

INFORME ANUAL Y ESTADOS FINANCIEROS AUDITADOS
SOCIÉTÉ D'INVESTISSEMENT À CAPITAL VARIABLE
31 DE MARZO DE 2022

THREADNEEDLE (LUX)

Contenidos

Información sobre la Sociedad	4	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	76
Informe de los Consejeros	5	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	77
Rendimiento	8	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	78
Informe de auditoría	9	Estados de la Cartera	
Estados financieros:		Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	80
Estados financieros agregados de Threadneedle (Lux)	12	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	88
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	13	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	94
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	15	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	102
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	17	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	108
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	19	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	117
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	20	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	125
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	22	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	130
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	23	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	136
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	25	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	140
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	26	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	151
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	27	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	155
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	29	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	157
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	30	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	160
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	31	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	176
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	32	Threadneedle (Lux) - Global Focus	178
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	34	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	180
Threadneedle (Lux) - Global Focus	35	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	183
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	37	Threadneedle (Lux) - Global Select	185
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	38	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	187
Threadneedle (Lux) - Global Select	40	Threadneedle (Lux) - American	189
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	41	Threadneedle (Lux) - American Select	190
Threadneedle (Lux) - American	43	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	191
Threadneedle (Lux) - American Select	45	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	193
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	47	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	195
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	48	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	197
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	49	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	199
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	50	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	200
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	51	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	202
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	53	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	204
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	55	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	206
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	57	Threadneedle (Lux) - European Select	208
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	58	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	210
Threadneedle (Lux) - European Select	60	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	212
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	62	Threadneedle (Lux) - Global Technology	214
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	63	Threadneedle (Lux) - UK Equities	216
Threadneedle (Lux) - Global Technology	64	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	217
Threadneedle (Lux) - UK Equities	65	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	218
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	67	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	219
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*	69	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	226
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	70	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	231
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	71	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	232
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	73	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	233
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	75	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	235

* Consulte la nota 1.

Contenidos

(continuación)

Notas a los estados financieros	236
Exposición al riesgo global (sin auditar)	356
Información para los accionistas (sin auditar)	358
Información para inversores en Suiza (sin auditar)	361
Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)	362
Reglamento de operaciones de financiación de valores (sin auditar)	394
Reglamento sobre divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (SFDR) (sin auditar)	396
Directorio	405

No se puede aceptar ninguna suscripción sobre la base de los informes financieros. Las suscripciones solo son válidas si se realizan sobre la base del folleto acompañado del último informe anual y del último informe semestral, si se publican posteriormente.

Este informe es una traducción del original en inglés. En caso de ambigüedad, prevalecerá la versión en inglés en la medida en que así lo permita la ley aplicable.

Información sobre la Sociedad

Sociedad

Threadneedle (Lux)
Registro Mercantil de Luxemburgo
n.º B-50.216

Domicilio social

31 Z.A. Bourmicht
L-8070 Bertrange
Gran Ducado de Luxemburgo

Sociedad Gestora

Threadneedle Management Luxembourg S.A.
44, rue de la Vallée
L-2661 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Consejo de Administración

Jonathan Allen (renunció al Consejo de Administración el 7 de mayo de 2021)
Director de Ventas Institucionales y Desarrollo de Productos de Asia y el Pacífico
Columbia Threadneedle Investments
Singapur

Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini (renunció al Consejo de Administración el 7 de mayo de 2021)
Consejera independiente no ejecutiva
Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Claude Kremer
Consejero independiente no ejecutivo
Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Julie Griffiths
Consejera de Riesgos, EMEA y Directora Global de Riesgo de Inversión
Columbia Threadneedle Investments
Londres
Reino Unido

Annemarie Nicole Arens (nombrada por el Consejo de Administración el 7 de mayo de 2021)
Consejera independiente no ejecutiva
Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Joseph Patrick LaRocque (nombrado por el Consejo de Administración el 7 de mayo de 2021)
Consejero independiente no ejecutivo
Maryland
Estados Unidos de América

Thomas Seale (nombrado por el Consejo de Administración el 7 de mayo de 2021)
Consejero independiente no ejecutivo
Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Informe de los Consejeros

