los legalmente establecidos. Asimismo, al cierre de los ejercicios 2021 y 2020, el Fondo no tiene saldo alguno pendiente de pago que acumule un aplazamiento superior al plazo legal establecido.



CLASE 8.^a
002676061



002676061

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021

(Expresada en euros)

6. Cartera de inversiones financieras

El detalle de la cartera de valores del Fondo, por tipo de activo, al 31 de diciembre de 2021 y 2020 se muestra a continuación:

	2021	2020
Cartera interior	57 081 379,75	233 079 290,16
Valores representativos de deuda	49 924 149,05	233 077 389,32
Instrumentos de patrimonio	7 155 329,86	-
Derivados	1 900,84	1 900,84
Cartera exterior	1 391 904 896,09	1 536 545 034,08
Valores representativos de deuda	875 671 457,05	869 906 546,49
Instrumentos de patrimonio	516 212 278,65	-
Instituciones de Inversión Colectiva	-	666 157 147,74
Derivados	21 160,39	481 339,85
Intereses de la cartera de inversión	(113 197,59)	(8 286 610,31)
	<u>1 448 873 078,25</u>	<u>1 761 337 713,93</u>

En los Anexos I y II adjuntos, partes integrantes de esta memoria, se detallan la cartera de inversiones financieras y las inversiones en derivados del Fondo, respectivamente, al 31 de diciembre de 2021. En los Anexos III y IV adjuntos, partes integrantes de esta memoria, se detallan la cartera de inversiones financieras y las inversiones en derivados del Fondo, respectivamente, al 31 de diciembre de 2020.

Al 31 de diciembre de 2021 y 2020 todos los títulos recogidos dentro de la cartera de inversiones financieras se encuentran depositados en Cecabank, S.A.



CLASE 8.^a



002676062

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021
(Expresada en euros)

7. Tesorería

El detalle de este epígrafe al cierre de los ejercicios 2021 y 2020, se muestra a continuación:

	2021	2020
Cuentas en el Depositario	90 854 486,13	96 755 957,19
Cuentas en euros	24 047 416,00	28 122 576,55
Cuentas en divisa	66 807 070,13	68 633 380,64
Otras cuentas de tesorería	24 222 086,07	3 406 687,62
Otras cuentas de tesorería en euros	24 222 086,07	3 406 507,25
Otras cuentas de tesorería en divisa	-	180,37
	115 076 572,20	100 162 644,81

Durante los ejercicios 2021 y 2020 el tipo de interés de remuneración de las cuentas en el Depositario, ha sido un tipo de interés de mercado.

El detalle del capítulo de "Cuentas en el Depositario" del Fondo al 31 de diciembre de 2021 y 2020, recoge los saldos mantenidos en Cecabank, S.A.

El detalle del capítulo "Otras cuentas de tesorería" del Fondo al 31 de diciembre de 2021 y 2020, recoge el saldo mantenido en CaixaBank, S.A. y Unicaja Banco, S.A.



CLASE 8.^a



002676063

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021
(Expresada en euros)

8. Patrimonio atribuido a partícipes

Las participaciones por las que está representado el Fondo son de iguales características, representadas por certificados nominativos sin valor nominal y que confieren a sus propietarios un derecho de propiedad sobre dicho patrimonio.

El valor liquidativo de cada participación al 31 de diciembre de 2021 se ha obtenido de la siguiente forma:

	Clase Estándar	Clase Plus	Clase Premium	Clase Cartera
Patrimonio atribuido a partícipes	<u>750 186 429,80</u>	<u>813 905 880,92</u>	<u>37 513 033,69</u>	<u>4 336 589,66</u>
Número de participaciones emitidas	<u>53 911 396,05</u>	<u>56 701 896,75</u>	<u>6 349 855,13</u>	<u>740 422,20</u>
Valor liquidativo por participación	<u>13,92</u>	<u>14,35</u>	<u>5,91</u>	<u>5,86</u>
Número de partícipes	<u>47 519</u>	<u>10 234</u>	<u>69</u>	<u>65</u>

El valor liquidativo de cada participación al 31 de diciembre de 2020 se ha obtenido de la siguiente forma:

	Clase Estándar	Clase Plus
Patrimonio atribuido a partícipes	<u>862 317 610,42</u>	<u>1 032 224 814,90</u>
Número de participaciones emitidas	<u>62 923 679,06</u>	<u>73 226 398,12</u>
Valor liquidativo por participación	<u>13,70</u>	<u>14,10</u>
Número de partícipes	<u>54 448</u>	<u>11 927</u>

El movimiento del patrimonio atribuido a partícipes durante los ejercicios 2021 y 2020 se recoge en el Estado de cambios en el patrimonio neto correspondiente.

El resultado del ejercicio, una vez considerado el Impuesto sobre beneficios, se distribuirá en la cuenta de "Partícipes" del Fondo.

Al 31 de diciembre de 2021 y 2020 no existen participaciones significativas.



CLASE 8.^a



002676064

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021

(Expresada en euros)

9. Cuentas de compromiso

En los Anexos II y IV adjuntos, partes integrantes de esta memoria, se detalla la cartera de inversiones en derivados del Fondo al 31 de diciembre de 2021 y 2020, respectivamente.

10. Otras cuentas de orden

El desglose de este epígrafe, al 31 de diciembre de 2021 y 2020, es el siguiente:

	2021	2020
Pérdidas fiscales a compensar	159 317 110,66	103 273 494,36
	<u>159 317 110,66</u>	<u>103 273 494,36</u>

11. Administraciones Públicas y situación fiscal

Durante el ejercicio 2021, el régimen fiscal del Fondo ha estado regulado por la Ley 27/2014, de 27 de noviembre, del Impuesto sobre Sociedades, y sucesivas modificaciones, encontrándose sujeto en dicho impuesto a un tipo de gravamen del 1 por 100, siempre que el número de partícipes requerido sea como mínimo el previsto en el artículo noveno de la Ley 35/2003 y sucesivas modificaciones. Adicionalmente, el artículo 26 de la Ley 27/2014 establece para el ejercicio 2021 una limitación del importe de las bases imponibles negativas de ejercicios anteriores a compensar, admitiéndose la compensación de la totalidad de ésta siempre que sea igual o inferior a un millón de euros.

El capítulo "Acreedores – Administraciones Públicas" recoge el Impuesto sobre beneficios devengado en el ejercicio, que se obtiene, principalmente, de aplicar el 1% al resultado contable antes de impuestos una vez deducidas las bases imponibles negativas de ejercicios anteriores, en el momento en que sea presentada la correspondiente declaración del Impuesto sobre beneficios y hasta el límite de compensación sobre del beneficio antes de impuestos permitido por la legislación vigente para el ejercicio.

Las bases imponibles negativas generadas en ejercicios anteriores y recogidas en el epígrafe "Pérdidas Fiscales a compensar", se deducirán del resultado contable antes de impuestos del ejercicio en el momento en que sea presentada la correspondiente declaración del Impuesto sobre beneficios, de acuerdo con los límites establecidos en la normativa vigente.

No existen diferencias significativas entre el resultado contable antes de impuestos del ejercicio y la base imponible del Impuesto sobre beneficios.



CLASE 8.ª



002676065

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021

(Expresada en euros)

De acuerdo con la legislación vigente, las declaraciones para los diferentes impuestos a los que el Fondo se halla sujeto no pueden considerarse definitivas hasta haber sido inspeccionadas por las autoridades fiscales o haber transcurrido el plazo de prescripción de cuatro años.

El Fondo tiene abiertos a inspección todos los impuestos a los que está sujeto de los últimos cuatro ejercicios.

No existen contingencias significativas que pudieran derivarse de una revisión por las autoridades fiscales.

12. Otra información

La Sociedad Gestora realiza por cuenta del Fondo operaciones vinculadas de las previstas en el artículo 67 de la Ley 35/2003 y sucesivas modificaciones y en el artículo 139 del Real Decreto 1082/2012, y sucesivas modificaciones. Para ello, la Sociedad Gestora ha adoptado procedimientos para evitar conflictos de interés y asegurarse de que las operaciones vinculadas se realizan en interés exclusivo del Fondo y a precios de mercado. Los informes periódicos incluyen, según lo establecido en la Circular 4/2008 de la CNMV., y sucesivas modificaciones, información sobre las operaciones vinculadas realizadas. Asimismo, incluyen las posibles operaciones vinculadas realizadas por cuenta del Fondo con la Sociedad Gestora o con personas o entidades vinculadas a la Sociedad Gestora, indicando la naturaleza, riesgos y funciones asumidas en dichas operaciones.

Adicionalmente, en la Nota de "Actividad y gestión del riesgo" se indica el importe de las comisiones retrocedidas con origen en las Instituciones de Inversión Colectiva gestionadas por entidades pertenecientes al Grupo de la Sociedad Gestora, en caso de que se hubieran producido durante el ejercicio.

Respecto a la operativa que realiza con el Depositario, en la Nota de "Tesorería" se indican las cuentas que mantiene el Fondo con éste al 31 de diciembre de 2021 y 2020. Adicionalmente, en el Anexo III se recogen las adquisiciones temporales de activos contratadas con el mismo al 31 de diciembre de 2020.

Al tratarse de una entidad que por sus peculiaridades no dispone de empleados ni oficinas y que por su naturaleza debe estar gestionada por una Sociedad Gestora de Instituciones de Inversión Colectiva, los temas relativos a la protección del medio ambiente y la seguridad y salud del trabajador aplican exclusivamente a dicha Sociedad Gestora.



CLASE 8.ª



002676066

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021
(Expresada en euros)

Los honorarios percibidos por PricewaterhouseCoopers Auditores, S.L. por servicios de auditoría de cuentas anuales de los ejercicios 2021 y 2020, ascienden a 9 miles de euros, en cada ejercicio.

13. Hechos Posteriores

Desde el cierre del ejercicio al 31 de diciembre de 2021 hasta la fecha de formulación de las cuentas anuales, no se han producido hechos posteriores de especial relevancia que no hayan sido mencionados con anterioridad.

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Anexo I. Cartera de inversiones financieras al 31 de diciembre de 2021
(Expresado en euros)

Cartera Interior	Divisa	Valoración inicial	Intereses	Valor razonable	(Minusvalía / Plusvalía)	ISIN
Deuda pública						
BONOS MADRID ,827 2027-07-30	EUR	2 326 939,78	3 606,27	2 403 977,22	77 037,44	ES0000101966
BONOS MADRID 1,773 2028-04-30	EUR	11 048 098,67	23 477,87	11 065 181,72	17 083,05	ES0000101875
BONOS MADRID ,747 2022-04-30	EUR	2 610 534,47	2 470,95	2 619 367,04	8 832,57	ES0000101842
BONOS TESORO PUBLICO 1 2042-07-30	EUR	2 393 432,48	6 666,35	2 300 625,06	(92 807,42)	ES0000012J07
TOTALES Deuda pública		18 379 005,40	36 221,44	18 389 151,04	10 145,64	
Renta fija privada cotizada						
BONOS BBVA 6 2022-01-15	EUR	13 686 846,37	52 162,67	13 466 669,50	(220 176,87)	ES0813211028
BONOS BANKINTER ,625 2027-10-06	EUR	11 682 971,47	3 814,49	11 593 431,70	(89 539,77)	ES0213679JR9
BONOS ADIF ,95 2027-04-30	EUR	3 177 039,64	(33 454,85)	3 190 884,99	13 845,35	ES0200002048
BONOS ADIF ,8 2023-07-05	EUR	3 279 041,99	(10 593,30)	3 284 011,82	4 969,83	ES0200002022
TOTALES Renta fija privada cotizada		31 825 899,47	11 929,01	31 534 998,01	(290 901,46)	
Acciones admitidas cotización						
ACCIONES SIEMENS GAMESA	EUR	7 703 269,74	-	7 155 329,86	(547 939,88)	ES0143416115
TOTALES Acciones admitidas cotización		7 703 269,74	-	7 155 329,86	(547 939,88)	
TOTAL Cartera Interior		57 908 174,61	48 150,45	57 079 478,91	(828 695,70)	



CLASE 8.^a



002676067

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Anexo I. Cartera de inversiones financieras al 31 de diciembre de 2021
(Expresado en euros)

