

GOLDMAN SACHS FUNDS VI

Société d'Investissement à Capital Variable
Inscrite en el Registro Mercantil de Luxemburgo con el número B 86.762

Informe semestral 2023

Para obtener información adicional, póngase en contacto con:

Goldman Sachs Asset Management B.V.
P.O. Box 90470
2509 LL La Haya
Prinses Beatrixlaan 35
2595 AK La Haya
Países Bajos
Correo electrónico: clientservicingam@gs.com
o www.gsam.com/responsible-investing

ADVERTENCIA

No es posible recibir suscripciones basadas únicamente en los estados financieros. Las suscripciones únicamente son válidas si se realizan con arreglo al folleto actual, acompañado del informe anual y el informe semestral más recientes, en caso de que se hubiesen publicado posteriormente.

El folleto, los estatutos, así como los informes anuales y semestrales se encuentran a disposición de los accionistas en el sitio web de la Sociedad y en el domicilio social de la Sociedad que se indican en este informe. Asimismo, dicha información será enviada de forma gratuita a todo aquel que lo solicite.

La información que recoge este informe únicamente se facilita a modo de referencia. No es indicativa de los resultados futuros.

ÍNDICE

CONSEJEROS Y OTRA INFORMACIÓN	5
ESTADO DEL PATRIMONIO NETO	6
ESTADÍSTICAS.....	7
NOTAS SOBRE LOS ESTADOS FINANCIEROS	8
ESTADO DE LAS INVERSIONES	13
OTRA INFORMACIÓN PARA LOS ACCIONISTAS	20

CONSEJEROS Y OTRA INFORMACIÓN

Goldman Sachs Funds VI
Société d'Investissement à Capital Variable
Organismo de inversión colectiva constituido con arreglo
a las leyes del Gran Ducado de Luxemburgo

Consejo de Administración
Dirk Buggenhout
Grainne Alexander (desde el 15 de diciembre de 2023)
Hilary Lopez
Jan Jaap Hazenberg
Jonathan Beinner (desde el 10 de octubre de 2023)
Sophie Mosnier

Sociedad Gestora
Goldman Sachs Asset Management B.V.
35, Prinses Beatrixlaan, 2595 AK, La Haya,
Países Bajos

Auditor
PricewaterhouseCoopers, Société Coopérative
2, Gerhard Mercator, L-2182 Luxemburgo

Agente administrativo, depositario, registrador,
agente de transferencias y agente de pagos
Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.
80, Route d'Esch, L-1470 Luxemburgo

Distribuidor global
Goldman Sachs Asset Management B.V.
35, Prinses Beatrixlaan, 2595 AK, La Haya,
Países Bajos

Gestora de inversiones
Goldman Sachs Asset Management B.V.
35, Prinses Beatrixlaan, 2595 AK, La Haya,
Países Bajos

Domicilio social
80, Route d'Esch, L-1470 Luxemburgo

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

	Notas	Liquid Euro EUR	Liquid Euribor 3M EUR	Total combinado para el período cerrado a 31 de diciembre de 2023 EUR
Activos				
Inversiones, a valor	(2)	4.644.201.166,41	2.767.907.697,63	7.412.108.864,04
Tesorería		1.186.729,68	1.593.159,81	2.779.889,49
Importes por cobrar por venta de inversiones		1.062.000.000,00	257.000.000,00	1.319.000.000,00
Importes por cobrar por acciones emitidas		–	666.027,71	666.027,71
Intereses devengados por cobrar		17.824.439,79	9.694.200,90	27.518.640,69
Otros activos	(2)	161.514,61	–	161.514,61
Activos totales		5.725.373.850,49	3.036.861.086,05	8.762.234.936,54
Pasivo				
Importes por pagar por compra de inversiones		39.239.873,83	9.903.534,10	49.143.407,93
Importes por pagar por reembolso de acciones		–	1.754.583,76	1.754.583,76
Comisiones de gestión por pagar		192.176,23	113.175,88	305.352,11
Gastos por pagar		109.529,04	121.739,89	231.268,93
Pasivos totales		39.541.579,10	11.893.033,63	51.434.612,73
Patrimonio neto		5.685.832.271,39	3.024.968.052,42	8.710.800.323,81

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

ESTADÍSTICAS

	Divisa	Patrimonio neto a			Valor liquidativo por acción a			Acciones en circulación a		
		31/12/2023	30/6/2023	30/6/2022	31/12/2023	30/6/2023	30/6/2022	31/12/2023	30/6/2023	30/6/2022
Liquid Euro	EUR	5.685.832.271,39	4.875.828.427,47	4.809.589.821,19						
Capitalisation A (EUR)	EUR				1.249,54	1.226,68	1.207,69	22.223	17.518	24.968
Capitalisation B (EUR)	EUR				1.195,50	1.173,33	1.155,17	296.313	310.596	504.563
Capitalisation C (EUR)	EUR				1.257,04	1.233,49	1.214,23	435.765	411.497	306.211
Capitalisation E (EUR)	EUR				1.259,20	1.235,54	1.216,28	1.475.886	1.144.478	1.278.468
Capitalisation Z (EUR)	EUR				1.022,03	1.002,43	986,21	585.511	580.059	454.126
Capitalisation Zz (EUR)	EUR				1.024,97	1.005,11	988,44	2.125.927	1.884.874	1.720.575
Distribution A (Q) (EUR)	EUR				1.003,45	985,09	969,87	7.103	1.755	1.928
Distribution Z (Q) (EUR)	EUR				5.051,79	4.955,01	4.874,67	22.380	18.280	24.490
Liquid Euribor 3M	EUR	3.024.968.052,42	2.593.159.499,15	2.305.909.351,99						
Capitalisation A (EUR)	EUR				1.041,46	1.021,78	1.006,22	15.110	27.559	33.174
Capitalisation B (EUR)	EUR				1.043,64	1.023,67	1.008,07	569.126	519.783	598.067
Capitalisation C (EUR)	EUR				1.017,15	997,51	982,20	726.653	680.214	677.914
Capitalisation Z (EUR)	EUR				1.027,99	1.007,67	991,41	120.156	90.667	55.157
Capitalisation Zz (EUR)	EUR				1.030,93	1.010,35	993,64	1.506.048	1.250.090	955.181

NOTAS SOBRE LOS ESTADOS FINANCIEROS

1 Organización

Goldman Sachs Funds VI (la "Sociedad" o el "Fondo") es una sociedad de inversión de capital variable (SICAV) constituida como sociedad anónima (*société anonyme*) con duración ilimitada el 10 de abril de 2002, y regulada con arreglo a la parte I de la versión vigente de la ley de Luxemburgo del 17 de diciembre de 2010 sobre organismos de inversión colectiva.