El ejercicio analizado fue un periodo positivo, pero turbulento para la mayoría de los mercados de renta variable desarrollados, mientras que las acciones de mercados emergentes y los mercados de bonos registraron resultados negativos. Las materias primas disfrutaron de sólidas ganancias, con un fuerte aumento de los precios del petróleo y el gas. En términos generales, el principal impulso para estos movimientos fue una potente recuperación de la economía mundial impulsada por las vacunas y respaldada por medidas de estímulo gubernamentales adicionales, especialmente en EE. UU. Sin embargo, los inversores se mostraron cada vez más preocupados, ya que la inflación comenzó a elevarse en gran parte del mundo. Esto afectó a los mercados de bonos, ya que los inversores anticipaban tipos de interés más altos. Dentro de las principales economías desarrolladas, el Banco de Inglaterra (BoE) fue el primero en subir los tipos en diciembre, mientras que la Reserva Federal estadounidense (Fed) anunció su primera subida en marzo. La confianza negativa en los activos de riesgo se vio exacerbada por la mayor incertidumbre geopolítica que se produjo tras la invasión rusa de Ucrania a finales de febrero.

Durante la primavera y principios del verano de 2021, los mercados de renta variable avanzaron. La confianza en los activos de riesgo se vio respaldada por el repunte de la actividad económica mundial impulsado por las vacunas, junto con los sólidos beneficios empresariales y las esperanzas de nuevas medidas de estímulo del gobierno estadounidense. Los mercados de bonos corporativos también se vieron favorecidos por la menor emisión nueva en comparación con 2020. Sin embargo, las preocupaciones se mantuvieron sobre las valoraciones, ya que los rendimientos y los diferenciales sobre los bonos gubernamentales fueron muy bajos en términos históricos. Si bien la recuperación económica mundial derivó en tasas de inflación más altas de lo esperado, los rendimientos de los bonos gubernamentales centrales se redujeron en su mayoría durante este periodo, ya que los principales bancos centrales bajaron inicialmente las presiones de los precios como un fenómeno transitorio que se atenuaría a medida que se relajaban los problemas relacionados con la pandemia.

Al final del verano y durante el otoño, la escasez de personal y de la cadena de suministro se reflejó cada vez más en unos datos de crecimiento que se enfriaban. No obstante, la renta variable siguió avanzando, mientras que los diferenciales de rendimiento de los bonos corporativos de grado de inversión (GI) apenas cambiaron. Sin embargo, los rendimientos de los bonos gubernamentales centrales subieron en medio de la creciente sensación de que los responsables políticos podrían haber subestimado la amenaza inflacionaria.

En el último trimestre de 2021, la Reserva Federal, el Banco de Inglaterra (BoE) y, en menor medida, el Banco Central Europeo (BCE) se volvieron más agresivos, lo que finalmente indicaba que la necesidad de controlar la inflación superaba cualquier riesgo de crecimiento derivado de una política monetaria más restrictiva y de la (entonces) recién descubierta variante ómicron del coronavirus. Tras haber comenzado ya a reducir su plan de compra de activos, la Reserva Federal sorprendió a los inversores en diciembre al proyectar varias subidas de tipos de interés en 2022, tras haber sugerido anteriormente solo una. Mientras tanto, en Reino Unido, el BoE subió los tipos en diciembre por primera vez en tres años. El BCE también avanzó hacia la normalización de la política monetaria, pero se consideró que estaba a la zaga de sus homólogos en EE. UU. y Reino Unido al adoptar un enfoque de reducción más suave que la Fed y al señalar que no habría subidas de tipos antes de 2023.

Los rendimientos de los bonos siguieron aumentando a principios de 2022, a medida que aparecían más pruebas de que ómicron era menos virulenta que sus predecesoras y tras revelar las actas de la reunión de diciembre de la Fed un consenso más agresivo de lo que muchos analistas esperaban. Esto resultó poco útil para la renta variable y los bonos corporativos. Dentro de los mercados de renta variable, las acciones de crecimiento, que se perciben como más vulnerables a las subidas de los tipos de interés, fueron las más afectadas por la oleada de ventas.