Cartera Exterior	Divisa	Valoración inicial	Intereses	Valor razonable	(Minusvalía) / Plusvalía	ISIN
Deuda pública						
BONOS EIRE 1.35 2031-03-18	EUR	18 531 576,35	64 240,93	18 383 906,77	(147 669,58)	IE00BFZRQ242
BONOS NRW BANK 625 2029-02-02	EUR	5 466 500,28	19 707,38	5 398 250,26	(68 250,02)	DE000NRW0AG1
BONOS LAND NORDRHEIN- 1.25 2023-03-16	EUR	3 250 853,13	26 547,92	3 281 432,38	30 579,25	DE000NRW0JF6
BONOS DEUTSCHLAND 0.00001 2030-08-15	EUR	14 344 964,85	(23 056,35)	14 218 149,89	(126 814,96)	DE0001030708
TOTALES Deuda pública		41 593 894,61	87 439,88	41 281 739,30	(312 155,31)	
Renta fija privada cotizada						
BONOS INGGROEPI 2.5 2030-11-15	EUR	7 949 289,14	(63 869,03)	7 757 955,55	(191 333,59)	XS1909186451
BONOS ELECTR PORTUGAL 1.625 2027-04-15	EUR	8 333 002,71	(1 556 625,68)	9 937 416,35	1 604 413,64	PTEDPNOM0015
BONOS ELECTR PORTUGAL 1.875 2022-08-02	EUR	3 535 878,93	25 648,33	3 473 063,14	(62 815,79)	PTEDPROM0029
BONOS KREDITANSALT 0.5 2024-05-30	EUR	7 132 181,81	(26 929,65)	7 118 906,29	(13 275,52)	XS1414146669
BONOS KREDITANSALT 1.25 2025-06-30	EUR	19 532 451,17	(39 414,09)	19 461 314,30	(71 136,87)	XS1612940558
BONOS BNP 1 2024-04-17	EUR	3 489 764,89	18 016,67	3 488 653,21	(1 111,68)	XS1808338542
BONOS ERSTE GR BK AKT 1.25 2028-05-17	EUR	10 357 298,66	20 872,92	10 260 788,21	(96 510,45)	AT0000A2RAA0
BONOS KREDITANSALT 1.5 2026-09-28	EUR	8 999 908,78	(32 833,04)	8 943 918,01	(55 990,77)	XS1897340854
BONOS AGENCE FRANCAIS 1.25 2031-09-29	EUR	10 035 061,59	4 079,03	9 864 817,75	(170 243,84)	FR0014005NA6
BONOS HSBC 1.5 2024-12-04	EUR	8 058 449,30	(10 077,07)	8 047 310,86	(11 138,44)	XS1917601582
BONOS TELEFONICA SAU 1.069 2024-02-05	EUR	8 626 553,78	64 476,72	8 614 660,69	(11 893,09)	XS1946004451
BONOS INTL BANK 2.5 2029-05-21	EUR	8 944 635,02	227,76	8 826 872,69	(117 762,33)	XS1998930926
BONOS KFW 0.1 2027-05-05	EUR	8 781 847,56	(12 581,08)	8 698 286,56	(83 561,00)	XS1998841445
BONOS VODAFONE 1.9 2026-11-24	EUR	8 110 668,28	(7 193,09)	8 081 488,25	(29 170,03)	XS2002017361
BONOS BVA 1 2026-06-21	EUR	2 831 894,19	(11 972,04)	2 795 017,75	(36 876,44)	XS2013745703
BONOS BER INTL 3.25 2022-02-12	EUR	14 843 141,16	144 479,21	14 867 625,56	24 484,40	XS1890845875
BONOS SOCIETE DU GRAN 0.00001 2030-11-25	EUR	9 174 775,41	7 891,25	9 043 054,75	(131 720,66)	FR00140005B8
BONOS DAIMLER AG 1.75 2030-09-10	EUR	7 994 068,83	15 979,56	8 079 994,35	85 925,52	DE000A289QR9
BONOS VONOVIA SE 1.625 2031-03-24	EUR	4 276 771,83	21 461,17	4 241 790,03	(34 981,80)	DE000A3E5FR9
BONOS ENGIE SA 1.875 2024-03-27	EUR	5 415 471,48	30 135,30	5 413 141,49	(2 329,99)	FR0013245859
BONOS AGENCE FRANCAIS 1.25 2023-11-15	EUR	7 024 563,84	(984,11)	7 071 596,85	47 033,01	FR0013296373
BONOS ENGIE SA 3.25 2022-02-28	EUR	10 178 748,23	178 224,98	10 195 776,16	17 027,93	FR0013398229
BONOS BNP 1.125 2024-08-28	EUR	6 197 989,76	11 870,12	6 194 786,32	(3 203,44)	FR0013405537
BONOS ELECTR PORTUGAL 4.496 2079-04-30	EUR	6 657 095,32	99 045,24	6 612 074,90	(45 020,42)	PTEDPKOM0034
BONOS ORANGE SA 1.25 2029-09-16	EUR	5 149 870,20	3 990,05	5 111 915,62	(37 954,58)	FR0013534484
BONOS BNP PARIBAS S.A 1.625 2028-05-30	EUR	6 962 008,17	4 415,67	6 958 735,08	(3 273,09)	FR0014006N17
BONOS VINC 1 2028-11-27	EUR	2 568 950,62	2 216,36	2 539 894,64	(29 055,98)	FR0014000PF1
BONOS ENGIE SA 1.5 2022-11-30	EUR	7 477 174,77	11 697,70	7 482 294,59	5 119,82	FR0014000R2
BONOS CREDIT AGRICOLE 1.25 2027-12-09	EUR	5 183 986,02	1 086,30	5 085 893,48	(98 092,54)	FR0014000Y93
BONOS ELECTRICITE DE 2.625 2022-06-01	EUR	6 788 083,64	105 165,81	6 838 167,94	50 084,30	FR0014003S56
BONOS AGENCE FRANCAIS 0.1 2028-11-25	EUR	2 611 856,97	(863,26)	2 586 887,90	(24 969,07)	FR0014003YN1



CLASE 8.ª



002676068

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Anexo I. Cartera de inversiones financieras al 31 de diciembre de 2021
(Expresado en euros)

Cartera Exterior	Divisa	Valoración inicial	Intereses	Valor razonable	(Minusvalía) / Plusvalía	ISIN
BONOSIEDP FINANCE BV 375 2026-09-16	EUR	5 984 947,57	11 658,82	6 014 375,43	29 427,86	XS2053052895
BONOSIENGIE SAI2.125 2032-03-30	EUR	4 813 007,45	52 849,17	4 767 652,50	(45 354,95)	FR0013504693
BONOSIENI 375 2028-06-14	EUR	6 059 576,25	10 117,29	5 981 442,21	(78 134,04)	XS2344735811
BONOSIE.ONI 2024-08-28	EUR	6 430 252,37	(1 729,99)	6 424 641,99	(5 610,38)	XS2047500769
BONOSICAIXABANK 1.25 2022-06-20	EUR	14 761 137,36	88 915,82	14 631 472,12	(129 665,24)	XS2310118976
BONOSIAXA 1.375 2041-10-07	EUR	6 205 518,33	19 902,46	6 049 751,59	(155 766,74)	XS2314312179
BONOSIINTESA SANPAOLO .75 2028-03-16	EUR	5 317 142,94	29 660,05	5 282 156,59	(34 986,35)	XS2317069685
BONOSINORDBANKEN ABP .5 2031-03-19	EUR	2 533 309,21	11 312,01	2 534 696,76	1 387,55	XS2321526480
BONOSIE.ONI .6 2032-10-01	EUR	9 349 767,18	16 687,32	9 437 406,85	87 639,67	XS2327420977
BONOSICAIXABANK .5 2029-02-09	EUR	1 696 554,08	8 019,11	1 665 030,88	(31 523,20)	XS2297549391
BONOSIAB GROUP PLC .5 2027-11-17	EUR	9 185 742,52	(16 638,32)	9 156 035,53	(29 706,99)	XS2343340852
BONOSIBER INTL .825 2022-02-09	EUR	7 719 556,28	123 750,80	7 662 604,70	(56 951,58)	XS2295333988
BONOSICAIXABANK .75 2028-05-26	EUR	7 799 086,85	35 281,47	7 788 820,53	(10 266,32)	XS2346253730
BONOSIINGROEPI .875 2022-06-09	EUR	12 010 801,55	58 131,27	11 922 241,33	(88 560,22)	XS2350756446
BONOSIENEL FINANCE NV 2027-06-17	EUR	8 182 340,68	8 415,94	8 076 181,90	(106 158,78)	XS2353182020
BONOSIENEL FINANCE NV 2022-06-24	EUR	5 790 598,28	19 642,71	5 743 663,15	(46 935,13)	XS2357417257
BONOSIREPSOL EUROPE .375 2029-07-06	EUR	10 006 423,35	17 960,33	9 853 827,34	(152 596,01)	XS2361358299
BONOSITALANX AG .75 2042-12-01	EUR	1 898 920,42	2 808,21	1 894 766,17	(4 154,25)	XS2411241693
BONOSIBANK OF IRELAND .375 2022-08-11	EUR	14 696 394,31	78 613,40	14 549 273,03	(147 121,28)	XS2340236327
BONOSINED WATERSCHAPS 2023-04-14	EUR	973 746,49	(3 059,01)	973 469,61	(276,88)	XS2154486224
BONOSIRWEI .5 2028-11-26	EUR	7 576 359,65	3 691,03	7 580 378,24	4 018,59	XS2412044567
BONOSICAIXABANK .625 2024-10-01	EUR	6 069 861,82	5 452,16	6 076 737,16	6 875,34	XS2055758804
BONOSIGENERAL .2.124 2030-10-01	EUR	8 018 096,02	8 218,40	8 007 277,04	(10 818,98)	XS2056491587
BONOSIENEL FINANCE NV .1.125 2034-10-17	EUR	7 139 827,78	11 307,99	6 955 184,85	(184 642,93)	XS2066706735
BONOSIINTESA SANPAOLO .75 2024-12-04	EUR	5 212 324,13	(541,29)	5 292 424,22	80 100,09	XS2089368596
BONOSIE.ONI .375 2027-09-29	EUR	2 481 856,61	7 126,73	2 515 799,47	33 942,86	XS2103014291
BONOSINATWEST .78 2030-02-26	EUR	5 998 553,88	38 612,28	5 929 929,23	(68 624,65)	XS2307853098
BONOSINTL BANK 2030-02-21	EUR	3 390 526,96	141,05	3 369 632,95	(20 894,01)	XS2122894855
BONOSIE.ONI .35 2030-02-28	EUR	10 353 696,29	33 348,18	10 334 403,98	(19 292,31)	XS2047500926
BONOSIGENERAL .2.429 2031-07-14	EUR	4 210 070,75	32 971,23	4 259 330,33	49 259,58	XS2201857534
BONOSIAB GROUP PLC .2.875 2031-05-30	EUR	9 327 393,21	95 933,52	9 185 688,89	(141 704,32)	XS2230399441
BONOSIHOLCIM FINANCE .5 2031-04-23	EUR	2 700 394,29	9 294,33	2 567 159,22	(133 235,07)	XS2261215011
BONOSITELECOMITALIA .625 2029-01-18	EUR	5 988 381,21	98 316,56	5 609 079,08	(379 302,13)	XS2288109676
BONOSITELEFONICA NL .2.376 2022-05-12	EUR	5 962 589,06	138 811,64	5 814 549,71	(148 039,35)	XS2293060658
BONOSIORSTED AS .5 2022-02-18	EUR	5 920 408,27	78 115,05	5 867 340,94	(53 067,33)	XS2293075680
BONOSITELEFONICA NL .2.502 2022-05-05	EUR	3 760 764,40	81 378,32	3 710 868,26	(49 896,14)	XS2109819859
TOTALES Renta fija privada cotizada		468 749 369,86	222 114,05	467 179 403,05	(1 569 966,81)	
Emissiones avaladas						
BONOSIEUROPEAN COMMUN .0000 2030-10-04	EUR	27 912 503,26	(19 596,79)	27 549 078,79	(363 424,47)	EU000A283859



Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Anexo I. Cartera de inversiones financieras al 31 de diciembre de 2021
(Expresado en euros)

Cartera Exterior	Divisa	Valoración inicial	Intereses	Valor razonable	(Minusvalía) / Plusvalía	ISIN
BONOSICADES 0000 2031-05-25	EUR	12 797 554,04	(1 685,79)	12 444 309,79	(353 244,25)	FR0014001S17
BONOSIUNEDIC 1 2034-05-25	EUR	3 445 731,77	5 061,44	3 323 378,15	(122 353,62)	FR0014001ZY9
BONOSICADES 2026-11-25	EUR	21 516 338,99	(24 052,11)	21 363 972,11	(152 366,88)	FR0014004016
BONOSIUNEDIC 1 2026-11-25	EUR	15 699 155,32	(17 216,07)	15 566 574,97	(132 580,35)	FR0126221896
BONOSIEUROPEAN INVEST 1.25 2026-11-13	EUR	16 406 193,81	(58 175,83)	16 253 685,30	(152 508,51)	XS1107718279
BONOSIEUROPEAN INVEST 5 2023-11-15	EUR	13 354 142,50	(34 186,21)	13 335 011,12	(19 131,38)	XS1280834992
BONOSIICO 2 2024-01-31	EUR	3 747 451,94	(5 835,58)	3 764 351,59	16 899,65	XS1979491559
BONOSIEUROPEAN INVEST 2028-05-15	EUR	18 368 871,80	(19 418,52)	18 242 046,02	(126 825,78)	XS2154339860
BONOSICADES 2026-02-25	EUR	11 809 675,57	(35 133,70)	11 741 041,70	(68 633,87)	FR0014000UG9
BONOSIICO 2027-04-30	EUR	12 646 518,92	(1 529,45)	12 617 468,45	(29 050,47)	XS2356033147
BONOSIUNEDIC 2030-11-19	EUR	13 789 094,52	1 959,08	13 508 240,92	(280 853,60)	FR0014000L31
BONOSIEUROPEAN COMUNI 0000 2025-11-04	EUR	40 003 072,80	(104 141,11)	39 875 677,11	(127 395,69)	EU000A284451
BONOSIEUROPEAN COMUNI 0000 2035-07-04	EUR	9 379 034,24	468,72	9 084 096,28	(294 937,96)	EU000A285VM2
BONOSIEUROPEAN COMUNI 0000 2035-07-04	EUR	27 302 393,01	(43 959,84)	27 025 133,61	(277 259,40)	EU000A287074
BONOSIEUROPEAN COMUNI 0001 2028-06-02	EUR	27 395 941,83	(59 213,30)	27 250 032,44	(145 909,39)	EU000A3KNYF7
BONOSIEUROPEAN COMUNI 2026-03-04	EUR	33 800 836,80	(22 594,51)	33 519 033,59	(281 803,21)	EU000A3KRJQ6
BONOSIEUROPEAN COMUNI 2029-07-04	EUR	10 683 853,07	(9 034,66)	10 510 607,04	(173 246,03)	FR0013518487
BONOSIUNEDIC 25 2029-11-25	EUR	13 775 569,18	833,28	13 474 176,72	(301 392,46)	FR0013534559
BONOSICADES 2030-11-25	EUR	18 115 185,61	(12 808,74)	17 924 891,24	(190 294,37)	FR00140002P5
BONOSICADES 2028-02-25	EUR	17 303 581,22	(6 165,00)	17 188 965,00	(114 616,22)	FR0014000667
BONOSIUNEDIC 2028-11-25	EUR	1 656 825,03	(4 477,28)	1 648 542,76	(8 282,27)	XS2250026734
BONOSIICO 0000 2026-04-30	EUR	370 909 525,23	(470 901,97)	367 210 314,70	(3 699 210,53)	
TOTALES Emisiones avaladas						
Acciones admitidas cotización						
ACCIONES VIVENDI ENVIRON	EUR	11 954 166,34	-	15 561 740,10	3 607 573,76	FR0000124141
ACCIONES BROOKFIELD RENE	CAD	22 545 500,99	-	21 337 775,85	(1 207 725,14)	CA11284V1058
ACCIONES GMO PAYMENT	JPY	10 070 078,68	-	10 168 163,67	98 084,99	JP3385890003
ACCIONES SYSMEX	JPY	4 689 018,13	-	5 491 325,04	802 306,91	JP3351100007
ACCIONES SHIONOGI	JPY	4 370 578,23	-	6 050 399,20	1 679 820,97	JP3347200002
ACCIONES IAPTIV PLC	USD	9 273 184,94	-	10 423 541,04	1 150 356,10	JE00B783TY65
ACCIONES BANK RAKYAT IND	IDR	15 640 126,52	-	17 720 466,66	2 080 340,14	ID1000118201
ACCIONES JOHNSON MATTHEY	GBP	10 040 925,94	-	6 899 305,16	(3 141 620,78)	GB00BZ4BQC70
ACCIONES ROYALTY PHARMA	USD	14 640 118,79	-	15 228 317,81	588 199,02	GB00BMVP7Y09
ACCIONES WISE	GBP	7 604 246,80	-	5 982 091,91	(1 622 154,89)	GB00BL9YR756
ACCIONES SAMSUNG SDI CO	KRW	10 149 796,22	-	8 220 210,60	(1 929 585,62)	KR7006400006
ACCIONES HALMA PLC	GBP	16 972 189,68	-	17 801 687,71	829 498,03	GB0004052071
ACCIONES PAGS DIG	USD	8 346 554,56	-	5 231 095,10	(3 115 459,46)	KYG687071012
ACCIONES SCHNEIDER	EUR	21 772 021,67	-	27 041 728,00	5 269 706,33	FR0000121972
ACCIONES EDP RENOVAVEIS	EUR	18 065 390,04	-	18 750 780,00	685 389,96	ES0127797019
ACCIONES VESTAS WIND SYS	DKK	13 315 600,99	-	11 385 546,22	(1 930 054,77)	DK0061539921