El acta de constitución y los estatutos sociales de la Sociedad se han publicado en el Mémorial C, Recueil Spécial des Sociétés et Associations du Grand-Duché de Luxembourg, y se han depositado en el Registro del Tribunal del Distrito de Luxemburgo, en el cual se pueden consultar y solicitar copias de los mismos mediante pago de las tasas de registro.

El Fondo está inscrito en el Registro Mercantil de Luxemburgo con el número B 86.762.

Actualmente, el Fondo ofrece a los inversores las siguientes clases de acciones:

Nombre de la clase de acciones	Descripción
Capitalisation A	Acciones de capitalización dedicadas a inversores institucionales que inviertan un mínimo de 250.000 EUR.
Capitalisation B	Acciones de capitalización dedicadas a inversores institucionales que inviertan un mínimo de 2.500.000 EUR.
Capitalisation C	Acciones de capitalización dedicadas a inversores institucionales que inviertan un mínimo de 25.000.000 EUR.
Capitalisation E	Acciones de capitalización dedicadas a inversores institucionales que inviertan un mínimo de 100.000.000 EUR.
Capitalisation Z	Acciones de capitalización reservadas a inversores institucionales que inviertan un mínimo de 5.000.000 de EUR y que, por decisión de la Sociedad Gestora, hayan firmado un acuerdo de gestión especial ("Acuerdo Especial") con relación a su inversión en el Fondo. En lo que respecta a esta Clase de Acciones, la Sociedad Gestora aplica y cobra la comisión de gestión directamente a los accionistas, tal como se determina en el Acuerdo Especial.
Capitalisation Zz	Acciones de capitalización dedicadas a inversores institucionales, que se diferencian de la clase de acciones Z en que la Sociedad Gestora aplica y cobra directamente al accionista una comisión de servicios por la gestión del fondo que comprende la comisión de gestión, la comisión de servicios y cualesquiera otras comisiones, tal y como se ha estipulado en el acuerdo de servicios de gestión del fondo ("Acuerdo de Servicios de Gestión del Fondo") firmado con la Sociedad Gestora a su discreción.
Distribution A (Q)	Acciones de distribución dedicadas a inversores institucionales que inviertan un mínimo de 250.000 EUR. Reparten un dividendo trimestral.
Distribution Z (Q)	Acciones de distribución reservadas a inversores institucionales que inviertan un mínimo de 5.000.000 EUR y que, por decisión de la Sociedad Gestora, hayan firmado un acuerdo de gestión especial ("Acuerdo Especial") con relación a su inversión en el Fondo. En lo que respecta a esta clase de acciones, la Sociedad Gestora aplica y cobra la comisión de gestión directamente a los accionistas, tal como se determina en la sección sobre el dividendo trimestral del Acuerdo Especial.

Se informa a los inversores de que no todas las clases de acciones se ofrecen en cada subfondo de la Sociedad.

Con respecto al Reglamento sobre fondos del mercado monetario (Reglamento [UE] 2017/1131 de 14 de junio de 2017), que se aplica desde el 21 de enero de 2019, el subfondo Liquid Euribor 3M se clasifica como fondo de valor liquidativo variable estándar y el subfondo Liquid Euro como fondo de valor liquidativo variable a corto plazo.

Políticas y objetivo de inversión

Se informa a los accionistas de que en el folleto, que se encuentra a su disposición en el sitio web y en el domicilio social de la Sociedad indicados en el presente informe, se describen de forma detallada las políticas de inversión de cada subfondo. Asimismo, el folleto se remitirá de forma gratuita a cualquier persona que lo solicite.

El siguiente subfondo mantiene inversiones en otro subfondo del Fondo. A 31 de diciembre de 2023, dichas inversiones son las siguientes:

Subfondo inversor	Subfondo en el que invierte	Inversión a valor de mercado a 31 de diciembre de 2023
Liquid Euribor 3M	Liquid Euro	144.746.264,57 EUR

Los estados financieros consolidados se calcularon sumando los estados financieros de cada subfondo, sin eliminar, si las hubiere, ningún tipo de inversiones cruzadas. A 31 de diciembre de 2023, las inversiones cruzadas dentro del Fondo ascendían a 144.746.264,57 EUR o el 1,66 % del patrimonio neto consolidado.

2 Principales políticas contables

2.1 Criterio de elaboración de estados financieros

Los estados financieros se elaboran con arreglo a la hipótesis de empresa en funcionamiento y se presentan de conformidad con los requisitos legales y reglamentarios de Luxemburgo relativos a la preparación y presentación de los estados financieros.

2.2 Operaciones de inversión e ingresos de inversiones relacionados

Las operaciones de inversión se registran atendiendo a su fecha de valor contable. Las plusvalías y minusvalías materializadas se basan en el método del coste medio.

Los descuentos se acumulan y las primas se amortizan como ajustes al interés sobre bonos y otros títulos de deuda.

2.3 Gastos de funcionamiento

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

2.4 Ingresos por dividendos e ingresos por intereses

Los dividendos se contabilizan en la fecha exdividendo.

Los ingresos por dividendos se contabilizan por sus importes brutos antes de la retención fiscal en origen, si la hubiere.

Los intereses se devengan diariamente.

Entre los ingresos por intereses se incluyen la acumulación de descuentos de mercado y descuentos iniciales de emisiones, así como la amortización de primas contabilizadas como ingresos durante la vida del instrumento subyacente.

2.5 Costes de operación

Los subfondos del Fondo pueden incurrir en costes de operación, que se definen como comisiones de corretaje relacionadas con compras o ventas de valores mobiliarios, instrumentos del mercado monetario e instrumentos financieros derivados (u otros activos aptos negociados por los subfondos) o como comisiones relacionadas con la suscripción o el reembolso de acciones o participaciones en OICVM u OIC, si procede.

En caso de que existan inversiones cruzadas o inversiones en las participaciones o acciones de otros OICVM u OIC gestionados de forma directa o por delegación por la Sociedad Gestora (los "Fondos GSAM"), no se aplicarán costes de operación.

Los costes de operación (si los hubiere) están incluidos en el precio de compraventa de los valores. Estos costes, que no tienen la consideración de gastos de funcionamiento, no están incluidos en el cálculo de los gastos corrientes.