A medida que avanzaba el primer trimestre de 2022, la geopolítica se situó en el centro de la escena, ya que Rusia acumuló tropas y equipo en su frontera con Ucrania y luego lanzó una invasión completa del país. La volatilidad repuntó, la renta variable sufrió ventas masivas y los diferenciales de rendimiento de los bonos corporativos se ampliaron significativamente. Los precios de las materias primas se dispararon en previsión de los trastornos de la oferta relacionados con la crisis y las sanciones impuestas por Occidente a Moscú. En medio de la aversión al riesgo, los bonos gubernamentales centrales recuperaron algunas de sus pérdidas anteriores, pero el repunte fue escaso, moderado por el temor a que el conflicto aumentara aún más la inflación.

De hecho, la Reserva Federal se lanzó posteriormente a la aventura de normalizar la política monetaria al elevar los tipos de interés un 0,25% en marzo, el primer aumento del banco desde 2018. Mientras tanto, el Banco de Inglaterra subió los tipos un 0,25% tanto en febrero como en marzo, lo que llevó al tipo del índice de referencia de nuevo a su nivel anterior a la pandemia. Dada la alta inflación récord en la zona euro, la retórica del BCE también se volvió más dura y los responsables políticos descartaron las sugerencias anteriores de que era improbable que se produjera un aumento de tipos en 2022.

El MSCI ACWI registró un rendimiento del 9,2% en divisa local durante el ejercicio. Por región, EE. UU. lideró los resultados durante gran parte de 2021 y el mercado se benefició del optimismo relacionado con el estímulo y de los fuertes beneficios empresariales. Reino Unido también registró un rendimiento superior, ya que los importantes sectores de la energía y la minería del mercado se vieron favorecidos por el repunte de los precios de las materias primas en el último trimestre del periodo. Las acciones europeas (excepto las de Reino Unido) quedaron rezagadas, dada la gran dependencia de la región de las importaciones de energía de Rusia y la consiguiente vulnerabilidad a las sanciones impuestas a Moscú. Los mercados emergentes se situaron a la retaguardia y registraron rendimientos negativos durante el periodo, arrastrados a la baja por el peso pesado del índice en China, donde las acciones se vieron afectadas por una represión reguladora de amplio alcance. Sin embargo, los exportadores de materias primas como Brasil y Sudáfrica disfrutaron de sólidas ganancias.

En general, fue un periodo difícil para los mercados de bonos gubernamentales centrales; los rendimientos del índice de referencia de los bonos del Tesoro estadounidense a 10 años aumentaron un 0,60% durante el año en su conjunto. Esto puede compararse con las subidas del 0,77% y el 0,84%, respectivamente, de los bonos británicos y alemanes equivalentes.

Los bonos corporativos de grado de inversión también registraron rendimientos negativos durante el periodo. Durante gran parte de 2021, los diferenciales de rendimiento de los bonos de grado de inversión se mantuvieron relativamente estables, pero se ampliaron bruscamente en medio de la venta masiva impulsada por ómicron en noviembre. Los diferenciales se ampliaron aún más en 2022, ya que los mercados descontaron un ritmo más rápido de restricción de la política monetaria, mientras que la invasión de Rusia a Ucrania desencadenó preocupaciones por el aumento de los precios de las materias primas y las perspectivas de crecimiento. En general, los diferenciales de grado de inversión mundiales se ampliaron un 0,27% durante el ejercicio analizado. Los

Informe de los Consejeros

(continuación)

diferenciales de los bonos europeos de alto rendimiento aumentaron significativamente, aunque los de los bonos estadounidenses de alto rendimiento solo se ampliaron moderadamente durante el periodo; este último mercado se vio menos afectado por la venta masiva en 2022.