002676070

CLASE 8.ª

Anexo I. Cartera de inversiones financieras al 31 de diciembre de 2021
(Expresado en euros)

Cartera Exterior	Divisa	Valoración inicial	Intereses	Valor razonable	(Minusvalía) / Plusvalía	ISIN
ACCIONES FINANCIER STAR	DKK	9 980 310,82	-	9 297 919,95	(682 390,87)	DK0060227585
ACCIONES ORSTED AS	DKK	15 081 143,78	-	13 722 546,55	(1 358 597,23)	DK0060094928
ACCIONES LEG IMMOBILIEN	EUR	14 405 178,20	-	13 284 115,50	(1 121 062,70)	DE000LEG1110
ACCIONES VONOVIA SE	EUR	18 879 852,38	-	17 019 086,50	(1 860 765,88)	DE000A1ML7J1
ACCIONES SGS SOC GEN	CHF	6 781 042,36	-	6 758 182,41	(22 859,95)	CH0002497458
ACCIONES SHOPIFY INC	USD	7 093 392,96	-	6 658 151,70	(435 241,26)	CA82509L1076
ACCIONES PEARSON	GBP	10 728 568,52	-	7 985 028,96	(2 743 539,56)	GB0006776081
ACCIONES EVERBRIDGE INC	USD	5 862 255,69	-	2 971 562,03	(2 890 693,66)	US29978A1043
ACCIONES ZOETIS INC	USD	16 609 684,43	-	19 688 832,84	3 079 148,41	US98978V1035
ACCIONES XYLEM	USD	6 362 796,54	-	6 555 654,77	192 858,23	US98419M1009
ACCIONES VEEVA SYSTEMS I	USD	11 431 466,85	-	9 497 982,07	(1 933 484,78)	US9224751084
ACCIONES THERMO FISHER	USD	5 873 294,96	-	7 799 518,37	1 926 223,41	US8835561023
ACCIONES SUN COMMUN INC	USD	5 983 433,86	-	7 012 532,96	1 029 099,10	US8666741041
ACCIONES SQUARE INC	USD	8 937 972,66	-	6 004 458,60	(2 933 514,06)	US8522341036
ACCIONES PAYPAL	USD	14 264 234,96	-	10 093 621,02	(4 170 613,94)	US70450Y1038
ACCIONES MERCADOLIBRE IN	USD	8 349 049,66	-	7 584 601,86	(764 447,80)	US68733R1023
ACCIONES IDEXX LABORATOR	USD	14 560 812,71	-	14 872 931,97	312 119,26	US45168D1046
ACCIONES ISO-NET M3 INC	JPY	7 893 971,27	-	6 132 815,09	(1 761 156,18)	JP3435750009
ACCIONES GROCERY OUT HP	USD	10 799 449,06	-	9 152 375,36	(1 647 073,70)	US39874R1014
ACCIONES CAPITEC BANK HO	ZAR	4 828 258,71	-	5 864 238,23	1 035 979,52	ZAE0000035861
ACCIONES TETSY INC	USD	6 666 813,12	-	7 562 262,26	895 449,14	US29786A1060
ACCIONES DANAHER CORP	USD	7 411 737,94	-	8 906 229,57	1 494 491,63	US2358511028
ACCIONES BOSTON SCIENTIF	USD	17 271 355,62	-	17 659 553,52	388 197,90	US1011371077
ACCIONES BOSTON PROPERTI	USD	8 293 633,31	-	8 634 956,93	341 323,62	US1011211018
ACCIONES BALL CORP	USD	10 865 538,07	-	11 354 749,52	489 211,45	US0584981064
ACCIONES AVANGRID	USD	6 192 549,06	-	6 176 913,34	(15 635,72)	US05351W1036
ACCIONES AGILENT	USD	12 582 465,72	-	13 470 205,66	887 739,94	US00846U1016
ACCIONES IKKN	EUR	14 958 511,63	-	17 816 040,00	2 857 528,37	NL0000009827
ACCIONES PHILLIPS	EUR	9 653 564,07	-	8 049 279,26	(1 604 284,81)	NL0000009538
ACCIONES J HENRY Y ASSOC	EUR	25 285 834,99	-	25 331 757,78	45 922,79	US4262811015
TOTALES Acciones admitidas cotización		523 337 672,43		516 212 278,65	(7 125 393,78)	
TOTAL Cartera Exterior		1 404 590 462,13	(161 348,04)	1 391 883 735,70	(12 706 726,43)	



002676071

CLASE 8.^a

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Anexo II. Cartera de inversiones en derivados al 31 de diciembre de 2021
(Expresado en euros)

Descripción	Divisa	Importe Nominal Comprometido	Valor razonable	Vencimiento del contrato
Compras al contado				
Futuros comprados				
FUTURO F MINI MSCI EME 50	USD	10 578 894,70	10 508 371,42	18/03/2022
FUTURO F SYP500M 50	USD	74 502 795,59	74 443 047,98	18/03/2022
FUTURO FUT EUROSTOXX 10	EUR	20 375 427,36	20 794 375,00	18/03/2022
FUTURO F TOPIX INDEX 10000	JPY	15 592 133,59	15 445 416,85	10/03/2022
FUTURO F EUROUSD FIX 125000USD	USD	32 211 154,11	32 194 174,06	14/03/2022
TOTALES Futuros comprados		153 260 405,35	153 385 385,31	
Ventas al contado				
Futuros vendidos				
FUTURO F EURBUXL 100000 FISICA	EUR	15 139 600,00	14 471 800,00	8/03/2022
FUTURO F US 2YR NOTE 200000 FISICA	USD	139 447 972,35	137 675 696,04	31/03/2022
FUTURO FUT BUND 10Y 100000 FISICA	EUR	19 469 885,79	19 193 440,00	8/03/2022
FUTURO F BOBL 100000 FISICA	EUR	67 958 280,00	67 552 680,00	8/03/2022
FUTURO F US TRE5 100000 FISICA	USD	39 114 439,75	38 808 617,94	31/03/2022
TOTALES Futuros vendidos		281 130 177,89	277 702 233,98	
TOTALES		434 390 583,24	431 087 619,29	



CLASE 8.^a



002676072

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Anexo III. Cartera de inversiones financieras al 31 de diciembre de 2020
(Expresado en euros)



CLASE 8.^a



002676073

Cartera Interior	Divisa	Valoración inicial	Intereses	Valor razonable	(Minusvalía) / Plusvalía	ISIN
Deuda pública						
BONOS GALICIA .084 2027-07-30	EUR	4 223 223,02	737,20	4 280 110,91	56 887,89	ES0001352592
BONOS MADRID .827 2027-07-30	EUR	2 326 939,78	6 323,94	2 453 236,26	126 296,48	ES0000101966
BONOS MADRID .419 2030-04-30	EUR	2 702 290,43	7 850,91	2 780 415,66	78 125,23	ES0000101933
BONOS MADRID .747 2022-04-30	EUR	2 009 119,66	3 388,62	2 038 519,60	29 399,94	ES0000101842
BONOS MADRID .4.3 2026-09-15	EUR	6 426 088,83	(198 772,82)	6 552 450,22	126 361,39	ES0000101263
BONOS TESORO PUBLICO .1.4 2028-07-30	EUR	2 261 217,25	1 755,01	2 477 418,06	216 200,81	ES0000012B88
BONOS TESORO PUBLICO .1.4 2028-04-30	EUR	2 276 956,97	6 202,41	2 474 731,56	197 774,59	ES0000012B39
BONOS TESORO PUBLICO .5 2030-04-30	EUR	4 430 348,35	13 289,03	4 627 802,01	197 453,66	ES0000012F76
BONOS TESORO PUBLICO .05 2021-10-31	EUR	5 984 858,47	11 503,66	6 021 157,71	36 299,24	ES0000012C46
BONOS MADRID .827 2027-07-30	EUR	2 326 939,78	6 323,94	2 453 236,26	126 296,48	ES0000101966
BONOS TESORO PUBLICO .5.9 2026-07-30	EUR	3 736 537,95	(270 042,68)	3 992 784,19	256 246,24	ES00000123C7
BONOS TESORO PUBLICO .1.45 2029-04-30	EUR	1 760 224,34	6 826,50	1 931 331,39	171 107,05	ES0000012E51
BONOS TESORO PUBLICO .35 2023-07-30	EUR	5 227 598,66	(252,32)	5 330 235,22	102 636,56	ES0000012B62
BONOS TESORO PUBLICO .1.45 2027-10-31	EUR	2 003 283,92	4 109,56	2 234 457,02	231 173,10	ES0000012A89
BONOS TESORO PUBLICO .1.5 2027-04-30	EUR	3 061 818,35	15 262,98	3 364 922,50	303 104,15	ES00000128P8
BONOS TESORO PUBLICO .1.3 2026-10-31	EUR	3 532 100,64	(2 638,22)	3 856 392,33	324 291,69	ES00000128H5
BONOS TESORO PUBLICO .1.95 2026-04-30	EUR	2 666 244,37	(15 629,47)	2 865 602,07	199 357,70	ES00000127Z9
BONOS TESORO PUBLICO .2.75 2024-10-31	EUR	4 499 931,30	(207 576,54)	4 730 440,10	230 508,80	ES00000126B2
BONOS TESORO PUBLICO .3.8 2024-04-30	EUR	5 979 157,75	(363 976,14)	6 220 710,39	241 552,64	ES00000124W3
BONOS TESORO PUBLICO .6 2029-10-31	EUR	1 012 545,13	(799,46)	1 061 142,20	48 597,07	ES0000012F43
BONOS TESORO PUBLICO .5.85 2022-01-31	EUR	8 600 138,63	(445 156,51)	8 645 940,61	45 801,98	ES00000123K0
TOTALES Deuda pública		74 720 623,80	(1 427 594,34)	77 939 800,01	3 219 176,21	
Renta fija privada cotizada						
BONOS ADIF .95 2027-04-30	EUR	3 177 039,64	(10 221,85)	3 237 851,99	60 812,35	ES0200002048
BONOS BANKINTER .625 2027-10-06	EUR	7 286 457,12	9 355,03	7 352 735,71	66 278,59	ES0213679JR9
BONOS MAPFRE .1.625 2026-05-19	EUR	2 093 946,52	(1 348,05)	2 218 031,34	124 084,82	ES0224244071
TOTALES Renta fija privada cotizada		12 557 443,28	(2 214,87)	12 808 619,04	251 175,76	
Emissiones avaladas						
BONOS FADE .85 2023-12-17	EUR	4 295 701,83	3 348,24	4 461 969,68	166 267,85	ES0378641320
BONOS ICO .25 2024-04-30	EUR	1 755 477,89	936,54	1 788 667,39	33 189,50	XS2173111282
TOTALES Emissiones avaladas		6 051 179,72	4 284,78	6 250 637,07	199 457,35	

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Anexo III. Cartera de inversiones financieras al 31 de diciembre de 2020
(Expresado en euros)

Cartera Interior	Divisa	Valoración inicial	Intereses	Valor razonable	(Minusvalía) / Plusvalía	ISIN
Valores de entidades de crédito garantizados						
CEDULAS HIPOTECARIAS BANKIA, S.A. 4 2025-02-03	EUR	1 205 179,95	(42 683,37)	1 261 147,52	55 967,57	ES0414950628
CEDULAS HIPOTECARIAS BANKIA, S.A. 1 2023-03-14	EUR	2 416 242,90	8 232,88	2 486 591,12	70 348,22	ES0413307127
CEDULAS HIPOTECARIAS BSAN ,25 2029-07-10	EUR	6 991 644,67	9 640,96	7 328 681,51	337 036,84	ES0413900566
TOTALES Valores de entidades de crédito garantizados		10 613 067,52	(24 809,53)	11 076 420,15	463 352,63	
Adquisición temporal de activos con Depositario						
REPO TESORO PUBLICO -518 2021-01-04	EUR	125 000 457,00	(1 798,66)	125 001 913,05	1 456,05	ES000000128B8
TOTALES Adquisición temporal de activos con Depositario		125 000 457,00	(1 798,66)	125 001 913,05	1 456,05	
TOTAL Cartera Interior		228 942 771,32	(1 452 132,62)	233 077 389,32	4 134 618,00	



CLASE 8.ª



002676074

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Anexo III. Cartera de inversiones financieras al 31 de diciembre de 2020
(Expresado en euros)