Consulte la nota 8 para obtener más información sobre los subfondos que han incurrido en costes de operación identificables por separado.

Los costes de operación para inversiones de renta fija, contratos de divisas a plazo y otros contratos de derivados no están identificados por separado. Para estas inversiones, los costes de operación se incluyen en el precio de compraventa, y son parte de la rentabilidad bruta de inversión de cada subfondo.

2.6 Inversiones financieras en títulos y valoración

2.6.1 Reconocimiento

Los subfondos contabilizan los activos y pasivos financieros en la fecha en que suscriben las disposiciones contractuales de la inversión. Las compras y ventas de activos y pasivos financieros se contabilizan según las fechas de operación. A partir de la fecha de operación, las plusvalías y las minusvalías derivadas de cambios en el valor de los activos o pasivos financieros se registran en la cuenta de pérdidas y ganancias.

2.6.2 Principios de medición del valor

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

Activos y pasivos cotizados en bolsa

El valor de las inversiones financieras negociadas en bolsa, incluidos los valores mobiliarios admitidos a cotización oficial o cotizados en cualquier otro mercado organizado se valoran conforme a las últimas cotizaciones conocidas. Si estos valores mobiliarios se negocian en varios mercados, la valoración se realiza conforme a la última cotización conocida del mercado principal en el que cotizan los valores mobiliarios.

Títulos de deuda

Los títulos de deuda, incluidos los bonos, se valoran excupón (es decir, excluyendo los intereses por cobrar). La última cotización conocida utilizada para los bonos es el precio de compra.

Instrumentos del mercado monetario

La metodología del Fondo para valorar los instrumentos del mercado monetario cumple los requisitos contemplados en el Reglamento sobre fondos del mercado monetario que entró en vigor el 21 de enero de 2019. El modelo de valoración determina que la valoración de los fondos del mercado monetario (FMM) se realizará diariamente. Los activos del Fondo se valorarán utilizando la valoración a precios de mercado siempre que sea posible y al precio vendedor o comprador, en función de lo que resulte más prudente, a menos que se puedan liquidar al precio intermedio del mercado. El Fondo calculará un valor liquidativo de cada acción o participación que será igual a la diferencia entre la suma de todos los activos de un FMM y la suma de todos sus pasivos, valorados con arreglo a la valoración a precios de mercado o a la valoración según modelo o a ambas, dividida entre el número de participaciones o acciones vivas del FMM. Para el periodo finalizado el 31 de diciembre de 2023, el fondo no utiliza una valoración según modelo.

2.7 Tesorería

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

La tesorería en divisas distintas de la moneda de referencia del subfondo se convierte a la moneda de referencia al tipo de cambio vigente en la fecha de valoración. Las diferencias de cambio de divisas derivadas de la conversión se contabilizan en la cuenta de pérdidas y ganancias y el estado de variaciones patrimoniales como plusvalías o (minusvalías) sobre divisas.

2.8 Conversión de divisas

Los libros y registros de todos los subfondos se llevan en sus respectivas divisas de referencia. Las operaciones realizadas en divisas extranjeras se convierten al correspondiente tipo de cambio en vigor en la fecha de la operación. Los activos y pasivos denominados en divisas extranjeras se convierten en la divisa de referencia al tipo de cambio de esa divisa vigente en la fecha de cierre del periodo.

Las diferencias de cambio de divisas derivadas de la conversión y las plusvalías y minusvalías materializadas en enajenaciones o liquidaciones de activos y pasivos se contabilizan en la cuenta de pérdidas y ganancias. Las plusvalías o minusvalías obtenidas por cambio de divisas relativas a inversiones, instrumentos financieros derivados y todas las demás plusvalías o minusvalías por cambio de divisas relativas a partidas monetarias, incluyendo el efectivo y los activos líquidos equivalentes, se reflejan como plusvalía/(minusvalía) neta materializada o como variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente en la cuenta de pérdidas y ganancias.

2.9 Otros activos

Esta cuenta incluye principalmente la compensación de cargos por descubiertos.

3 Tributación

La Sociedad está sujeta en Luxemburgo a un impuesto de suscripción (*taxe d'abonnement*) de un 0,05 % anual de su patrimonio neto. Dicho impuesto de suscripción es pagadero trimestralmente y se calcula a partir del valor liquidativo al final del trimestre correspondiente.

No se pagará impuesto de suscripción sobre los activos que la Sociedad tenga en otros OIC ya sujetos a este impuesto en Luxemburgo.

4 Comisiones de gestión

Con arreglo a los términos y condiciones del "Acuerdo de gestión colectiva de carteras" entre Goldman Sachs Asset Management B.V. y la SICAV, los subfondos pagan a Goldman Sachs Asset Management B.V. una comisión de gestión anual calculada sobre el patrimonio neto promedio de cada clase de acciones, como se describe en la tabla siguiente. Esta comisión será pagadera mensualmente a plazo vencido.

A 31 de diciembre de 2023, las comisiones de gestión efectivas eran las siguientes:

Subfondos	Comisión de gestión (anual)					
	Clase A (en %)	Clase B (en %)	Clase C (en %)	Clase E (en %)	Clase Z* (en %)	Clase Zz* (en %)
Liquid Euro	0,17	0,12	0,10 ⁽¹⁾	0,08	0,00	0,00
Liquid Euribor 3M	0,17	0,12	0,10 ⁽¹⁾	-	0,00	0,00

* La comisión de gestión no se aplica a esta clase de acciones. En su lugar, se aplica una comisión de gestión específica, que la Sociedad Gestora cobra directamente a los accionistas.

⁽¹⁾La comisión de gestión de esta clase de acciones ha cambiado: hasta el 2 de julio del 2023 fue del 0,095 %, pero desde el 3 de julio del 2023 es del 0,10 %.

En el caso de que los subfondos inviertan en participaciones o acciones de otros OICVM o de otros OIC gestionados directamente o por delegación por la Sociedad Gestora o por cualquier otra empresa con la que la Sociedad Gestora esté vinculada por gestión o control común o por una participación directa o indirecta sustancial, las comisiones de gestión pagadas por los OICVM u OIC se deducirán de las comisiones de gestión pagadas a la Sociedad Gestora.

5 Comisiones de servicios fijas

A nivel de las clases de acciones de cada subfondo se aplica una comisión de servicios fija. La comisión de servicios fija se abona a la Sociedad Gestora y es utilizada por esta en nombre de la Sociedad para sufragar los gastos de administración, las comisiones de depósito, las comisiones del agente de transferencias, la comisión de suscripción belga y otros costes corrientes administrativos y de funcionamiento cargados a la Sociedad.