En el Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity Fund, participamos en la oferta pública inicial (OPI) de LG Energy Solution, un líder mundial en baterías de iones de litio, que son fundamentales en la transición a la energía verde. Las acciones tuvieron un rendimiento particularmente bueno y, posteriormente, vendimos las acciones con ganancias. También participamos en la OPI de Digital Core Real Estate Investment Trust, que posee y gestiona centros de datos en todo el mundo y cuenta con una buena cartera de activos. Otras nuevas posiciones fueron Santos, BOC Hong Kong, Meituan y Transurban. La compañía energética australiana Santos se ha beneficiado de la fortaleza del precio del petróleo, el grupo bancario BOC Hong Kong se ha beneficiado de la recuperación de la actividad económica y de los tipos de interés más altos, y la plataforma china de compras por Internet Meituan ofrece exposición al crecimiento del consumo interno. El operador australiano de autopistas de peaje Transurban tiene activos atractivos y el tráfico por carretera se está recuperando tras la COVID. En los últimos meses, redujimos nuestra exposición al sector tecnológico, dada la preocupación por una posible normalización más rápida de la política monetaria en los valores tecnológicos de alta valoración. Vendimos ASM Pacific Technology, MediaTek y el fabricante chino de vehículos eléctricos XPeng.

En el Threadneedle (Lux) - American Select Fund, la actividad fue elevada en el verano de 2021, ya que la cartera se remodeló para reflejar el posicionamiento preferido del nuevo gestor principal del fondo. Entre las nuevas participaciones se incluyen Northern Trust, United Parcel Service (UPS) y Salesforce. El banco privado Northern Trust tiene un crecimiento constante de los ingresos, un buen apalancamiento operativo y está expuesto positivamente a tipos crecientes en el negocio de custodia, especialmente en el segmento a corto plazo de la curva de rendimiento. La empresa de entrega de paquetes UPS se está beneficiando del aumento de los volúmenes a medida que el comercio minorista se mueve en línea y aumenta la complejidad de la cadena de suministro. Dado que el servicio postal de EE. UU. está funcionando casi al límite de su capacidad, el retorno de los volúmenes de negocio a negocio de alto margen y el crecimiento de los clientes en las pequeñas y medianas empresas también son favorables. Salesforce fabrica software de automatización, que es un componente crucial para las plataformas de experiencia digital. Sigue ocupando una posición dominante (el 40% de la cuota de mercado) en la automatización de equipos de ventas, pero, con el tiempo, ha ampliado su paquete de productos para incluir comercio, marketing y asistencia al cliente, que espera ofrecer a su debido tiempo como parte de una plataforma perfecta. Las ventas incluyeron Amazon, Visa, PayPal, Bank of America e Intuit. Northern Trust, UPS y Salesforce también fueron nuevas posiciones en Threadneedle (Lux) - American Fund, donde las ventas incluyeron Amazon, Charles River Laboratories, Morgan Stanley, BlackRock y Comcast.

En Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies Fund, iniciamos posiciones en Axos Financial, Cirrus Logic y Madison Square Garden Entertainment. Axos Financial opera Axos Bank, un banco digital directo y en línea de pequeña capitalización con un enfoque nacional. El banco se está beneficiando de una tasa de crecimiento elevada en su balance contable y cartera de préstamos mediante la exposición a préstamos hipotecarios de consumo, así como de mayores márgenes en comparación con sus homólogos gracias a su combinación de negocios y costes inherentemente más bajos. Cirrus es un desarrollador de soluciones de semiconductores y es un proveedor clave de muchas empresas tecnológicas. La empresa ha hecho grandes progresos en la diversificación de su base de ingresos lejos de su mayor cliente (Apple) ampliando su liderazgo tecnológico en nuevas líneas de productos y aplicaciones más allá de los teléfonos inteligentes, e incrementando su exposición a la tendencia de penetración de contenido creciente. Madison Square Garden Entertainment se compone de una serie de bienes inmuebles y activos de entretenimiento de primera calidad, así como de una sección de televisión dedicada a los deportes y al entretenimiento. El regreso de los eventos en directo y la apertura de un nuevo recinto en Las Vegas (actualmente programada para 2023) son factores positivos para el valor. Las ventas incluyeron KBR, Under Armour, SunPower, Novavax, Renewable Energy Group e Impinj.