Cartera Exterior	Divisa	Valoración inicial	Intereses	Valor razonable	(Minusvalía) / Plusvalía	ISIN
Deuda pública						
BONOS ITALY 2.45 2023-10-01	EUR	3 142 879,40	362,06	3 358 751,44	215 872,04	IT00053444335
BONOS FRECH TREASURY 2.75 2027-10-25	EUR	6 055 337,97	(186 036,06)	6 365 475,79	310 137,82	FR0011317783
BONOS ITALY 2.3 2021-10-15	EUR	6 196 025,75	(108 144,67)	6 272 276,98	76 251,23	IT0005348443
BONOS FRECH TREASURY 1.75 2024-11-25	EUR	14 205 840,76	(553 172,55)	14 839 080,91	633 240,15	FR0011962398
BONOS EIRE 9 2028-05-15	EUR	1 295 577,55	8 387,02	1 433 600,58	138 023,03	IE00BDHDP444
BONOS ITALY 2.15 2021-12-15	EUR	6 491 287,58	(388 714,39)	6 548 284,72	56 997,14	IT0005028003
BONOS ITALY 2.5 2024-12-01	EUR	5 128 214,78	(141 315,14)	5 455 541,25	327 326,47	IT0005045270
BONOS ITALY 1.5 2025-06-01	EUR	5 216 083,17	458,35	5 580 526,22	364 443,05	IT0005090318
BONOS ITALY 1.45 2022-09-15	EUR	4 638 061,45	(73 214,41)	4 738 751,01	100 689,56	IT0005135840
BONOS ITALY 1.6 2026-06-01	EUR	3 149 769,21	71 547,53	3 626 627,99	476 858,78	IT0005170839
BONOS FRECH TREASURY 1 2027-05-25	EUR	4 839 597,89	(9 274,57)	5 223 160,34	383 562,45	FR0013250560
BONOS ITALY .45 2021-06-01	EUR	4 025 232,31	(21 145,55)	4 038 469,07	13 236,76	IT0005175598
BONOS FRECH TREASURY 0 2022-05-25	EUR	6 446 391,22	20 946,53	6 519 580,47	73 189,25	FR0013219177
BONOS ITALY 2.05 2027-08-01	EUR	3 823 113,02	78 701,37	4 449 568,20	626 455,18	IT0005274805
BONOS ITALY .9 2022-08-01	EUR	1 943 082,98	40 738,96	2 009 495,82	66 412,84	IT0005277444
BONOS FRECH TREASURY .25 2026-11-25	EUR	2 619 598,99	24 575,08	2 814 654,67	195 055,68	FR0013200813
BONOS FRECH TREASURY .75 2028-05-25	EUR	6 576 196,09	(6 004,27)	6 719 545,61	143 349,52	FR0013286192
BONOS FRECH TREASURY .0001 2023-03-25	EUR	9 554 407,04	(28 648,43)	9 684 733,43	130 326,39	FR0013283686
BONOS ITALY 2.5 2025-11-15	EUR	2 942 608,01	26 184,83	3 361 105,56	418 497,55	IT0005345183
BONOS EIRE .2 2030-10-18	EUR	2 274 302,72	(759,36)	2 366 174,19	91 871,47	IE00BKFCV899
BONOS ITALY 2 2028-02-01	EUR	3 433 499,84	61 865,99	4 017 081,14	583 581,30	IT0005323032
BONOS FRECH TREASURY 1 2025-11-25	EUR	7 061 774,75	(91 220,73)	7 459 403,58	397 628,83	FR0012938116
BONOS ITALY .95 2023-03-01	EUR	972 884,43	16 593,44	1 015 961,97	43 077,54	IT0005325946
BONOS ITALY 1.25 2026-12-01	EUR	2 777 108,05	54 794,46	3 159 346,20	382 238,15	IT0005210650
BONOS ITALY 3 2029-08-01	EUR	4 802 179,17	(46 681,57)	4 981 086,79	178 907,62	IT0005365165
BONOS ITALY 2.2 2027-06-01	EUR	4 002 338,58	3 820,67	4 530 232,08	527 893,50	IT0005240830
BONOS ITALY 2.1 2026-07-15	EUR	2 151 395,50	7 689,58	2 240 218,46	88 822,96	IT0005370306
BONOS FRECH TREASURY .75 2028-11-25	EUR	4 200 487,04	(297 521,91)	4 334 805,39	134 318,35	IT0004356843
BONOS FRECH TREASURY 2029-11-25	EUR	2 407 681,01	(17 678,48)	2 550 483,85	142 802,84	FR0013341682
BONOS EIRE .3 2023-03-20	EUR	2 309 151,17	(647,56)	2 386 966,56	77 815,39	FR0013451507
BONOS EIRE .5 2025-03-13	EUR	2 335 078,29	(105 612,38)	2 371 850,19	36 771,90	IE00B4S3JD47
BONOS EIRE .8 2022-03-15	EUR	2 132 062,85	(141 829,71)	2 221 666,42	89 603,57	IE00B4TV0D44
BONOS EIRE .1 2026-05-15	EUR	2 267 564,90	(29 299,34)	2 283 415,12	15 850,22	IE00B4S3CQ36
BONOS ITALY .25 2029-11-01	EUR	1 436 089,98	(2 847,76)	1 533 189,68	97 099,70	IE00B4S3CQ36
BONOS ITALY .45 2024-11-15	EUR	2 733 509,15	(56 256,03)	2 917 779,35	184 270,20	IT0001278511
BONOS ITALY .35 2030-04-01	EUR	5 092 242,45	165 556,35	5 700 152,63	607 910,18	IT0005282527
BONOS BELGIUM .6 2024-06-22	EUR	2 470 893,57	10 165,70	2 704 871,80	233 978,23	BE0000332412
BONOS ITALY .4 2025-05-26	EUR	2 337 432,93	(169 755,32)	2 429 968,74	92 535,81	IT0005383309
BONOS ITALY .1.35 2022-04-15	EUR	1 918 292,49	1 879,69	2 024 073,83	105 781,34	IT0005410912
BONOS PORTUGAL .475 2030-10-18	EUR	7 018 947,65	(129 605,18)	7 106 852,41	87 904,76	IT0005086886
	EUR	1 770 493,02	2 070,03	1 851 818,47	81 325,45	PTOTELOEO028



CLASE 8.^a



002676075

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Anexo III. Cartera de inversiones financieras al 31 de diciembre de 2020
(Expresado en euros)

Cartera Exterior	Divisa	Valoración inicial	Intereses	Valor razonable	(Minusvalía) / Plusvalía	ISIN
BONOS ITALY 1.65 2030-12-01	EUR	4 829 433,38	2 766,29	5 219 873,19	390 439,81	IT0005413171
BONOS REP ESLOVACIA 3.375 2024-11-15	EUR	2 842 169,26	(174 761,29)	2 963 545,51	121 376,25	SK4120008871
BONOS FRECH TREASURY 5 2026-05-25	EUR	4 600 749,98	13 657,64	4 886 509,37	285 759,39	FR0013131877
BONOS PORTUGAL 9 2035-10-12	EUR	2 419 105,28	9 015,87	2 550 212,23	131 106,95	PTOTENOE0034
BONOS HOLLAND 2.25 2022-07-15	EUR	4 406 919,64	(216 101,42)	4 441 052,65	34 133,01	NL0010060257
BONOS HOLLAND 1.75 2023-07-15	EUR	3 813 883,65	(131 860,05)	3 882 889,64	69 005,99	NL0010418810
BONOS HOLLAND .25 2025-07-15	EUR	3 205 994,57	1 747,18	3 344 196,93	138 202,36	NL0011220108
BONOS HOLLAND .5 2026-07-15	EUR	3 216 378,99	2 117,06	3 417 515,16	201 136,17	NL0011819040
BONOS HOLLAND .75 2027-07-15	EUR	1 002 603,83	2 727,50	1 093 755,10	91 151,27	NL0012171458
BONOS HOLLAND .25 2029-07-15	EUR	2 572 913,74	(1 344,74)	2 680 738,58	107 824,84	NL0013332430
BONOS PORTUGAL 2.2 2022-10-17	EUR	3 848 714,70	(119 076,87)	3 925 790,84	77 076,14	PTOTEOE0013
BONOS PORTUGAL 4.125 2027-04-14	EUR	2 616 131,00	(64 515,36)	2 946 947,83	330 816,83	PTOTEUOE0019
BONOS PORTUGAL .508 2021-05-19	EUR	2 767 113,34	(141 546,05)	2 774 004,45	6 891,11	PTOTVHOE0007
BONOS PORTUGAL .00000001 2021-02-12	EUR	953 341,95	(39 570,64)	955 980,77	2 638,82	PTOTVHOE0008
BONOS PORTUGAL .50624176 2021-05-31	EUR	5 268 842,32	(173 995,09)	5 285 426,55	16 584,23	PTOTVHOE0006
BONOS PORTUGAL .51 2021-06-07	EUR	1 037 497,87	(21 267,45)	1 047 893,56	10 395,69	PTOTVLOE0001
BONOS REP ESLOVENIA 2.125 2025-07-28	EUR	1 525 303,58	(34 072,57)	1 616 257,64	90 954,06	SI0002103545
BONOS REP ESLOVENIA .275 2030-01-14	EUR	4 144 426,37	7 177,48	4 180 761,75	36 335,38	SI0002103966
BONOS PORTUGAL 2.875 2025-10-15	EUR	4 655 055,68	(137 396,58)	5 036 255,87	381 200,19	PTOTEKOE0011
BONOS HOLLAND .75 2028-07-15	EUR	1 021 949,19	(1 128,22)	1 08 670,82	86 721,63	NL0012818504
BONOS FRECH TREASURY 3.25 2021-10-25	EUR	3 561 189,62	(453 722,91)	3 566 810,17	5 620,55	FR0011059088
BONOS GEB LUXEMBURGO .625 2027-02-01	EUR	595 497,65	4 830,35	641 959,78	46 462,13	LU1556942974
BONOS LAND NIEDERSACH .00001 2027-02-11	EUR	8 146 866,44	(18 814,86)	8 258 895,57	112 029,13	DE000A254RB5
BONOS AUSTRIA .6.25 2027-07-15	EUR	2 270 569,07	(182 561,58)	2 415 339,11	144 770,04	AT0000338364
BONOS AUSTRIA .3.5 2021-09-15	EUR	3 376 621,40	(266 384,79)	3 384 285,61	7 664,21	AT0000A001X2
BONOS AUSTRIA .1.65 2024-10-21	EUR	1 849 446,69	(57 336,36)	1 917 900,66	68 453,97	AT0000A185T1
BONOS AUSTRIA .75 2026-10-20	EUR	2 865 171,83	(18 954,78)	3 054 545,25	189 373,42	AT0000A1K9C8
BONOS AUSTRIA .05 2029-02-20	EUR	315 651,16	10 471,33	316 139,65	488,49	AT0000A269M8
BONOS FINLAND .5 2028-09-15	EUR	2 086 113,63	(11 681,58)	2 181 733,09	95 619,46	FI4000348727
BONOS FINLAND .5 2026-04-15	EUR	904 016,27	1 869,48	959 395,00	55 378,73	FI4000197959
BONOS DEUTSCHLAND .5 2027-02-15	EUR	1 808 450,83	2 408,97	1 912 315,46	103 864,63	DE0001102416
BONOS BELGIUM .8 2025-06-22	EUR	2 051 295,76	(10 440,97)	2 154 137,41	102 841,65	BE0000334434
BONOS FRECH TREASURY 2.25 2024-05-25	EUR	8 012 782,58	(502 513,64)	8 312 775,15	299 992,57	FR0011619436
BONOS BELGIUM .2 2023-10-22	EUR	2 522 094,80	(8 666,50)	2 574 200,40	52 105,60	BE0000339482
BONOS DEUTSCHLAND .1 2024-08-15	EUR	3 195 773,84	(67 381,23)	3 273 603,70	77 829,86	DE0001102366
BONOS DEUTSCHLAND .5 2025-02-15	EUR	3 141 119,46	(31 380,67)	3 202 775,42	61 655,96	DE0001102374
BONOS AUSTRIA .00001 2024-07-15	EUR	821 103,24	(6 354,18)	826 226,18	5 122,94	AT0000A28KX7
BONOS DEUTSCHLAND .1 2029-08-15	EUR	2 109 199,96	(7 000,55)	2 118 660,55	9 460,59	DE0001102473
BONOS BELGIUM .4.5 2026-03-28	EUR	3 298 141,95	(168 459,11)	3 440 144,04	142 002,09	BE0000324336
BONOS BELGIUM .1 2026-06-22	EUR	1 664 331,93	(10 370,33)	1 763 858,77	99 526,84	BE0000337460
BONOS BELGIUM .8 2027-06-22	EUR	4 099 061,45	(5 535,64)	4 392 848,52	293 787,07	BE0000341504
BONOS BELGIUM .9 2029-06-22	EUR	5 584 318,14	8 801,94	5 600 469,29	16 151,15	BE0000347568



CLASE 8.^a



002676076

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Anexo III. Cartera de inversiones financieras al 31 de diciembre de 2020
(Expresado en euros)