La comisión de servicios fija es "fija" en el sentido de que la Sociedad Gestora correrá con los gastos que excedan el importe de la comisión de servicios fija de cada clase de acciones de los distintos subfondos.

A la inversa, la Sociedad Gestora podrá retener cualquier importe de la comisión de servicios aplicado a la clase de acciones que exceda los gastos efectivos relacionados en los que haya incurrido la respectiva clase de acciones.

Esta comisión se calcula sobre el patrimonio neto medio de cada clase de acciones y es pagadera a mes vencido.

A 31 de diciembre de 2023 las comisiones de servicios fijas efectivas de las clases de acciones activas ascendían a:

Subfondos	Comisiones de servicios fijas (anuales)					
	Clase A (en %)	Clase B (en %)	Clase C (en %)	Clase E (en %)	Clase Z* (en %)	Clase Zz* (en %)
Liquid Euro	0,05	0,05	0,04	0,04	0,04	0,00
Liquid Euribor 3M	0,05	0,05	0,04	-	0,04	0,00

* A esta clase de acciones se le aplica una comisión de servicios destinada a cubrir los gastos de administración y custodia, así como otros costes corrientes administrativos y de funcionamiento.

6 Comisiones por mejoras tributarias

Con el fin de optimizar el rendimiento de la Sociedad o de ciertos subfondos, la Sociedad Gestora podrá intentar aprovechar, en determinadas circunstancias, oportunidades de devolución de impuestos o bonificación tributaria que no hayan sido solicitadas por el banco depositario y que de otro modo se perderían. La prestación de dichos servicios específicos se deberá considerar un servicio complementario de la Sociedad Gestora a los subfondos en cuestión. Si el resultado es positivo, la Sociedad Gestora puede tener derecho a recibir una comisión como contraprestación por dichos servicios. Dicha comisión es un porcentaje de los importes de impuestos recuperados o ahorrados de otro modo como consecuencia del servicio, y representa un máximo del 15 % de los impuestos recuperados o ahorrados. En caso de que la recuperación no tenga éxito, los servicios prestados no se cobrarán a la Sociedad ni al subfondo en cuestión.

7 Estado de variaciones de la cartera

Los accionistas podrán consultar información relativa a estos cambios en los domicilios sociales de la Sociedad y de los distribuidores que se indican en este informe. Asimismo, dicha información será enviada de forma gratuita a todo aquel que lo solicite.

8 Costes de operación

Para el periodo finalizado el 31 de diciembre de 2023, los subfondos no incurrieron en costes de operación.

9 Acontecimientos posteriores al cierre

No se han producido eventos significativos sobre los que haya que informar.

LIQUID EURO

ESTADO DE LAS INVERSIONES

Posiciones	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del VL
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario						
Instrumentos del mercado monetario - 81,68 %						
Australia						
120.000.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd ^(a)	EUR	ZCP	11/3/2024	119.033.514,00	2,09
50.000.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd ^(a)	EUR	ZCP	3/4/2024	49.474.590,00	0,87
32.000.000	Mizuho Bank LTD ^(a)	EUR	ZCP	16/1/2024	31.932.250,56	0,56
30.000.000	Mizuho Bank LTD ^(a)	EUR	ZCP	1/2/2024	29.883.013,50	0,53
					230.323.368,06	4,05
Bélgica						
14.250.000	Brussels Municipalities Regional Fund ^(a)	EUR	ZCP	26/1/2024	14.205.143,28	0,25
10.000.000	Fluvius System Operator ^(a)	EUR	ZCP	4/1/2024	9.992.005,00	0,18
42.000.000	Fluvius System Operator ^(a)	EUR	ZCP	11/1/2024	41.932.895,76	0,74
103.500.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp. ^(a)	EUR	ZCP	22/1/2024	103.211.867,39	1,81
100.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp. ^(a)	EUR	ZCP	20/3/2024	99.074.360,00	1,74
129.000.000	Vlaamse Gemeenschap ^(a)	EUR	ZCP	19/1/2024	128.691.711,93	2,26
					397.107.983,36	6,98
Finlandia						
80.000.000	Nordea Bank ABP	EUR	4,070 %	8/3/2024	80.003.237,60	1,41
30.000.000	Nordea Bank ABP	EUR	3,980 %	4/4/2024	29.994.633,00	0,53
30.000.000	Nordea Bank ABP ^(a)	EUR	ZCP	25/10/2024	29.109.307,80	0,51
					139.107.178,40	2,45
Francia						
15.000.000	ACM Habitat ^(a)	EUR	ZCP	7/2/2024	14.933.144,70	0,26
15.000.000	Agence Francaise de Developpement ^(b)	EUR	3,980 %	8/2/2024	15.000.113,25	0,26
28.000.000	AXA Banque ^(a)	EUR	ZCP	15/2/2024	28.001.606,36	0,49
38.000.000	AXA Banque ^(a)	EUR	ZCP	8/4/2024	38.005.071,86	0,67
50.000.000	AXA Banque	EUR	4,040 %	3/5/2024	49.996.019,50	0,88
60.000.000	AXA Banque	EUR	4,070 %	5/6/2024	59.996.849,40	1,06
60.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel S.A. ^(a)	EUR	ZCP	6/3/2024	59.548.313,40	1,05
70.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel S.A. ^(b)	EUR	4,250 %	5/4/2024	70.036.201,20	1,23
48.000.000	BNP Paribas SA ^(a)	EUR	ZCP	1/4/2024	47.501.933,28	0,84
48.000.000	BPCE SA ^(a)	EUR	ZCP	22/1/2024	47.869.688,16	0,84
76.000.000	BRED Banque Populaire ^(a)	EUR	ZCP	29/2/2024	75.463.960,60	1,33
50.000.000	BRED Banque Populaire ^(a)	EUR	ZCP	6/3/2024	49.614.204,00	0,87
40.000.000	CDC Habitat ^(a)	EUR	ZCP	9/1/2024	39.947.801,60	0,70
10.000.000	CDC Habitat ^(a)	EUR	ZCP	14/2/2024	9.947.767,60	0,17
28.500.000	CDC Habitat ^(a)	EUR	ZCP	11/3/2024	28.269.786,98	0,50
85.000.000	Credit Agricole SA ^(a)	EUR	ZCP	24/1/2024	85.003.100,80	1,50
70.000.000	Credit Agricole SA ^(a)	EUR	ZCP	11/3/2024	70.009.923,90	1,23
15.000.000	Credit Agricole SA ^(b)	EUR	4,230 %	12/4/2024	15.007.325,25	0,26
10.000.000	Credit Municipal de Paris ^(a)	EUR	ZCP	11/1/2024	9.984.623,70	0,18
20.000.000	Credit Municipal de Paris ^(a)	EUR	ZCP	15/1/2024	19.960.478,20	0,35
15.000.000	Credit Municipal de Paris ^(a)	EUR	ZCP	23/1/2024	14.957.222,40	0,26
18.000.000	Hauts de France ^(a)	EUR	ZCP	25/1/2024	17.945.286,84	0,32
19.500.000	Region Ile de France ^(a)	EUR	ZCP	30/1/2024	19.432.805,73	0,34
16.000.000	Ville de Paris ^(a)	EUR	ZCP	22/1/2024	15.956.562,72	0,28
					902.389.791,43	15,87
Alemania						
70.000.000	Deutsche Bank AG ^(a)	EUR	ZCP	7/2/2024	69.681.082,80	1,23
98.000.000	Deutsche Bank AG ^(a)	EUR	ZCP	14/2/2024	97.477.391,48	1,72
40.000.000	Deutsche Boerse ^(a)	EUR	ZCP	12/1/2024	39.934.773,20	0,70
16.000.000	Deutsche Boerse ^(a)	EUR	ZCP	17/1/2024	15.965.231,20	0,28