En Threadneedle (Lux) - UK Equities Fund, las nuevas participaciones durante el periodo incluyeron Tate & Lyle, Experian y ConvaTec. Tate & Lyle es un negocio de calidad que cotiza a una valoración atractiva, con un ojo puesto en la gestión de costes y en la innovación y un método selectivo para mejorar las capacidades técnicas mediante adquisiciones. Experian es líder del mercado en puntuación de crédito, verificación de identidad y prevención de fraudes. El canal directo al consumidor de la empresa es una gran ventaja en los mercados en desarrollo, donde contribuye a una mayor inclusión financiera. ConvaTec es un negocio global con una fuerte cuota de mercado. Nos anima el nuevo equipo de liderazgo, que se ha centrado en invertir en el negocio y en mejorar el crecimiento de las ventas, lo que debería allanar el camino para una recuperación de los márgenes. Las ventas incluyeron Spectris tras una racha de rendimiento sólido, ya que pensamos que había oportunidades más baratas en otros lugares. También vendimos Inchcape. La recuperación de las acciones desde los mínimos de la pandemia ha sido fuerte, pero nos preocupaba la sostenibilidad de la fijación de precios de los automóviles de segunda mano, los cambios estructurales en el sector minorista de automóviles y el impacto de los vehículos eléctricos en la rentabilidad del negocio de reparaciones.

En el Threadneedle (Lux)-UK Equity Income Fund, nos centramos en añadir algunas participaciones existentes, especialmente Tesco y Direct Line. Tesco está teniendo un buen rendimiento sobre la base de varias métricas. Dada su posición como líder del mercado británico en el comercio minorista de comestibles en línea, la empresa se beneficia de la tendencia estructural hacia las compras en línea. Tesco también está ganando cuota en el mercado físico de tiendas independientes y minoristas de conveniencia. Somos optimistas con respecto al sector minorista de alimentos y nos sentimos alentados por los progresos realizados por el nuevo equipo de gestión. Direct Line cotiza a valoraciones atractivas y ofrece un alto rendimiento por dividendo. La empresa, dotada de una amplia gama de marcas consolidadas, cuenta también con ventajas de escala y diversificación, factores que apuntan a una buena rentabilidad. Además, creemos que su escala también aportará solidez a la marca, diversas relaciones de distribución y una oportunidad de reducir costes, que Direct Line debería seguir explotando. Vendimos de forma rentable WM Morrison cuando las acciones se retiraron de la lista antes de la adquisición de la empresa y reciclamos el producto en algunas participaciones existentes.

En los fondos Threadneedle (Lux) - Global Focus, Threadneedle (Lux) - Global Select, Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha y Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies, seguimos centrándonos en empresas con ventajas competitivas sostenibles, porque creemos que son las que están mejor situadas para continuar ofreciendo una alta rentabilidad y un crecimiento de los beneficios en diversas condiciones de mercado. Entre las nuevas compras de algunos de estos fondos se incluyen Qualcomm, Apple y Kadant. Qualcomm se enorgullece de una gran escala con una posición líder en el mercado en tecnología inalámbrica de próxima generación y es un proveedor clave de semiconductores para los productos del gigante tecnológico Apple. Apple ha

Informe de los Consejeros

(continuación)

continuado innovando durante el último año y ha lanzado una serie de productos de vanguardia, entre los que se incluyen la última serie de iPhone 13, los HomePod mini y el MacBook Pro más potente jamás fabricado, que ha situado a la empresa por delante de sus homólogas. Kadant es un proveedor líder de productos y servicios para mejorar la eficiencia de los procesos, optimizar la utilización de energía y maximizar la productividad en sectores que utilizan muchos recursos. La empresa está bien situada para beneficiarse de un aumento previsto del gasto en infraestructuras en EE. UU. Las ventas incluyeron Activision Blizzard, debido a preocupaciones en materia de gobierno corporativo. También vendimos Tencent en medio de la inquietud por la represión reguladora de China en los sectores de Internet y juegos de azar.