Cartera Exterior	Divisa	Valoración inicial	Intereses	Valor razonable	(Minusvalía) / Plusvalía	ISIN
BONOS DEUTSCHLAND 0.00001 2030-08-15	EUR	1 048 954,58	(1 574,58)	1 062 194,10	13 239,52	DE0001030708
BONOS DEUTSCHLAND 2 2023-08-15	EUR	3 537 631,65	(147 098,62)	3 605 567,88	67 936,23	DE0001102325
BONOS DEUTSCHLAND 1.75 2024-02-15	EUR	4 470 757,26	(115 321,29)	4 603 839,53	133 082,27	DE0001102333
BONOS AUSTRIA 2030-02-20	EUR	4 141 424,30	(3 790,06)	4 166 670,06	25 245,76	AT0000A2CQD2
BONOS LAND NORDRHEIN-1.125 2023-03-16	EUR	3 250 853,13	22 513,30	3 311 453,07	60 599,94	DE000NRW0JF6
BONOS FRECH TREASURY 1.75 2023-05-25	EUR	4 353 845,39	(134 772,10)	4 415 843,88	61 998,49	FR0011486067
BONOS FRECH TREASURY 8.5 2023-04-25	EUR	1 385 810,64	(130 291,90)	1 403 281,08	17 470,44	FR0000571085
BONOS DEUTSCHLAND 25 2028-08-15	EUR	105 375,73	(528,90)	107 893,42	2 517,69	DE0001102457
BONOS FRECH TREASURY 5 2025-05-25	EUR	3 112 421,56	(21 815,61)	3 186 676,71	74 255,15	FR0012517027
BONOS DEUTSCHLAND 2030-02-15	EUR	9 406 261,82	(29 681,12)	9 536 921,12	130 659,30	DE0001102499
BONOS DEUTSCHLAND 1.5 2022-09-04	EUR	4 293 498,37	(160 064,24)	4 331 301,50	37 803,13	DE0001135499
BONOS DEUTSCHLAND 0 2022-04-08	EUR	3 228 351,28	(19 781,76)	3 249 189,76	20 838,48	DE0001141752
BONOS DEUTSCHLAND 0.00001 2024-10-18	EUR	3 104 337,99	(15 571,72)	3 102 871,72	(1 466,27)	DE0001141802
BONOS FREIE HANSESTADT 5 2026-04-27	EUR	4 452 117,22	(15 057,29)	4 510 483,15	58 365,93	DE000A1YCQK7
BONOS FREIE BREMEN 1 2039-05-27	EUR	3 502 462,45	(14 029,70)	3 650 233,09	147 770,64	DE0001102390
BONOS DEUTSCHLAND 1 2025-08-15	EUR	3 827 724,19	3 641,74	4 114 572,37	286 848,18	DE000A2G8W65
BONOS NRW BANK 625 2027-02-23	EUR	3 232 685,11	(58 281,37)	3 317 363,84	84 678,73	DE0001102382
BONOS NRW BANK 625 2027-02-23	EUR	5 298 710,25	(11 669,89)	5 368 059,23	69 348,98	DE000NWB17S6
BONOS FINLAND 1.5 2023-04-15	EUR	1 072 148,25	(27 996,06)	1 090 110,99	17 962,74	FI4000062625
BONOS FINLAND 2 2024-04-15	EUR	1 764 988,18	(50 276,25)	1 819 262,77	54 274,59	FI4000079041
BONOS DEUTSCHLAND 5 2027-08-15	EUR	101 505,33	(193,11)	108 642,15	7 136,82	DE0001102424
TOTALES Deuda pública		359 913 925,41	(5 957 293,18)	374 916 357,55	15 002 432,14	
Renta fija privada cotizada						
BONOS ALTRIA 1 2023-02-15	EUR	5 004 708,47	41 662,89	5 106 052,96	101 344,49	XS1843444081
BONOS CITIGROUP 1.75 2025-01-28	EUR	1 562 515,58	(5 353,90)	1 638 225,70	75 710,12	XS1173792059
BONOS SANT CONS FINAN 5 2021-10-04	EUR	701 106,09	(41,83)	705 813,67	4 707,58	XS1690133811
BONOS ATYI-524 2021-03-04	EUR	6 081 205,47	(34 117,44)	6 117 544,44	36 338,97	XS1907118464
BONOS BANK OF AMERICA -51 2021-01-25	EUR	4 166 844,30	1 015,83	4 196 006,29	29 161,99	XS1811433983
BONOS ROYAL BK OF SCO -54 2021-03-18	EUR	2 001 641,93	(1 124,73)	2 006 634,73	4 992,80	XS2013531228
BONOS BMW FINANCE NV 125 2022-07-13	EUR	2 549 497,18	245,88	2 562 865,46	13 368,28	XS2010445026
BONOS IBER INTL 3.25 2021-02-12	EUR	2 944 868,80	70 400,05	2 971 100,52	26 231,72	XS1890845875
BONOS ATYI2.35 2029-09-05	EUR	2 180 844,03	(7 448,08)	2 345 142,60	164 298,57	XS1907120791
BONOS INGGROEPI 2.5 2030-11-15	EUR	3 334 058,58	1 257,63	3 351 226,22	17 167,64	XS1909186451
BONOS TELEFONICA SAU 1.788 2029-03-12	EUR	2 014 920,72	26 340,50	2 251 583,45	236 662,73	XS1961772560
BONOS GLENCORE FIN EU 1.5 2026-10-15	EUR	2 068 796,09	3 173,94	2 117 454,83	48 658,74	XS1981823542
BONOS BERDROLA FINAN 1.25 2026-10-28	EUR	5 296 846,32	(42 856,42)	5 433 115,32	136 269,00	XS1847692636
BONOS TORONTO DOMINIO 3.75 2024-04-25	EUR	2 002 561,45	4 301,40	2 033 975,59	31 414,14	XS1985806600
BONOS ORANGE SA 1.25 2027-08-07	EUR	501 798,95	2 853,02	541 577,80	39 778,85	FR0013506292
BONOS GASMET FENOSA FNI 1.25 2026-01-15	EUR	2 036 203,77	13 279,44	2 125 920,12	89 716,35	XS2156506854
BONOS METRONIC GL HI-5201785 2021-03-07	EUR	1 914 986,78	(4 543,88)	1 915 861,78	875,00	XS1960675822
BONOS E.ON 3.75 2023-04-20	EUR	2 990 729,07	8 971,76	3 038 733,17	48 004,10	XS2177575177
BONOS COCA-COLA EUROPE 2 2028-12-02	EUR	2 246 222,46	500,41	2 258 226,03	12 003,57	XS22264977146

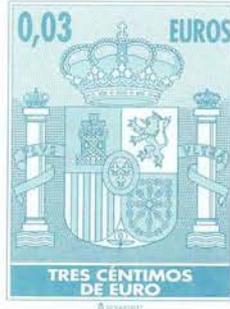


002676077

CLASE 8.ª

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Anexo III. Cartera de inversiones financieras al 31 de diciembre de 2020
(Expresado en euros)



002676078

Cartera Exterior	Divisa	Valoración inicial	Intereses	Valor razonable	(Minusvalía) / Plusvalía	ISIN
BONOS HOLCIM FINANCE ,5 2031-04-23	EUR	2 700 394,29	1 434,65	2 714 010,77	13 616,48	XS2261215011
BONOS MUENCHENER R ,1 ,25 2041-05-25	EUR	2 724 681,47	8 971,53	2 811 071,58	86 390,11	XS2221845683
BONOS KFW ,00001 2028-09-15	EUR	3 963 063,74	(2 145,64)	3 966 061,42	2 997,68	XS2209794408
BONOS DEUT BSHN ,375 2029-06-23	EUR	1 776 377,28	3 654,55	1 847 683,73	71 306,45	XS2193666042
BONOS SIEMENS FINANC ,125 2022-06-05	EUR	1 704 521,74	(78,23)	1 711 937,01	7 415,27	XS2182049291
BONOS BBVA 1 2026-06-21	EUR	2 831 894,19	11 578,07	2 844 880,64	12 986,45	XS2013745703
BONOS FRESENIUS MEDIC 1 2026-05-29	EUR	2 278 608,67	12 918,75	2 376 203,84	97 595,17	XS2178769076
BONOS BMW FINANCE NV ,875 2025-04-03	EUR	3 019 119,84	14 369,77	3 136 321,87	117 202,03	XS1589881785
BONOS TELEFONICA SAU 1,20 2027-08-21	EUR	3 926 975,88	26 508,51	4 174 986,70	248 010,82	XS2477441990
BONOS LINDE FINANCE ,25 2027-05-19	EUR	3 688 667,90	6 777,79	3 774 725,61	86 057,71	XS2177021271
BONOS SAP ,125 2026-05-18	EUR	3 465 830,56	6 258,34	3 554 877,55	89 046,99	XS2176715584
BONOS BBVA ,625 2022-01-17	EUR	1 991 615,53	18 545,13	2 015 154,27	23 538,74	XS1548914800
BONOS NESTLE FINANCE ,001 2024-11-12	EUR	4 435 378,08	1 225,44	4 487 214,56	51 836,48	XS2170362326
BONOS CRH FUNDING BV 1,625 2030-05-05	EUR	639 364,96	6 001,14	706 568,44	67 203,48	XS2169281487
BONOS ATY 1,6 2028-05-19	EUR	2 731 088,98	22 465,02	2 939 136,07	208 067,09	XS2180007549
BONOS E.ON ,375 2027-09-29	EUR	2 481 856,61	4 723,69	2 571 290,01	89 433,40	XS2103014291
BONOS FRESENIUS FIN ,875 2022-01-31	EUR	5 065 678,89	(760,54)	5 082 504,94	16 826,05	XS1554373164
BONOS GENERALI 2,124 2030-10-01	EUR	2 838 321,54	13 287,17	2 877 428,55	39 107,01	XS2056491587
BONOS UNICREDIT SPA ,5 2025-04-09	EUR	3 775 701,79	2 594,38	3 760 171,81	(15 529,98)	XS20663547041
BONOS ENEL FINANCE NV ,001 2024-06-17	EUR	4 954 152,75	11 844,81	5 014 655,19	60 502,44	XS2066706818
BONOS INTESA SANPAOLO ,75 2024-12-04	EUR	5 007 938,06	1 237,96	5 132 936,01	124 997,95	XS2089368596
BONOS E.ON 1 2025-10-07	EUR	689 077,15	1 744,62	725 928,53	36 851,38	XS2152899584
BONOS GOLDMAN SACHS ,534 2021-03-09	EUR	6 043 918,85	(7 384,04)	6 058 836,98	14 918,13	XS1577427526
BONOS EDP FINANCE BV ,375 2026-09-16	EUR	5 984 947,57	9 456,84	6 096 197,41	111 249,84	XS20503052895
BONOS ABBVIE INC 2,625 2028-11-15	EUR	2 100 959,00	5 222,69	2 370 313,75	269 354,75	XS2125914833
BONOS UNICREDIT SPA 1,2 2021-01-20	EUR	4 130 696,53	47 710,44	4 201 267,78	70 571,25	XS2104967695
BONOS ENI ,625 2030-01-23	EUR	2 013 766,58	10 505,03	2 070 609,45	56 842,87	XS2107315470
BONOS TELEFONICA NL 2,502 2021-05-05	EUR	1 185 227,15	27 523,94	1 226 894,41	41 667,26	XS2109819859
BONOS ATY 2,875 2021-05-01	EUR	2 586 208,63	65 068,26	2 623 352,04	37 143,41	XS2114413565
BONOS SIEMENS FINANC 1 2026-02-20	EUR	8 011 371,98	(1 640,39)	8 088 280,39	76 908,41	XS2118280218
BONOS E.ON 1 2022-09-29	EUR	2 619 078,56	(29,77)	2 633 303,32	14 224,76	XS2091216205
BONOS BMW FINANCE NV ,375 2027-01-14	EUR	1 994 505,67	7 996,29	2 050 836,82	56 331,15	XS2102357014
BONOS CITIGROUP ,53367857 2021-03-22	EUR	2 943 597,74	26 190,34	2 992 619,66	49 021,92	XS1795253134
BONOS DAIMLER AG ,75 2030-09-10	EUR	1 326 534,48	3 563,70	1 397 499,56	70 965,08	DE000A289QR9
BONOS MORGANSTANLEY ,517 2021-02-08	EUR	6 485 079,49	(7 096,55)	6 510 353,51	25 274,02	XS1603892065
BONOS BAYER CAPITAL CI ,53367857 2021-03-26	EUR	4 018 605,20	(11 718,63)	4 026 244,07	7 638,87	XS1840614736
BONOS ATY 3,15 2036-09-04	EUR	1 170 186,20	9 125,39	1 460 371,71	290 185,51	XS1629866432
BONOS IRWE FIN 1,625 2026-05-30	EUR	3 281 822,53	(26 066,06)	3 325 411,81	43 589,28	XS1829217345
BONOS VODAFONE 2,875 2037-11-20	EUR	1 226 428,33	(506,97)	1 290 636,42	64 208,09	XS1721422902
BONOS DEUT BSHN ,75 2035-07-16	EUR	1 710 923,70	5 185,77	1 835 242,48	124 318,78	XS2102380776
BONOS GRAND CITY PROP 1,5 2027-02-22	EUR	5 011 213,17	62 235,41	5 353 553,93	342 340,76	XS1781401085
BONOS GM FINL CO ,85 2026-02-26	EUR	5 263 678,30	45 519,97	5 349 987,35	86 309,05	XS2125145867

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Anexo III. Cartera de inversiones financieras al 31 de diciembre de 2020
(Expresado en euros)