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

LIQUID EURO

Posiciones	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del VL
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)						
Instrumentos del mercado monetario - 81,68 % (continuación)						
Alemania (continuación)						
25.000.000	Deutsche Boerse ^(a)	EUR	ZCP	19/1/2024	24.940.254,25	0,44
100.000.000	DZ Bank AG ^(a)	EUR	ZCP	6/5/2024	98.610.874,00	1,73
					346.609.606,93	6,10
Irlanda						
20.000.000	Caterpillar ^(a)	EUR	ZCP	27/3/2024	19.804.431,20	0,35
24.000.000	Wells Fargo Bank International ^(a)	EUR	ZCP	4/1/2024	23.981.720,64	0,42
23.500.000	Wells Fargo Bank International ^(a)	EUR	ZCP	5/1/2024	23.479.546,78	0,41
50.000.000	Wells Fargo Bank International ^(a)	EUR	ZCP	8/1/2024	49.940.183,00	0,88
21.000.000	Wells Fargo Bank International ^(a)	EUR	ZCP	2/2/2024	20.917.876,35	0,37
50.000.000	Wells Fargo Bank International ^(a)	EUR	ZCP	30/5/2024	49.174.363,00	0,86
					187.298.120,97	3,29
Italia						
30.000.000	Snam SpA ^(a)	EUR	ZCP	19/2/2024	29.826.855,90	0,53
Japón						
50.000.000	Mizuho Bank LTD ^(a)	EUR	ZCP	1/2/2024	49.805.022,50	0,88
30.000.000	MUFG Bank Ltd ^(a)	EUR	ZCP	11/3/2024	29.755.668,60	0,52
					79.560.691,10	1,40
Jersey, Islas del Canal						
50.000.000	Royal Bank of Scotland International ^(a)	EUR	ZCP	1/2/2024	49.809.926,50	0,88
35.000.000	Royal Bank of Scotland International ^(a)	EUR	ZCP	26/2/2024	34.771.090,20	0,61
32.000.000	Royal Bank of Scotland International ^(a)	EUR	ZCP	8/3/2024	31.752.068,48	0,56
50.000.000	Royal Bank of Scotland International ^(a)	EUR	ZCP	22/3/2024	49.535.575,50	0,87
					165.868.660,68	2,92
Luxemburgo						
97.000.000	Clearstream ^(a)	EUR	ZCP	13/3/2024	96.207.217,06	1,69
70.000.000	DH Europe Finance ^(a)	EUR	ZCP	8/1/2024	69.916.256,20	1,23
37.500.000	DH Europe Finance ^(a)	EUR	ZCP	8/1/2024	37.455.137,25	0,66
23.500.000	DH Europe Finance ^(a)	EUR	ZCP	5/2/2024	23.400.398,07	0,41
					226.979.008,58	3,99
Países Bajos						
60.000.000	ABN AMRO Bank NV ^(a)	EUR	ZCP	1/2/2024	59.769.886,20	1,05
19.500.000	Iberdrola SA ^(a)	EUR	ZCP	25/1/2024	19.439.220,06	0,34
100.000.000	Kingdom of Netherlands ^(a)	EUR	ZCP	8/2/2024	99.557.467,00	1,75
36.000.000	LSEG Netherlands BV ^(a)	EUR	ZCP	18/1/2024	35.911.440,00	0,63
31.500.000	LSEG Netherlands BV ^(a)	EUR	ZCP	24/1/2024	31.400.460,00	0,55
47.000.000	Toyota Motor Finance Netherlands BV ^(a)	EUR	ZCP	17/1/2024	46.897.866,65	0,83
6.800.000	Toyota Motor Finance Netherlands BV ^(a)	EUR	ZCP	18/1/2024	6.784.486,14	0,12
50.000.000	Toyota Motor Finance Netherlands BV ^(a)	EUR	ZCP	11/3/2024	49.596.117,50	0,87
					349.356.943,55	6,14
Noruega						
44.000.000	DNB Bank ASA ^(a)	EUR	ZCP	11/10/2024	42.760.293,40	0,75
70.000.000	DNB Bank ASA	EUR	4,250 %	6/11/2024	70.076.484,10	1,23
50.000.000	DNB Bank ASA	EUR	4,180 %	11/12/2024	50.001.608,50	0,88
					162.838.386,00	2,86
España						
60.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. ^(a)	EUR	ZCP	15/1/2024	59.882.629,80	1,05
81.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. ^(a)	EUR	ZCP	8/2/2024	80.630.122,41	1,42
27.000.000	Santander Consumer Finance SA ^(a)	EUR	ZCP	30/4/2024	26.637.689,43	0,47
20.000.000	Santander Consumer Finance SA ^(a)	EUR	ZCP	8/5/2024	19.715.010,40	0,35
80.000.000	Santander Consumer Finance SA ^(a)	EUR	ZCP	10/6/2024	78.589.273,60	1,38