En el fondo Threadneedle (Lux) - Global Equity Income Fund, mantenemos nuestro enfoque en la calidad de los ingresos, es decir, en empresas con flujos de dividendos elevados, en crecimiento y sostenibles. Las nuevas posiciones incluyeron Proctor & Gamble (P&G) y Anthem. La posición de mercado de P&G está respaldada por su sólido valor de marca y su amplia oferta de productos, junto con el innovador enfoque de marketing y planificación de productos, mientras que Anthem, la aseguradora de salud líder de EE. UU., se enorgullece de su gran escala en el sector, lo que ayuda a generar ventajas de costes y a garantizar la fidelidad de los clientes. Vendimos Allstate, ya que sentimos que existían mejores oportunidades en otros lugares. También vendimos CME Group tras el sólido rendimiento de las acciones.

Nuestro principal objetivo en la gestión del Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies Fund es la selección de valores, basada en opiniones macroeconómicas y temáticas. Favorecemos a las empresas que tienen una ventaja competitiva y un poder de fijación de precios generado por marcas potentes, procesos patentados, barreras reglamentarias de acceso al mercado y posiciones de mercado sólidas. Durante el año, las nuevas posiciones incluyeron Auction Technology, Fortnox y Allfunds. Auction Technology se encuentra en posición de ganar con el cambio hacia las subastas en línea. Fortnox es una empresa de software suca de rápido crecimiento, que tiene una fuerte posición en contabilidad y facturación. La plataforma Allfunds tiene una cuota de mercado considerable de distribución de fondos de arquitectura abierta en Europa. Las altas barreras a la entrada, los beneficios a escala y los efectos de la red hacen de este un modelo de negocio sólido y rentable, y la empresa continúa creciendo de forma orgánica y mediante adquisiciones. Las ventas incluyeron Sartorius y Orpea. Las acciones en Sartorius (equipo farmacéutico y de laboratorio) habían tenido un fuerte rendimiento durante la pandemia, mientras que el director general de Orpea se ha marchado y la empresa de centros de atención se enfrenta a una larga investigación sobre cuestiones de gobierno.

Nuestro principal objetivo en la gestión del Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend Fund es la selección de valores, basada en opiniones macroeconómicas y temáticas. Favorecemos a las empresas de alta calidad con capacidad para fijar los precios con el fin de mantener unos resultados sólidos y unos dividendos crecientes. Durante el año, los nuevos puestos incluyeron UPM, Saint-Gobain e ING. La inversión de capital a corto plazo, incluida la inversión en su nuevo proyecto en Uruguay, está ayudando a convertir el negocio forestal UPM en uno de los productores más eficientes del mundo, impulsando el crecimiento y la rentabilidad. Saint-Gobain está bajo nueva dirección y se está beneficiando de las renovaciones de edificios europeos, impulsadas por la regulación ambiental. La institución financiera ING tiene una fuerte cuota de mercado en el Benelux, lo que proporciona beneficios de escala, y está bien situada para sacar partido de cualquier repunte en el crecimiento económico. Entre las ventas se incluyó Philips (tecnología médica) debido a las preocupaciones por la retirada de productos.

Threadneedle (Lux) - European Select Fund es una cartera de alta convicción. Nuestro planteamiento principal se centra en la selección de valores. Buscamos identificar empresas de alta calidad con un poder de fijación de precios para mantener una rentabilidad sólida. Durante el año, las nuevas posiciones incluyeron FincoBank y Hermes International. El banco italiano FincoBank tiene un modelo de negocio sólido como distribuidor de fondos de inversión y otros servicios financieros a través de su plataforma en línea líder. También tiene una ventaja de coste sobre otros proveedores. La firma de productos de lujo Hermes International tiene la solidez de la marca y capacidad para fijar los precios. También añadimos varias posiciones, incluida Nestlé. El grupo suizo de alimentos se encuentra bajo nueva gestión y se centra en mejorar la asignación de capital e impulsar los resultados y los márgenes. El balance contable de la empresa es sólido y podría permitir adquisiciones atractivas. Vendimos Worldline. El sector de los pagos en línea se está volviendo cada vez más competitivo y la empresa hizo un progreso decepcionantemente lento en la desinversión de su negocio de terminales. Otras ventas incluyeron a Philips debido a las preocupaciones por las retiradas de productos.