Cartera Exterior	Divisa	Valoración inicial	Intereses	Valor razonable	(Minusvalía / Plusvalía)	ISIN
BONOSANTANDER UK GHI-53367857 2021-03-29	EUR	3 340 333,84	(3 593,17)	3 354 945,87	14 612,03	XS1799039976
BONOSBMW FINANCE NVJ.00001 2023-03-24	EUR	3 997 999,20	728,45	4 014 111,55	16 112,35	XS2055727916
BONOSIREPSOL ITLJ.5 2022-05-23	EUR	2 017 543,83	(6 011,89)	2 033 854,08	16 310,25	XS1613140489
BONOSIGM FINL COJ.2 2022-09-02	EUR	8 989 691,54	5 152,69	8 984 966,12	(4 725,42)	XS2049548444
BONOSIBERDROLA FINANJ.875 2025-06-16	EUR	910 850,27	2 278,03	939 595,89	28 745,62	XS2153405118
BONOSIGRAND CITY PROPI1.7 2024-04-09	EUR	2 961 206,01	44 169,93	3 159 287,19	198 081,18	XS2154325562
BONOSIBSANJ-53367857 2021-03-22	EUR	5 007 364,52	(4 774,95)	5 057 700,40	50 335,88	XS1578916261
BONOSIVODAFONE1.125 2025-11-20	EUR	3 157 674,58	(28 782,64)	3 201 443,74	43 769,16	XS1721423462
BONOSIBARCLAYS1.875 2023-12-08	EUR	2 643 554,37	(35 617,11)	2 676 070,88	32 516,51	XS1531174388
BONOSICAP GEMINIJ.5 2021-11-09	EUR	4 997 802,91	1 956,51	5 027 333,94	8 281,08	FR0013218138
BONOSIAGENCE FRANCAISJ.125 2023-11-15	EUR	3 166 753,85	5 161,40	3 299 737,62	90 128,25	FR0013296373
BONOSIAGENCE FRANCAISJ.1 2028-01-31	EUR	3 150 871,73	(23 991,32)	3 190 472,42	132 983,77	FR0013312774
BONOSIORANGE SAI1 2025-09-12	EUR	5 156 087,65	(30 037,14)	5 268 933,03	39 600,69	FR0013359197
BONOSIORW FINJ.75 2033-02-14	EUR	4 657 620,74	35 144,09	4 989 856,89	112 845,38	FR0013365285
BONOSICRHF FUNDING BV1.875 2024-01-09	EUR	3 152 851,15	(16 931,66)	3 241 298,46	332 236,15	XS0162513211
BONOSITOTAL CAPITAL SII.375 2025-03-19	EUR	1 138 964,72	(2 562,73)	1 192 775,54	88 447,31	XS1328173080
BONOSIUNEDICI.5 2029-03-20	EUR	5 292 096,43	(20 004,11)	5 366 193,15	53 810,82	XS1139315581
BONOSIEDP FINANCE BV1.125 2024-02-12	EUR	2 919 072,20	19 703,15	3 010 820,86	74 096,72	FR0013410008
BONOSIGOLDMAN SACHS1.625 2026-07-27	EUR	2 005 563,37	11 891,63	2 165 907,82	91 748,66	XS1471646965
BONOSICITIGROUPJ.75 2023-10-26	EUR	1 953 662,05	29 973,82	2 022 658,51	160 344,45	XS1458408561
BONOSIMORGANSTANLEY1.75 2024-03-11	EUR	4 347 383,60	(9 602,12)	4 513 446,23	68 996,46	XS1457608013
BONOSIBRITISH TELECOMJ.625 2021-03-10	EUR	4 979 000,45	42 236,20	4 991 556,27	166 062,63	XS1379171140
BONOSIAROUNDTOWN SAI.001 2026-07-16	EUR	2 255 143,89	348,73	2 254 019,27	12 555,82	XS1377680381
BONOSIEFSJ.001 2023-07-17	EUR	5 004 714,81	(25 550,67)	5 032 632,63	(1 124,62)	XS2273810510
BONOSIAGENCE FRANCAISJ.25 2029-06-29	EUR	5 026 998,68	2 457,65	5 198 277,97	27 917,82	EU000A1G0EF7
BONOSICADESJ.001 2026-02-25	EUR	5 108 998,29	(1 729,34)	5 117 879,34	171 279,29	FR0013431137
BONOSIENGIE SAI1.5 2021-11-30	EUR	1 102 795,35	1 404,09	1 120 622,28	17 826,93	FR0014000UG9
BONOSIVINCJ.001 2028-11-27	EUR	2 717 871,59	(214,77)	2 707 990,77	(9 880,82)	FR0014000PF1
BONOSIBNPJ.375 2027-10-14	EUR	1 204 208,85	825,69	1 214 979,95	10 771,10	FR00140005J1
BONOSIBANQUE FED CREDI.1 2027-10-08	EUR	1 303 668,79	180,79	1 309 894,39	6 225,60	FR00140003P3
BONOSIORANGE SAI.125 2029-09-16	EUR	1 196 061,27	568,79	1 209 406,83	13 345,56	FR0013534484
BONOSIVINCJ.1.625 2029-01-18	EUR	2 243 567,20	21 835,66	2 270 105,98	26 538,78	FR0013397452
BONOSILVMH MOET HENNEJ.75 2025-04-07	EUR	2 296 600,34	13 207,65	2 388 169,10	91 568,76	FR0013506508
BONOSIELECTRCPORTUGAL1.625 2027-04-15	EUR	1 512 493,92	(2 278,30)	1 522 288,30	9 794,38	FI4000440227
BONOSIORANGE SAI.875 2027-02-03	EUR	928 378,30	8 048,16	983 891,65	55 513,35	PTEDPNOM0015
BONOSIORANGE SAI.875 2027-02-03	EUR	3 001 863,29	23 500,00	3 173 321,48	171 458,19	FR0013217114
BONOSIGEMEINSAME BUNDJ.625 2027-10-25	EUR	5 322 491,60	(32 061,43)	5 409 897,73	87 406,13	DE000A2GSM83
BONOSIDEUTSCHETELEMCOMJ.2.25 2039-03-29	EUR	1 199 196,96	13 943,51	1 279 211,83	80 014,87	DE000A2LQRS3
BONOSIVONOVIA SEJ.125 2023-04-06	EUR	5 004 547,59	3 019,85	5 035 986,31	31 438,72	DE000A2R8NC5
BONOSIVONOVIA SEJ.625 2027-10-07	EUR	3 993 121,16	6 992,25	4 142 669,67	149 548,51	DE000A2R8ND3
BONOSIBER INTL1.75 2023-09-17	EUR	1 883 689,65	(35 280,92)	1 940 282,56	56 592,91	XS1291004270



CLASE 8.ª



002676079

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Anexo III. Cartera de inversiones financieras al 31 de diciembre de 2020

(Expresado en euros)

Cartera Exterior	Divisa	Valoración inicial	Intereses	Valor razonable	(Minusvalía) / Plusvalía	ISIN
BONOSIENGIE SA 375 2027-06-11	EUR	2 204 008,35	4 281,69	2 247 936,67	43 928,32	FR0013517190
BONOSIDAIMLERCHRYSLE 875 2024-04-09	EUR	4 729 029,17	680,45	4 754 324,43	25 295,26	DE000A194DD9
BONOSIINTESA SANPAOLO 4 2023-10-30	EUR	3 436 348,34	(114 805,02)	3 474 698,58	38 350,24	XS0986194883
BONOSIVONOVIA SE 1,625 2024-04-07	EUR	399 647,43	4 846,79	421 573,81	21 926,38	DE000A28VQC4
BONOSICREDIT SUISSE 1,25 2021-07-17	EUR	2 788 113,36	28 650,04	2 902 219,66	134 106,30	CH0343366842
BONOSIKBCI-528 2021-02-24	EUR	2 991 687,04	5 518,05	3 016 029,78	24 342,74	BE0002281500
BONOSIANHEUSER SANV 2,75 2036-03-17	EUR	2 365 846,44	37 806,96	2 531 700,99	165 854,55	BE6285457519
BONOSIANHEUSER-BUSCH 2,125 2027-12-02	EUR	1 003 829,71	1 358,69	1 139 339,67	135 509,96	BE6320934266
BONOSISANI1,375 2022-12-14	EUR	5 595 258,55	(90 943,07)	5 668 227,29	72 968,74	XS1330948818
BONOSIDAIMLER AG 1,4 2024-01-12	EUR	2 088 340,73	(3 896,86)	2 119 538,83	51 198,10	DE000A169G15
BONOSIBANK OF AMERICA 1,375 2021-09-10	EUR	2 612 791,41	(23 661,24)	2 641 417,12	28 625,71	XS1107731702
BONOSIDAIMLER AG 2,375 2022-09-12	EUR	1 552 307,03	(97 098,37)	1 569 264,92	16 957,89	DE000A1PGWA5
BONOSIKFW 0001 2025-02-18	EUR	5 070 089,95	(13 362,79)	5 143 262,79	73 172,84	DE000A254PM6
BONOSIKFW 01 2027-03-31	EUR	1 021 740,90	(2 730,63)	1 036 790,63	15 049,73	DE000A254PP9
BONOSIBANK OF AMERICA 1,375 2025-02-07	EUR	868 342,89	1 950,12	894 866,39	26 523,50	XS1560863802
BONOSIANHEUSER-BUSCH 2,875 2032-04-02	EUR	2 399 788,83	32 197,19	2 521 789,66	122 000,83	BE6320935271
BONOSIGROUPE AUCHAN 2,875 2026-01-29	EUR	4 381 718,55	64 581,55	4 449 833,62	68 115,07	FR0013510179
BONOSIUBS GROUP AG 2,125 2024-03-04	EUR	2 955 320,18	(17 855,26)	3 067 117,40	111 797,22	CH0314209351
BONOSITELEFONICA SAU 3,987 2023-01-23	EUR	2 939 547,28	(172 407,71)	2 984 189,59	44 642,31	XS0874864860
BONOSIRESEAU FERRE 1,125 2030-05-25	EUR	4 292 924,36	(17 272,00)	4 388 863,21	95 938,85	XS1186684137
BONOSIENJ1,5 2026-02-02	EUR	4 282 619,79	(6 952,62)	4 366 502,78	83 882,99	XS1180451657
BONOSIENEL FINANCE NV 1,966 2025-01-27	EUR	6 413 185,40	(18 810,52)	6 627 088,55	213 903,15	XS1176079843
BONOSICITIGROUP 1,75 2025-01-28	EUR	1 562 515,58	(5 353,90)	1 638 225,70	75 710,12	XS1173792059
BONOSICREDIT AGRICOLE 1,125 2027-12-09	EUR	3 700 742,78	284,50	3 695 850,27	(4 892,51)	FR00140000Y93
BONOSIMORGANSTANLEY 2,375 2021-03-31	EUR	2 807 749,74	(100 139,52)	2 818 705,33	10 955,59	XS1050547857
BONOSIGENERAL 5,125 2024-09-16	EUR	3 041 576,04	(40 510,28)	3 179 633,16	138 057,12	XS1116263325
BONOSIMORGANSTANLEY 1,875 2023-03-30	EUR	1 236 761,31	(40 851,33)	1 261 134,89	24 373,58	XS0452314536
BONOSIREPSOL ITL 3,625 2021-10-07	EUR	2 110 937,84	(41 629,61)	2 162 985,77	52 047,93	XS1115208107
BONOSIREPSOL ITL 2,25 2026-12-10	EUR	3 388 629,58	(51 851,08)	3 724 443,68	335 814,10	XS0935427970
BONOSITOTAL CAPITAL S 2,5 2026-03-25	EUR	5 484 748,62	(415 520,92)	5 505 943,65	21 195,03	XS0975256685
BONOSIBM 1,25 2023-05-26	EUR	1 559 628,06	(37 384,72)	1 972 264,40	138 971,06	XS1148073205
BONOSICITIGROUP 2,125 2026-09-10	EUR	3 062 596,80	(25 845,09)	1 655 762,30	96 134,24	XS1048519679
BONOSIREPSOL ITL 2 2025-12-15	EUR	3 368 917,89	(45 472,78)	3 123 561,78	60 964,98	XS1143163183
BONOSIGOLDMAN SACHS 4,75 2021-10-12	EUR	3 066 423,05	(5 603,89)	3 293 774,03	244 483,82	XS1107727007
TOTALES Renta fija privada cotizada	EUR	1 886 368,36	(220 781,28)	1 895 310,81	8 942,45	XS21566581394
Emissiones avaladas		427 165 768,45	(917 512,10)	437 624 689,05	10 458 920,60	XS0270347304
BONOSIEUROPEAN STABIL 1 2023-07-31	EUR	4 007 990,50	2 222,60	4 084 587,27	76 596,77	EU000A1Z99E3
BONOSIEUROPEAN COMMUN 0,0001 2030-10-04	EUR	1 870 551,97	(1 345,28)	1 874 016,22	3 464,25	EU000A283859
BONOSIICO 2 2024-01-31	EUR	1 000 848,83	1 534,03	1 021 636,57	20 787,74	XS1979491559
BONOSIICO 1 2021-07-30	EUR	2 944 619,33	11 013,92	2 956 638,39	12 019,06	XS1644451434



002676080

CLASE 8.^a

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Anexo III. Cartera de inversiones financieras al 31 de diciembre de 2020
(Expresado en euros)