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

LIQUID EURO

Posiciones	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del VL
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)						
Instrumentos del mercado monetario - 81,68 % (continuación)						
España (continuación)						
30.000.000	Santander Consumer Finance SA ^(a)	EUR	ZCP	29/10/2024	29.097.353,40	0,51
					346.609.606,93	6,10
Suecia						
60.000.000	Svenska Handelsbanken ^(a)	EUR	ZCP	24/1/2024	59.824.564,20	1,05
110.000.000	Svenska Handelsbanken ^(a)	EUR	ZCP	9/2/2024	109.486.401,20	1,93
					169.310.965,40	2,98
Reino Unido						
56.000.000	Barclays Bank Ireland ^(a)	EUR	ZCP	6/3/2024	55.996.823,68	0,99
90.000.000	Barclays Bank PLC ^(b)	EUR	4,300 %	6/2/2024	90.014.529,60	1,58
10.000.000	Barclays Bank PLC ^(b)	EUR	4,300 %	7/2/2024	10.001.657,80	0,18
25.000.000	Barclays Bank PLC ^(a)	EUR	ZCP	22/3/2024	24.768.994,75	0,44
4.000.000	Land Securities Capital Markets PLC ^(a)	EUR	ZCP	15/1/2024	3.992.175,32	0,07
69.000.000	Lloyds Bank ^(b)	EUR	4,300 %	4/4/2024	69.036.261,57	1,22
63.000.000	Mizuho Bank LTD ^(a)	EUR	ZCP	5/2/2024	62.726.013,00	1,10
60.000.000	MUFG Bank Ltd ^(a)	EUR	ZCP	24/1/2024	59.821.432,80	1,05
100.500.000	MUFG Bank Ltd ^(a)	EUR	ZCP	14/2/2024	99.968.699,72	1,76
75.000.000	National Australia Bank LTD London Branch	EUR	4,055 %	14/5/2024	74.995.710,00	1,32
75.000.000	National Australia Bank LTD London Branch	EUR	4,215 %	14/11/2024	75.026.622,00	1,32
61.000.000	Toronto-Dominion Bank	EUR	4,180 %	11/6/2024	61.022.233,28	1,07
40.000.000	Toronto-Dominion Bank ^(a)	EUR	ZCP	11/10/2024	38.858.432,40	0,68
50.000.000	Toronto-Dominion Bank	EUR	4,215 %	1/8/2024	50.028.643,50	0,88
24.000.000	Toronto-Dominion Bank	EUR	4,250 %	2/8/2024	24.018.639,60	0,42
25.000.000	Toronto-Dominion Bank	EUR	4,200 %	11/12/2024	25.001.902,25	0,44
					825.278.771,27	14,52
Estados Unidos						
20.000.000	Fidelity National Information Services ^(a)	EUR	ZCP	10/1/2024	19.969.964,60	0,35
28.000.000	Fidelity National Information Services ^(a)	EUR	ZCP	10/1/2024	27.957.950,44	0,49
90.000.000	Fidelity National Information Services ^(a)	EUR	ZCP	10/1/2024	89.864.840,70	1,58
					137.792.755,74	2,42
TOTAL DE INSTRUMENTOS DEL MERCADO MONETARIO					4.644.201.166,41	81,68
TOTAL DE OTROS VALORES MOBILIARIOS E INSTRUMENTOS DEL MERCADO MONETARIO					4.644.201.166,41	81,68
					Valor de mercado en EUR	% del VL
INVERSIONES					4.644.201.166,41	81,68
OTROS ACTIVOS Y PASIVOS					1.041.631.104,98	18,32
PATRIMONIO NETO TOTAL					5.685.832.271,39	100,00

^(a) Título de cupón cero.^(b) Los tipos de interés de los cupones variables y flotantes son los que se aplicaran a 31 de diciembre de 2023.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

LIQUID EURIBOR 3M

Posiciones	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del VL
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en otro mercado regulado						
Bonos - 9,59 %						
Canadá						
25.000.000	Bank of Nova Scotia/The ^(a)	EUR	4,416 %	22/9/2025	25.032.457,25	0,83
25.000.000	Bank of Nova Scotia/The ^(a)	EUR	4,470 %	12/12/2025	25.014.850,00	0,82
					50.047.307,25	1,65
Finlandia						
25.000.000	OP Corporate Bank PLC ^(a)	EUR	4,464 %	21/11/2025	25.031.386,25	0,83
Irlanda						
50.000.000	Barclays Bank Ireland PLC ^(a)	EUR	4,516 %	23/9/2024	50.026.293,00	1,65
Italia						
8.000.000	Intesa Sanpaolo SpA ^(a)	EUR	5,529 %	13/3/2024	8.015.593,92	0,27
España						
50.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. ^(a)	EUR	4,680 %	11/7/2024	50.128.270,00	1,66
Reino Unido						
50.000.000	Lloyds Bank Corporate Markets PLC ^(a)	EUR	4,487 %	12/8/2024	50.035.000,00	1,65
27.000.000	Lloyds Bank Corporate Markets PLC ^(a)	EUR	4,669 %	24/1/2025	26.853.663,78	0,89
30.000.000	Nationwide Building Society ^(a)	EUR	4,473 %	10/11/2025	30.014.319,00	0,99
					106.902.982,78	3,53
TOTAL DE BONOS					290.151.833,20	9,59

Posiciones	Descripción del valor	Divisa	Valor de mercado EUR	% del VL
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en otro mercado regulado				
Organismos de inversión colectiva				
Fondos abiertos - 4,79 %				
Luxemburgo				
141.643	Liquid Euro - Z Cap EUR	EUR	144.746.264,57	4,79
TOTAL DE FONDOS ABIERTOS			144.746.264,57	4,79
TOTAL DE VALORES MOBILIARIOS E INSTRUMENTOS DEL MERCADO MONETARIO ADMITIDOS A COTIZACIÓN EN UNA BOLSA DE VALORES OFICIAL O NEGOCIADOS EN OTRO MERCADO REGULADO			434.898.097,77	14,38

Posiciones	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés	Fecha de vencimiento	Valor de mercado en EUR	% del VL
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario						
Instrumentos del mercado monetario - 77,12 %						
Australia						
27.000.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd ^(b)	EUR	ZCP	25/10/2024	26.203.581,27	0,87
28.000.000	Mizuho Bank LTD ^(b)	EUR	ZCP	1/2/2024	27.890.812,60	0,92
					54.094.393,87	1,79
Bélgica						
5.000.000	Fluvius System Operator ^(b)	EUR	ZCP	4/1/2024	4.996.002,50	0,16
11.500.000	Fluvius System Operator ^(b)	EUR	ZCP	11/1/2024	11.481.626,22	0,38