De cara al futuro, creemos que el repunte actual de la inflación es transitorio; sin embargo, los fuertes aumentos de precios en áreas en las que persisten los cuellos de botella y las perturbaciones de la cadena de suministro requieren una supervisión cuidadosa. La invasión de Ucrania por parte de Rusia añade más incertidumbre, dadas las perturbaciones a que ha dado lugar en los mercados mundiales de energía y cereales, tanto en términos de producción como de transporte.

China representa otra fuente de incertidumbre en dos frentes principales: la actual represión regulatoria del gobierno y la aplicación continuada de su política de COVID cero, que ha exacerbado los problemas de la cadena de suministro. Sin embargo, dentro del universo de los mercados emergentes, estos efectos se han limitado ampliamente a los activos chinos.

Durante 2022 y 2023, nuestro pronóstico básico sigue siendo que el crecimiento y la inflación se ralenticen hacia niveles de tendencia, lo que debería aliviar la presión sobre los responsables políticos para subir los tipos de forma agresiva durante el próximo año. En nuestra opinión, el mercado ha descontado en gran medida las subidas de tipos previstas por los principales bancos centrales y el crecimiento de los beneficios empresariales debería mantenerse sólido. En este contexto, esperamos rentabilidades atractivas de activos de riesgo como la renta variable y el crédito durante los próximos 12 a 18 meses.

El Consejo de Administración

14 de junio de 2022

El rendimiento histórico no es una guía para el rendimiento futuro. El valor de las inversiones y de cualquier ingreso proveniente de ellas puede bajar o subir.

Rendimiento

Rendimientos de las Carteras de Threadneedle (Lux) durante el ejercicio cerrado a 31 de marzo de 2022:

Cartera	1 año de rendimiento*	
	Clase de acciones principal	
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	ZU	-4,77%
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	ZE	-5,95%
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	ZE	-3,17%
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	ZE	-0,65%
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	ZE	-6,27%
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	AE	-3,25%
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	AU	-7,95%
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	ZU	-6,39%
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	AU	-7,91%
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	ZU	-0,48%
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	ZU	-5,41%
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	ZE	2,01%
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	AU	-2,42%
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	ZU	0,92%
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	ZE	-22,22%
Threadneedle (Lux) - Global Focus	ZU	7,32%
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	ZU	-27,84%
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	ZU	5,31%
Threadneedle (Lux) - Global Select	ZU	1,84%
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	ZE	-2,70%
Threadneedle (Lux) - American	ZU	10,71%
Threadneedle (Lux) - American Select	ZU	9,12%
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	ZU	1,70%
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	ZU	-19,51%
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	ZU	-16,55%
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	ZU	11,43%
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	ZU	13,90%
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	AE	6,57%
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	ZE	1,39%
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	ZE	-5,24%
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	ZE	-7,52%
Threadneedle (Lux) - European Select	AE	2,32%
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	ZE	-3,17%
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	ZUP	-6,87%
Threadneedle (Lux) - Global Technology	ZU	11,75%
Threadneedle (Lux) - UK Equities	ZG	0,29%
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	ZG	8,70%
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity**	ZU	1,09%
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	ZU	2,78%
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	ZE	-2,11%
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	ZE	-2,47%
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	ZE	1,26%
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	ZU	13,33%
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	ZU	-0,70%
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	ZU	46,51%

Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

* El rendimiento es de un año o desde la fecha de inicio para las clases de acciones lanzadas durante el ejercicio.

** Consulte la nota 1.



Informe de auditoría

Para los Accionistas de
Threadneedle (Lux)

Nuestra opinión

En nuestra opinión, los estados financieros adjuntos ofrecen una imagen fiel de la situación financiera de Threadneedle (Lux) (el «Fondo») y de cada uno de sus subfondos a 31 de marzo de 2022, así como de los resultados de sus operaciones y de la evolución de su patrimonio neto durante el ejercicio finalizado en dicha fecha, con arreglo a las disposiciones legales y reglamentarias luxemburguesas relativas a la elaboración y presentación de los estados financieros.