Cartera Exterior	Divisa	Valoración inicial	Intereses	Valor razonable	(Minusvalía) / Plusvalía	ISIN
BONOSIUNEDIC 2030-03-05	EUR	2 550 540,16	(4 025,05)	2 561 250,05	10 709,89	FR0013489259
BONOSI EUROPEAN COMMUN :00001 2035-07-04	EUR	2 562 348,90	(367,23)	2 570 217,23	7 868,33	EU000A285VM2
BONOSI CO :00001 2026-04-30	EUR	1 656 825,03	(677,58)	1 668 170,58	11 345,55	XS2250026734
BONOSI EUROPEAN COMMUN :00001 2025-11-04	EUR	1 900 741,81	(1 429,29)	1 904 031,61	3 289,80	EU000A284451
TOTALES Emisiones avaladas		18 494 466,53	6 926,12	18 640 547,92	146 081,39	
Valores de entidades de crédito garantizados						
CEDULAS HIPOTECARIAS DNB NOR BOLIGK :25 2023-04-	EUR	1 490 126,39	7 960,93	1 520 839,48	30 713,09	XS1396253236
CEDULAS HIPOTECARIAS NORDEA MBANK :25 2023-02-28	EUR	1 493 204,09	6 914,59	1 522 659,25	29 455,16	XS1784067529
CEDULAS HIPOTEC. INTESA SANPAOLO :1.375 2025-12-18	EUR	5 070 912,72	16 907,14	5 548 160,46	477 247,74	IT0005156044
CEDULAS HIPOTECARIAS CREDIT AGR HL :01 2031-11-03	EUR	5 339 455,18	(2 736,02)	5 425 250,24	85 795,06	FR0013487071
CEDULAS HIPOTEC. CM-CIC COVERED :125 2030-01-28	EUR	7 551 796,07	3 905,30	7 777 752,49	225 956,42	FR0013478898
CEDULAS HIPOTEC. BPOE SFH - SOCI :01 2026-11-08	EUR	6 014 429,03	(1 402,63)	6 156 529,75	142 100,72	FR0013459047
CEDULAS HIPOTEC. FED. CAISSES DE :05 2027-11-26	EUR	5 259 807,06	(1 083,90)	5 376 180,61	116 373,55	XS2083301106
CEDULAS HIPOTEC. CR AGRICOLE SCF :625 2029-03-29	EUR	5 140 846,36	2 936,06	5 397 579,69	256 733,33	FR0013411600
TOTALES Valores de entidades de crédito garantizados		37 360 576,90	33 401,47	38 724 951,97	1 364 375,07	
Acciones y participaciones Directiva						
ETF CONCEPT FUND	USD	33 948 296,72	-	60 806 286,58	26 857 989,86	IE00BJ0KDR00
ETF CONCEPT FUND	USD	33 948 296,72	-	60 806 286,58	26 857 989,86	IE00BJ0KDR00
ETF ISHARES ETF S/IR	USD	10 393 674,37	-	10 308 959,19	(84 715,18)	IE00B3B8PX14
ETF ISHARES ETF S/IR	GBP	23 199 789,64	-	24 461 655,55	1 261 865,91	IE00B53HP851
PARTICIPACIONES SIG FUND S SICAV	JPY	8 055 792,48	-	12 742 107,01	4 686 314,53	LU0328437438
ETF IDB X-TRACKERS	CHF	22 787 503,63	-	27 730 038,66	4 942 535,03	LU0943504760
PARTICIPACIONES ALLIANZ GI LUX	EUR	9 697 031,00	-	13 762 043,77	4 065 012,77	LU0256883504
PARTICIPACIONES ROBECO LUX	USD	7 198 588,46	-	8 355 723,69	1 157 155,23	LU0226954369
PARTICIPACIONES INVEST GT S LX	EUR	12 389 108,84	-	12 670 922,88	281 814,04	LU0100598282
PARTICIPACIONES BROWN PLC IRL	EUR	4 590 013,71	-	9 473 368,14	4 883 354,43	IE00B8FXN005
ETF ISHARES ETF S/IR	EUR	9 739 103,50	-	10 962 850,00	1 223 746,50	IE00B52VJ196
ETF BLACKROCK DEUTS	EUR	9 707 991,00	-	10 778 600,00	1 070 609,00	DE000A0Q4R02
PARTICIPACIONES IT ROWE P F LUX	USD	8 063 863,00	-	10 789 249,79	2 725 386,79	LU0429319774
PARTICIPACIONES GLOBAL FUNDS	USD	9 405 115,12	-	12 044 862,10	2 639 746,98	IE00BZ1CSN85
TOTALES Acciones y participaciones Directiva		169 175 651,47	-	224 886 667,36	55 710 815,39	
Acciones y participaciones no Directiva						
ETF NOMURA ASSET MA	JPY	54 008 057,46	-	62 430 632,63	8 422 575,17	JP3027630007
ETF ISHARES ETF SIUS	USD	19 966 426,37	-	20 198 092,74	231 666,37	US4642875805
ETF ISHARES ETF SIUS	USD	18 881 278,63	-	19 652 109,85	770 831,22	US4642877702
ETF ISHARES ETF SIUS	USD	15 111 695,41	-	21 292 104,94	6 180 409,53	US4642878122
ETF ISSGA FUNDS	USD	179 853 084,20	-	218 822 248,60	38 969 164,40	US78462F1030
ETF ISHARES ETF SIUS	USD	31 547 292,90	-	35 017 394,51	3 470 101,61	US4642877546
ETF ISSGA FUNDS	USD	50 113 636,91	-	63 857 897,11	13 744 260,20	US81369Y8030
TOTALES Acciones y participaciones no Directiva		369 481 471,88	-	441 270 480,38	71 789 008,50	
TOTAL Cartera Exterior		1 381 592 060,64	(6 834 447,69)	1 536 063 694,23	154 471 633,59	



CLASE 8.^a



002676081

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Anexo IV. Cartera de inversiones en derivados al 31 de diciembre de 2020
(Expresado en euros)



CLASE 8.ª



002676082

Descripción	Divisa	Importe Nominal Comprometido	Valor razonable	Vencimiento del contrato
Compras al contado				
Futuros comprados				
FUTURO F US TRE5 100000 FISICA	USD	42 021 611,73	41 102 850,30	31/03/2021
FUTURO F NASDAQM 20	USD	8 147 005,31	8 438 096,02	19/03/2021
FUTURO F SP 60 200	CAD	26 806 004,43	26 466 540,62	19/03/2021
FUTURO F US 2YR NOTE 200000 FISICA	USD	89 246 275,74	87 185 939,41	31/03/2021
FUTURO FUT EUROS TOXX 10	EUR	61 803 500,00	62 480 000,00	19/03/2021
FUTURO F SPI 200 25	AUD	24 162 101,49	24 234 639,15	18/03/2021
FUTURO FUT MSCIA 100	USD	10 241 014,12	10 541 071,50	19/03/2021
FUTURO F SYP500M 50	USD	49 638 558,43	50 632 505,22	19/03/2021
FUTURO F MINI MSCI EME 50	USD	11 860 699,14	12 126 468,30	19/03/2021
TOTALES Futuros comprados		323 926 770,39	323 208 110,52	
Otros comprados a plazo				
Otros compromisos de compra				
OTROS I C LU0256883504	EUR	9 697 031,00	13 762 043,77	
OTROS I C LU0100598282	EUR	12 389 108,84	12 670 922,88	
TOTALES Otros compromisos de compra		22 086 139,84	26 432 966,65	
Ventas al contado				
Futuros vendidos				
FUTURO FUT EUR/CAD CME 125000 CAD	CAD	11 038 367,12	11 057 864,21	15/03/2021
FUTURO FUT US ULTRA 100000 FISICA	USD	9 918 471,14	9 614 814,00	22/03/2021
FUTURO FUT EUR/AUD CME 125000 AUD	AUD	7 140 144,62	7 150 582,76	15/03/2021
FUTURO F EUROUSD FIX 125000 USD	USD	528 808 259,13	527 520 771,09	15/03/2021
FUTURO F BOBL 100000 FISICA	EUR	12 827 850,00	12 842 100,00	8/03/2021
FUTURO FUT CHF 125000 CHF	CHF	28 159 027,31	28 131 762,44	15/03/2021
FUTURO FUT BUND 10Y 100000 FISICA	EUR	20 511 120,00	20 606 240,00	8/03/2021
FUTURO FUT EUR/JPY CME 125000 JPY	JPY	87 180 496,81	87 047 179,72	15/03/2021
FUTURO F EURBUXL 100000 FISICA	EUR	11 114 000,00	11 262 000,00	8/03/2021
FUTURO F 10YR ULTRA 100000 FISICA	USD	20 502 107,19	19 966 490,01	22/03/2021
FUTURO FUT EUR/GBP CME 125000 GBP	GBP	23 903 287,34	23 957 034,57	15/03/2021
TOTALES Futuros vendidos		761 103 130,66	759 156 838,80	
TOTALES		1 107 116 040,89	1 108 797 915,97	



CLASE 8.^a



002676083

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Informe de gestión del ejercicio 2021

Exposición fiel del negocio y actividades principales

2021 fue un ejercicio positivo para los activos de riesgo en los mercados desarrollados. El año se ha caracterizado por un fondo de recuperación económica, con sólidos resultados empresariales y las distintas olas de Covid19 haciendo presencia (con especial virulencia la variante Ómicron en diciembre). A lo largo del ejercicio hemos visto la inflación alcanzando cotas inéditas en las últimas décadas y a los bancos centrales anunciando y comenzando a ejecutar una gradual retirada del ritmo de estímulo en la economía.

Salvo en China, que ha mantenido una política monetaria contraria a la de los bancos centrales desarrollados, hemos visto un giro gradual a lo largo del ejercicio desde el total soporte monetario a bancos centrales manifestando su preocupación por el entorno de inflación y endureciendo el tono de su política monetaria a partir del verano, en todo caso manteniendo todavía un entorno y niveles muy expansivos. A nivel global, desde el segundo trimestre, la extraordinaria demanda de bienes generaba atascos en las cadenas de suministro y presión sobre los costes. En Europa, el suministro de gas desde Rusia se veía impactado por cuestiones geo-políticas y la falta de inversión en otras fuentes de energía provocaban un impacto en los precios.

El Banco Central Europeo (BCE) ha mantenido un discurso y política monetaria laxa durante todo el ejercicio, aunque confirmaba que su programa de emergencia de compra de activos (PEPP) terminaría en marzo del 2022, programando la reducción para el segundo y tercer trimestre del 2022. Sin embargo, la Reserva Federal (FED) y el Banco de Inglaterra reaccionaban ante un mercado laboral tensionado y las presiones inflacionistas: la Fed cambiaba gradualmente el tono de su discurso en verano y comenzó a ejecutar su retirada de estímulo en el cuarto trimestre, anunciando una aceleración del ritmo en enero del 2022. Al cierre del ejercicio, el mercado descontaba entre dos y tres subidas de tipos en los próximos doce meses. El Banco de Inglaterra subía su tipo de referencia a corto plazo de 0,15%, hasta 0,25%, en diciembre. La política monetaria en China tomaba una dirección contraria, provocada por la velocidad de la desaceleración en su crecimiento debido a la retirada de estímulo mantenida a lo largo del año, el impacto de sus medidas de protección contra el virus, el impacto de sus reformas regulatorias y la preocupación por la evolución en algunos sectores como el inmobiliario: el Banco Popular de China (BPC) relajaba la presión monetaria reduciendo en diciembre su requisito de reservas a la banca para afrontar un menor crecimiento.



CLASE 8.^a



002676084

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Informe de gestión del ejercicio 2021

En el terreno político, al inicio del ejercicio el Senado americano se decantaba por el partido demócrata, reforzando la capacidad de maniobra de la administración Biden. Adicionalmente, tuvimos elecciones en el Senado alemán con un resultado que generaba estabilidad y continuidad y en Japón donde el sucesor de Suga, Kishida, consiguió mantener a su partido en el gobierno, se ha llevado a cabo un plan de estímulo fiscal. En EEUU, el plan fiscal se ha ido aprobando, aunque con algo de dilución sobre lo anunciado inicialmente y, de hecho, su última fase "Build Back Better", no consiguió pasar su presupuesto por el Senado en diciembre. Por otro lado, la Unión Europea comenzó en el cuarto trimestre a realizar los primeros desembolsos del fondo de recuperación, "Next Generation EU".

En cuanto a la pandemia, la virulencia de la variante Ómicron a finales de noviembre generó incertidumbre sobre su potencial impacto económico. Pese a su capacidad de contagio, su menor gravedad y el buen funcionamiento de las vacunas, evitó que muchos países añadieran nuevas restricciones. Como en las anteriores olas, tendrá un efecto negativo sobre el crecimiento que se arrastrará al inicio del siguiente ejercicio.

El ejercicio ha sido complicado para los activos de renta fija en términos nominales, con las principales curvas de tipos desplazándose al alza y ganando pendiente. En los primeros meses del año, se cotizó un elevado optimismo fruto de la contundente política monetaria coordinada y las curvas reaccionaron ganando pendiente, para entrar después en un entorno de mayor escepticismo sobre su consistencia en el largo plazo y temor a un error en política monetaria. En EE.UU. la curva recogía el cambio de tono de la FED desde el verano y en el cuarto trimestre los cortos plazos subían con fuerza, provocando un aplanamiento en el semestre. En Europa el movimiento adverso, añadido a los tipos base negativos, pesaban en la rentabilidad del activo, con la periferia europea también registrando un comportamiento negativo. La renta fija corporativa cerraba un ejercicio en positivo con un mejor comportamiento de los activos de mayor riesgo.

La renta variable de los mercados desarrollados tuvo un buen comportamiento en el ejercicio. Destaca el buen comportamiento del mercado americano en positivo frente al mal resultado de los mercados emergentes, con Europa en segundo lugar y Japón por detrás. A nivel global, el momento de mayor volatilidad fue en noviembre cuando el mercado se vio impactado por la variante Ómicron, con una fuerte subida de la volatilidad y una reversión de las tendencias y estilos que habíamos tenido previamente, este impacto revirtió de nuevo en diciembre. Por estilos ha habido bastante rotación a lo largo del año, con predominio final del factor de crecimiento y defensivo, en un mercado que ha sido escéptico en cuanto a la consistencia en el tiempo de las dinámicas de crecimiento de las distintas economías durante gran parte del año.



CLASE 8.^a



002676085

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Informe de gestión del ejercicio 2021

Por otro lado, destaca en negativo el comportamiento de los mercados emergentes afectados por la pandemia, la fortaleza de la divisa americana, el entorno de inflación y las reformas regulatorias en determinados sectores en China. El mercado chino arrastraba a los mercados emergentes asiáticos, Latinoamérica sufría por sus desequilibrios fiscales, riesgo político y la caída de alguna materia prima, como el hierro, y los mercados emergentes de Europa del Este tenían un mejor comportamiento.

El dólar americano se revalorizaba frente al euro, reflejando la divergencia de crecimiento y de las políticas monetarias entre ambos bancos centrales.

El ejercicio se ha caracterizado por, entre otros, 1) una recuperación de las materias primas energéticas, pese a la fuerte corrección provocada por Ómicron a final del año, en especial en el crudo, el gas y el carbón mantuvieron su tensión alcista (en especial en Asia); 2) el movimiento negativo de las materias primas preciosas; 3) un peor comportamiento de los metales industriales, acusando la desaceleración China.

En el ejercicio 2022 el telón de fondo seguirá siendo un entorno de recuperación económica global que se mantiene sin fisuras y que sigue empujado por las distintas políticas económicas ya aplicadas. Una de las incógnitas para este entorno de crecimiento proviene de la desaceleración del crecimiento chino, donde esperamos que el gobierno mantenga una política económica más expansiva.

Esperamos un menor impacto del Covid19 en los mercados, en unas economías que se han conseguido adaptar y unas vacunas que funcionan. Por el contrario, esperamos una mayor inestabilidad debido a los riesgos geo-políticos, donde las relaciones entre Rusia y Europa y EEUU marcarán el paso.

Los Bancos Centrales desarrollados inician una fase de vuelta a la normalidad con el objetivo de proteger sus economías de unas tasas de inflación, que registrarán niveles muy tensionados en los primeros meses del año para retroceder parcialmente después. La disparidad entre Bancos Centrales genera la incertidumbre de un posible error de política monetaria, la cotización de este riesgo podría pesar sobre los tramos largos de la curva de tipos.

Los mercados financieros deberán calibrar el incremento de riesgo y la progresiva pérdida del apoyo que suponían las políticas económicas tan expansivas.