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

LIQUID EURIBOR 3M

Posiciones	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés	Fecha de vencimiento	Valor de mercado en EUR	% del VL
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)						
Instrumentos del mercado monetario - 77,12 % (continuación)						
Bélgica (continuación)						
11.000.000	Fluvius System Operator ^(b)	EUR	ZCP	22/1/2024	10.968.655,50	0,36
17.000.000	Fluvius System Operator ^(b)	EUR	ZCP	12/2/2024	16.910.965,90	0,56
27.000.000	KBC Bank NV ^(b)	EUR	ZCP	22/2/2024	26.840.922,75	0,89
10.000.000	Societe Wallonne du Credit ^(b)	EUR	ZCP	24/1/2024	9.970.686,20	0,33
8.000.000	Societe Wallonne du Credit ^(b)	EUR	ZCP	19/7/2024	7.829.028,08	0,26
105.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp. ^(b)	EUR	ZCP	22/1/2024	104.707.691,55	3,46
82.500.000	Vlaamse Gemeenschap ^(b)	EUR	ZCP	19/1/2024	82.302.839,03	2,72
					276.008.417,73	9,12
Finlandia						
17.000.000	Nordea Bank ABP	EUR	3,980 %	4/4/2024	16.996.958,70	0,56
7.000.000	Nordea Bank ABP	EUR	4,170 %	22/5/2024	7.002.404,99	0,23
57.000.000	Nordea Bank ABP	EUR	4,180 %	21/6/2024	57.021.914,22	1,88
32.000.000	OP Corporate Bank PLC ^(b)	EUR	ZCP	12/1/2024	31.946.755,52	1,06
					112.968.033,43	3,73
Francia						
15.000.000	ACM Habitat ^(b)	EUR	ZCP	7/2/2024	14.933.144,70	0,49
22.000.000	AXA Banque ^(b)	EUR	ZCP	1/3/2024	22.002.221,34	0,73
20.000.000	AXA Banque ^(b)	EUR	ZCP	8/4/2024	20.002.669,40	0,66
45.000.000	AXA Banque	EUR	4,090 %	28/6/2024	44.998.919,55	1,49
40.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel S.A.	EUR	4,230 %	19/11/2024	40.009.938,80	1,32
50.000.000	BNP Paribas SA ^(b)	EUR	ZCP	1/4/2024	49.481.180,50	1,64
52.000.000	BPCE SA ^(b)	EUR	ZCP	22/1/2024	51.858.828,84	1,71
15.000.000	BPCE SA ^(b)	EUR	ZCP	30/8/2024	14.623.845,00	0,48
25.000.000	BRED Banque Populaire ^(b)	EUR	ZCP	11/1/2024	24.960.977,75	0,83
33.000.000	CDC Habitat ^(b)	EUR	ZCP	25/1/2024	32.899.692,54	1,09
10.000.000	CDC Habitat ^(b)	EUR	ZCP	26/2/2024	9.934.597,20	0,33
50.000.000	Credit Agricole SA ^(a)	EUR	4,220 %	1/3/2024	50.013.936,50	1,65
40.000.000	Credit Agricole SA ^(a)	EUR	4,230 %	19/4/2024	40.020.449,60	1,32
35.000.000	FS Societe Generale ^(a)	EUR	4,350 %	28/2/2025	35.009.549,05	1,16
					450.749.950,77	14,90
Alemania						
28.000.000	Commerzbank AG ^(b)	EUR	ZCP	22/5/2024	27.560.596,00	0,91
30.000.000	Deutsche Bank AG ^(b)	EUR	ZCP	26/1/2024	29.903.283,60	0,99
59.000.000	Deutsche Bank AG ^(b)	EUR	ZCP	7/2/2024	58.731.198,36	1,94
35.000.000	Deutsche Boerse ^(b)	EUR	ZCP	12/1/2024	34.942.926,55	1,16
21.000.000	Santander Consumer Finance S.A. ^(b)	EUR	ZCP	19/7/2024	20.551.198,71	0,68
					171.689.203,22	5,68
Irlanda						
10.000.000	Caterpillar ^(b)	EUR	ZCP	27/3/2024	9.902.215,60	0,33
10.000.000	Wells Fargo Bank International ^(b)	EUR	ZCP	4/1/2024	9.992.383,60	0,33
9.000.000	Wells Fargo Bank International ^(b)	EUR	ZCP	2/2/2024	8.964.804,15	0,30
28.000.000	Wells Fargo Bank International ^(b)	EUR	ZCP	5/2/2024	27.881.325,36	0,92
13.500.000	Wells Fargo Bank International ^(b)	EUR	ZCP	4/4/2024	13.355.703,09	0,44
					70.096.431,80	2,32
Italia						
25.000.000	Snam SpA ^(b)	EUR	ZCP	19/2/2024	24.855.713,25	0,82
Jersey, Islas del Canal						
33.000.000	Royal Bank of Scotland International ^(b)	EUR	ZCP	8/1/2024	32.960.520,78	1,09
29.000.000	Royal Bank of Scotland International ^(b)	EUR	ZCP	15/1/2024	28.943.271,07	0,96
13.000.000	Royal Bank of Scotland International ^(b)	EUR	ZCP	1/2/2024	12.950.580,89	0,43
25.000.000	Royal Bank of Scotland International ^(b)	EUR	ZCP	8/5/2024	24.643.763,00	0,81
					99.498.135,74	3,29