CLASE 8.^a



002676086

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Informe de gestión del ejercicio 2021

El mercado de renta fija deberá hacer frente a la divergencia de políticas monetarias, con retiradas de estímulo y subidas de tipos en algunas economías. Será un ejercicio especialmente táctico con especial valor de las apuestas relativas en la curva de tipos y geográficas. A diferencia de nuestro posicionamiento general para el anterior ejercicio, no establecemos una marcada preferencia por la renta fija corporativa para el 2022, que estará afectada, por un lado, por la retirada de las compras por parte de los bancos centrales y, por otro, por un entorno sólido de crecimiento económico.

Esperamos un ejercicio con mayor volatilidad para la renta variable dados los niveles actuales de valoración, con tipos reales en mínimos y múltiplos bursátiles en máximos, que supondrán un reto para la clase de activo. Tanto por el entorno de crecimiento global como por las valoraciones, mantenemos una ligera preferencia por Europa frente a EEUU, con posiciones más neutrales en los demás mercados, y en términos de estilos preferimos el sesgo valor y cíclico.

Mantenemos una visión en rango lateral, sobre la divisa americana frente al Euro debido a la divergencia de políticas monetarias y un sólido crecimiento en Europa.

La tensión entre Rusia y Ucrania ha ido escalando y desencadenado un conflicto bélico con el contundente rechazo de los países occidentales. Este evento, pone en riesgo nuestro escenario central en la medida en que una lenta resolución del conflicto se transmita, vía escalada de precios de las materias primas, en una inflación elevada y persistente, con su lógico impacto sobre las decisiones de los bancos centrales y el crecimiento europeo. A este respecto, las próximas semanas serán clave para determinar en qué escenario se va a desarrollar el 2022 y su efecto en las distintas clases de activo.

Uso de instrumentos financieros

Dada su actividad, el uso de instrumentos financieros por el Fondo, tal y como se describe en la memoria adjunta, está destinado a la consecución de su objeto social, ajustando sus objetivos y políticas de gestión de los riesgos de mercado, crédito, y liquidez de acuerdo a los límites y coeficientes establecidos por la Ley 35/2003, de 4 de noviembre, y sucesivas modificaciones, de Instituciones de Inversión Colectiva y desarrollados por el Real Decreto 1082/2012, de 13 de julio, y sucesivas modificaciones, por el que se reglamenta dicha Ley y las correspondientes Circulares emitidas por la Comisión Nacional del Mercado de Valores.



CLASE 8.^a



002676087

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Informe de gestión del ejercicio 2021

Objetivo de inversión sostenible

Periodo de referencia: 09/07/2021-31/12/2021



¿En qué medida se ha alcanzado el objetivo de inversión sostenible de este producto financiero?

Durante el periodo de referencia, la Sociedad Gestora ha tomado decisiones de inversión para la gestión de este Fondo destinadas a perseguir un objetivo de inversión sostenible en virtud del artículo 9 del Reglamento (UE) 2019/2088, integrando los riesgos de sostenibilidad en el proceso de inversión además de invertir siguiendo criterios de impacto. Estas inversiones están relacionadas con los 17 Objetivos de Desarrollo Sostenible de las Naciones Unidas, conocidos como "ODS".

En concreto, el Fondo ha invertido en inversiones sostenibles, tanto de renta variable como de renta fija, con el objetivo de alcanzar los siguientes objetivos:

- **Impacto en personas.** Inversión en empresas dedicadas a la construcción de vivienda asequible, a la educación y desarrollo de habilidades de la población, empresas que fomenten la inclusión financiera y digital, empresas con vocación de proporcionar mejora en salud pública, empresas que proporcionen seguridad y protección.
- **Impacto en planeta.** Inversión en empresas con la vocación de mejora en eficiencia energética, electrificación y digitalización, producción energía verde, remediación y prevención de la contaminación, empresas productoras de alimentos, agua y gestión de residuos de forma sostenible.
- **Financiación total o parcial de proyectos con objetivos medioambientales y/o sociales.** Inversión en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad de acuerdo con los estándares de ICMA y/o estándares desarrollados por la UE.

Para evaluar la consecución de los objetivos sostenibles identificados anteriormente, la Sociedad Gestora monitoriza ciertos indicadores de integración de factores de sostenibilidad.

Adicionalmente, los criterios específicos que se han valorado para evaluar el cumplimiento de los objetivos sostenibles en este Fondo son los siguientes.



CLASE 8.^a



002676088

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Informe de gestión del ejercicio 2021

Para el caso de inversiones en renta variable:

- **Indicadores de ODS.** Indicadores que permiten evaluar el grado de alineamiento en cada una de las inversiones con los 17 ODS, de acuerdo con métricas facilitadas por proveedores externos. En concreto, se analiza el porcentaje de los ingresos de cada compañía vinculados directamente a las actividades identificadas en los ODS.
- **Indicadores de medición de impacto.** Métricas concretas asociadas a la actividad que se está siguiendo, que se publican y actualizan con carácter anual y se monitorizan tanto por el asesor como por la Sociedad Gestora. En concreto, se analiza el porcentaje de inversión de impacto (sobre el total de la cartera del Fondo) y la exposición a soluciones de impacto sostenible.

Para el caso de inversiones en renta fija:

- **Inversión en bonos sostenibles.** Seguimiento, a través de proveedores externos, para bonos verdes, sociales y sostenibles, del cumplimiento de estándares relevantes definidos por ICMA relacionados con los proyectos que esos bonos financian.

Las inversiones clasificadas como sostenibles se han aplicado de forma mayoritaria en la cartera con una exposición habitual del 75% del patrimonio de la cartera, pudiéndose encontrar, ocasionalmente, con una exposición mínima del 60% del patrimonio.

Este Fondo no tiene un objetivo mínimo de inversión en actividades alineadas con el Reglamento 2020/852 de Taxonomía de la UE, por lo que no se ha aplicado una metodología específica para el cálculo de la alineación con la Taxonomía UE. No obstante, la Sociedad Gestora supervisa que las inversiones que realiza el Fondo no han perjudicado significativamente ninguno de los objetivos ambientales o sociales definidos.



CLASE 8.^a
EURO



002676089

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Informe de gestión del ejercicio 2021

● ¿Qué resultados han ofrecido los indicadores de sostenibilidad?

Los indicadores de integración de factores de sostenibilidad han ofrecido los siguientes resultados durante el periodo de referencia:

Indicadores de integración de factores de sostenibilidad

Indicador	Resultado	Cobertura
Armamento controvertido	0%	97,51%
Carbón térmico	0%	97,51%
Arenas bituminosas	0%	97,51%
Armamento convencional	0%	97,51%
Incumplimientos del Pacto Mundial de Naciones Unidas	0%	97,51%



CLASE 8.^a



002676090

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Informe de gestión del ejercicio 2021

Indicadores específicos para medir la consecución de los objetivos sostenibles

• **Indicadores de ODS**

Objetivos de Desarrollo Sostenible (RF y RV)	Porcentaje de contribución a los ODS
ODS 1: Fin de la pobreza	5,58%
ODS 2: Hambre cero	4,43%
ODS 3: Salud y bienestar	10,65%
ODS 4: Educación de calidad	4,02%
ODS 5: Igualdad de género	1,1%
ODS 6: Agua limpia y saneamiento	5,1%
ODS 7: Energía asequible y no contaminante	14,93%
ODS 8: Trabajo decente y crecimiento económico	9,1%
ODS 9: Agua, industria, innovación e infraestructura	8,47%
ODS 10: Reducción de las desigualdades	4,27%
ODS 11: Ciudades y comunidades sostenibles	12,58%
ODS 12: Producción y consumos responsables	6,68%
ODS 13: Acción por el clima	7,93%
ODS 14: Vida submarina	1,07%
ODS 15: Vida de ecosistemas terrestres	3,27%
ODS 16: Paz, justicia e instituciones sólidas	0,37%
ODS 17: Alianzas para lograr los objetivos	0,44%



002676091

CLASE 8.^a

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Informe de gestión del ejercicio 2021

- Indicadores de medición de impacto

Indicadores de medición de impacto	Indicador
Porcentaje de inversión de impacto (total cartera)	85,76%
Calificación de exposición a soluciones de impacto sostenible (cartera de renta variable)	Muy alta
Porcentaje de bonos sostenibles (cartera de renta fija)	88,156%



¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

El Fondo sigue distintos índices de referencia identificados en el Folleto que han sido designados a efectos informativos o comparativos para la gestión de este Fondo.

Estos índices generales de mercado no son utilizados para medir la consecución de los objetivos de inversión sostenible identificados. La Sociedad Gestora evalúa la consecución de estos objetivos a través de la medición de los indicadores identificados anteriormente.



CLASE 8.^a



002676092

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Informe de gestión del ejercicio 2021

Glosario de términos

Término	Definición
ASG	Factores ambientales, sociales y de gobernanza.
Arenas bituminosas	Exposición del índice o cartera del fondo a compañías en las que la exploración o producción de arenas bituminosas representen más de un 10% de la facturación consolidada de la compañía a nivel matriz.
Armamento convencional	Exposición del índice o la cartera del fondo a compañías en las que más del 35% del total de sus ingresos, procedan de la producción de armamento militar o componentes especialmente diseñados y de equipos esenciales para la producción y uso de armas y munición convencionales, así como software o hardware relacionado con las actividades de defensa.
Armas controvertidas	Exposición del índice o cartera del fondo a compañías involucradas en el desarrollo, producción, mantenimiento o comercio de armas controvertidas. Se consideran armas controvertidas las minas antipersonas, las armas biológicas, químicas y nucleares, las bombas de racimo, así como las armas de uranio empobrecido, armas láser cegadoras, armas incendiarias y / o fragmentos no detectables. En el caso de armas nucleares, quedarían exceptuadas las compañías que estén domiciliadas en países que hayan ratificado el Tratado de No Proliferación de Armas Nucleares de 1968, siempre que estas empresas realicen otras actividades adicionales al armamento nuclear, que los ingresos por la actividad nuclear no superen el 5% y que no estén relacionadas con ningún otro tipo de armamento controvertido.
Calificación ASG media	Indicador que muestra la calificación obtenida tras un análisis profundo de los



002676093

CLASE 8.^a

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Informe de gestión del ejercicio 2021

	tres pilares y sus principales características: medio ambiente (cambio climático, recursos naturales, polución y gestión de residuos), social (capital humano, gestión de impacto social al crear sus productos, atención a implicaciones para cualquier individuo u organización afectada por las actividades de la empresa y a oportunidades de mejora para la sociedad) y gobierno corporativo (gobierno y comportamiento corporativo) variando en función de su actividad, sector o áreas geográficas. El rango del indicador varía entre AAA-CCC.
Carbón Térmico	Exposición del índice o la cartera a compañías cuyos ingresos a nivel consolidado dependan en más del 25% de la extracción o más del 40% de la generación de energía a partir del carbón térmico.
Incumplimientos Pacto Mundial	Exposición del índice o la cartera del fondo a compañías que incurran en prácticas que vulneren los principios del Pacto Mundial de Naciones Unidas en materia de medio ambiente, derechos humanos, derechos laborales y lucha contra la corrupción.
Indicador/es	Dato obtenido de una medición que permite conocer o valorar las características y la intensidad de un hecho.
Índice de referencia	Indicador que se utiliza para medir el desempeño de un grupo de activos de manera estandarizada y que puede utilizarse como referencia comparativa con el objetivo de batirlo o replicarlo.
Reglamento (UE) 2019/2088	Reglamento (UE) 2019/2088 del Parlamento Europeo y del Consejo de 27 de noviembre de 2019 sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros.
Reglamento (UE) 2020/852	Reglamento (UE) 2020/852 del Parlamento Europeo y del Consejo de 18 de junio de



CLASE 8.^a



002676094

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Informe de gestión del ejercicio 2021

	2020 relativo al establecimiento de un marco para facilitar las inversiones sostenibles y por el que se modifica el Reglamento (UE) 2019/2088.
Taxonomía de la Unión Europea	Herramienta con base científica definida por la Unión Europea para la clasificación de actividades económicas según el cumplimiento de determinados criterios ambientales (taxonomía ambiental), sociales (taxonomía social) y de gobernanza (taxonomía de gobernanza). Su objetivo es facilitar información a los inversores para la adopción de decisiones de inversión respecto a una determinada actividad económica mediante nuevas obligaciones de información para las empresas y los participantes en los mercados financieros sobre el desarrollo de sus actividades.

Gastos de I+D y Medioambiente

A lo largo del ejercicio 2021 no ha existido actividad en materia de investigación y desarrollo.

En la contabilidad del Fondo correspondiente a las cuentas anuales del ejercicio 2021 no existe ninguna partida que deba ser incluida en el documento aparte de información medioambiental.

Acciones propias

Al Fondo no le aplica lo referente a las acciones propias.

Acontecimientos posteriores al cierre al 31 de diciembre de 2021

Desde el cierre del ejercicio al 31 de diciembre de 2021 hasta la fecha de este informe de gestión, no se han producido hechos posteriores de especial relevancia que no se señalen en la memoria.



CLASE 8.^a



002676095

Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I.

Formulación de las cuentas anuales e informe de gestión

Reunidos los Administradores de Caixabank Asset Management SGIIC, S.A.U., en fecha 30 de marzo de 2022, y en cumplimiento de la legislación vigente, proceden a formular las cuentas anuales y el informe de gestión del ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021 de Caixabank SI Impacto 0/60 RV, F.I., las cuales vienen constituidas por los documentos anexos que preceden a este escrito:

- Balance al 31 de diciembre de 2021, Cuenta de pérdidas y ganancias y Estado de cambios en el patrimonio neto correspondientes al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021.
- Memoria de las cuentas anuales correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2021.
- Informe de gestión del ejercicio 2021.

FIRMANTES:

D. Pablo Arturo Forero Calderón
Presidente

D. Víctor Manuel Allende Fernández
Consejero

D.ª Teresa María Cubas Méndez
Consejera

D. Eugenio Solla Torné
Consejero

D. Juan Carlos Genestal Martínez
Consejero

D.ª Laura Gomas de Alarcón
Consejera

D.ª Cristina Rembado Thomas
Consejera