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

LIQUID EURIBOR 3M

Posiciones	Descripción del valor	Divisa	Tipo de interés	Fecha de vencimiento	Valor de mercado en EUR	% del VL
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)						
Instrumentos del mercado monetario - 77,12 % (continuación)						
Luxemburgo						
29.000.000	DH Europe Finance ^(b)	EUR	ZCP	23/1/2024	28.918.129,52	0,96
24.000.000	DH Europe Finance ^(b)	EUR	ZCP	5/2/2024	23.898.278,88	0,79
					52.816.408,40	1,75
Países Bajos						
75.000.000	Achmea Bank NV ^(b)	EUR	ZCP	2/1/2024	74.959.188,75	2,48
50.000.000	Cooperatieve Rabobank UA	EUR	4,200 %	12/12/2024	50.003.569,50	1,65
10.000.000	Iberdrola SA ^(b)	EUR	ZCP	25/1/2024	9.968.830,80	0,33
30.000.000	ING Bank NV	EUR	4,225 %	26/11/2024	30.011.553,00	0,99
30.000.000	LSEG Netherlands BV ^(b)	EUR	ZCP	18/1/2024	29.926.200,00	0,99
11.000.000	LSEG Netherlands BV ^(b)	EUR	ZCP	26/1/2024	10.962.710,00	0,36
20.000.000	LSEG Netherlands BV ^(b)	EUR	ZCP	20/3/2024	19.808.600,00	0,65
50.000.000	TenneT Holding BV ^(b)	EUR	ZCP	8/2/2024	49.771.680,50	1,65
3.600.000	Toyota Motor Finance Netherlands BV ^(b)	EUR	ZCP	18/1/2024	3.591.786,78	0,12
					279.004.119,33	9,22
Noruega						
50.000.000	DNB Bank ASA ^(b)	EUR	ZCP	11/10/2024	48.591.242,50	1,61
33.000.000	DNB Bank ASA	EUR	4,180 %	11/12/2024	33.001.061,61	1,09
					81.592.304,11	2,70
España						
24.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA ^(b)	EUR	ZCP	20/9/2024	23.355.719,52	0,77
50.000.000	Banco Santander S.A. ^(b)	EUR	ZCP	10/6/2024	49.118.296,00	1,63
51.000.000	Santander Consumer Finance SA ^(b)	EUR	ZCP	8/5/2024	50.273.276,52	1,66
					122.747.292,04	4,06
Suecia						
40.000.000	Svenska Handelsbanken ^(b)	EUR	ZCP	24/1/2024	39.883.042,80	1,32
50.000.000	Svenska Handelsbanken ^(b)	EUR	ZCP	9/2/2024	49.766.546,00	1,64
					89.649.588,80	2,96
Reino Unido						
31.000.000	Barclays Bank Ireland ^(b)	EUR	ZCP	17/1/2024	30.999.743,63	1,02
33.000.000	Barclays Bank Ireland ^(b)	EUR	ZCP	2/2/2024	32.870.162,82	1,09
25.000.000	Land Securities Group PLC ^(b)	EUR	ZCP	5/1/2024	24.978.241,25	0,83
30.000.000	MUFG Bank Ltd ^(b)	EUR	ZCP	14/2/2024	29.841.402,90	0,99
33.000.000	MUFG Bank Ltd ^(b)	EUR	ZCP	21/2/2024	32.800.139,46	1,08
27.000.000	MUFG Bank Ltd ^(b)	EUR	ZCP	26/2/2024	26.821.636,11	0,89
50.000.000	National Australia Bank LTD London Branch	EUR	4,215 %	14/11/2024	50.017.748,00	1,65
20.000.000	Toronto-Dominion Bank	EUR	4,180 %	11/6/2024	20.007.289,60	0,66
45.000.000	Toronto-Dominion Bank	EUR	4,250 %	2/8/2024	45.034.949,25	1,49
40.000.000	Toronto-Dominion Bank	EUR	4,235 %	4/11/2024	40.022.768,00	1,32
					333.394.081,02	11,02
Estados Unidos						
31.000.000	Fidelity National Information Services ^(b)	EUR	ZCP	8/1/2024	30.960.598,38	1,02
83.000.000	Fidelity National Information Services ^(b)	EUR	ZCP	9/1/2024	82.884.927,97	2,74
					113.845.526,35	3,76
TOTAL DE INSTRUMENTOS DEL MERCADO MONETARIO					2.333.009.599,86	77,12
TOTAL DE OTROS VALORES MOBILIARIOS E INSTRUMENTOS DEL MERCADO MONETARIO					2.333.009.599,86	77,12

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

LIQUID EURIBOR 3M

	Valor de mercado en EUR	% del VL
INVERSIONES	2.767.907.697,63	91,50
OTROS ACTIVOS Y PASIVOS	257.060.354,79	8,50
PATRIMONIO NETO TOTAL	3.024.968.052,42	100,00

^(a) Los tipos de interés de los cupones variables y flotantes son los que se aplicaran a 31 de diciembre de 2023.

^(b) Título de cupón cero.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

OTRA INFORMACIÓN PARA LOS ACCIONISTAS

Código de Conducta de la ALFI

Se confirma por el presente que Goldman Sachs Funds VI respeta y cumple los principios del Código de Conducta de la ALFI relativo a los fondos de inversión luxemburgueses.

Índice de rotación de la cartera

El índice de rotación de la cartera es un indicador de la relevancia de los costes adicionales en que incurre un fondo al comprar y vender activos de conformidad con su política de inversión.

El índice de rotación de la cartera se calcula de acuerdo con el método descrito a continuación:

$$\text{Rotación} = [(\text{Total 1} - \text{Total 2}) / \text{M}] * 100$$

Total 1 = Total de operaciones con valores durante el periodo = X + Y

X = compras

Y = ventas

Total 2 = Total de operaciones de capital durante el periodo = S + R

S = suscripciones

R = reembolsos

M = patrimonio neto medio

El índice de rotación de la cartera se expresa como porcentaje. Debido a la naturaleza de la cartera, no se calculan estadísticas de rotación de la cartera para la SICAV.

Gastos corrientes

Los gastos corrientes se calculan para los últimos doce meses. Los gastos corrientes se anualizan para periodos inferiores a un año.

A 31 de diciembre de 2023, los gastos corrientes son los siguientes:

Subfondos	Clases de acciones	Gastos corrientes (%)
Liquid Euro	Capitalisation A (EUR)	0,22
Liquid Euro	Capitalisation B (EUR)	0,17
Liquid Euro	Capitalisation C (EUR)	0,14
Liquid Euro	Capitalisation E (EUR)	0,12
Liquid Euro	Capitalisation Z (EUR)	0,05
Liquid Euro	Capitalisation Zz (EUR)	0,01
Liquid Euro	Distribution A (Q) (EUR)	0,22
Liquid Euro	Distribution Z (Q) (EUR)	0,05
Liquid Euribor 3M	Capitalisation A (EUR)	0,23
Liquid Euribor 3M	Capitalisation B (EUR)	0,18
Liquid Euribor 3M	Capitalisation C (EUR)	0,15
Liquid Euribor 3M	Capitalisation Z (EUR)	0,05
Liquid Euribor 3M	Capitalisation Zz (EUR)	0,01