Lo que hemos auditado

Los estados financieros del Fondo comprenden:

- el estado consolidado del patrimonio neto del Fondo y el estado del patrimonio neto de cada uno de los subfondos a 31 de marzo de 2022;
- el estado de la cartera a 31 de marzo de 2022;
- el estado consolidado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto del Fondo y el estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto de cada uno de los subfondos durante el ejercicio cerrado; y
- las notas a los estados financieros, que incluyen un resumen de las políticas contables significativas.

Fundamento de la opinión

Hemos realizado nuestra auditoría con arreglo a la Ley de 23 de julio de 2016 sobre la profesión de auditoría (Ley de 23 de julio de 2016) y a las Normas Internacionales de Auditoría (NIA) adoptadas para Luxemburgo por la «Commission de Surveillance du Secteur Financier» (CSSF). Nuestras responsabilidades, en virtud de lo dispuesto en la Ley de 23 de julio de 2016 y en las NIA, en los términos aprobados por la CSSF para Luxemburgo, se detallan en la sección del presente informe titulada «Responsabilidades del “Réviseur d’entreprises agréé” en la auditoría de los estados financieros».

Consideramos que las pruebas de auditoría que hemos obtenido son suficientes y adecuadas para fundamentar nuestra opinión.

Somos independientes del Fondo de acuerdo con el Código Internacional de Ética para Contables Profesionales (lo que incluye las Normas Internacionales de Independencia) del Consejo de Normas Internacionales de Ética (Código IESBA) adoptado para Luxemburgo por la CSSF, junto con los requisitos éticos que son relevantes para nuestra auditoría de los estados financieros. Hemos cumplido con nuestras otras responsabilidades éticas bajo esos requisitos éticos.

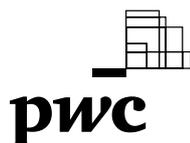
Información adicional

El Consejo de Administración es responsable de la información adicional. La información adicional comprende la información que figura en el informe anual, pero no los estados financieros ni nuestro informe de auditoría al respecto.

Nuestra opinión sobre los estados financieros no abarca la información adicional y no expresamos ningún tipo de conclusión de la fiabilidad al respecto.

*PricewaterhouseCoopers, Société coopérative, 2 rue Gerhard Mercator, B.P. 1443, L-1014 Luxembourg
T: +352 494848 1, F: +352 494848 2900, www.pwc.lu*

*Cabinet de révision agréé. Expert-comptable (autorisation gouvernementale n°10028256)
R.C.S. Luxembourg B 65 477 - TVA LU25482518*



En relación con nuestra auditoría de los estados financieros, nuestra responsabilidad es leer la información adicional identificada anteriormente y, al hacerlo, considerar si contiene incoherencias significativas en comparación con los estados financieros o con el conocimiento que hemos obtenido en la auditoría, o si hay indicios de errores significativos en dicha información. Si, basándonos en el trabajo que hemos realizado, llegamos a la conclusión de que existe un error significativo en la información adicional, estamos obligados a informar de ello. No tenemos nada que informar al respecto.

Responsabilidades del Consejo de Administración en relación con los estados financieros

El Consejo de Administración es responsable de la preparación y presentación fidedigna de los estados financieros con arreglo a los requisitos legales y reglamentarios luxemburgueses relativos a la preparación y presentación de los estados financieros, y del control interno que el Consejo de Administración determine que es necesario para permitir la preparación de estados financieros libres de inexactitudes significativas, ya sea por fraude o error.

Al preparar los estados financieros, el Consejo de Administración es responsable de evaluar la capacidad del Fondo y de cada uno de sus subfondos para continuar como empresa en funcionamiento, revelando, según proceda, las cuestiones relacionadas con la empresa en funcionamiento y utilizando los criterios de contabilidad de la empresa en funcionamiento, a menos que pretenda liquidar el Fondo, cerrar alguno de sus subfondos o cesar las operaciones, o bien no exista otra alternativa posible más que esta.

Responsabilidades del «Réviseur d'entreprises agréé» en la auditoría de los estados financieros

Los objetivos de nuestra auditoría son obtener una garantía razonable de que los estados financieros en su conjunto no contienen inexactitudes significativas, ya sea por fraude o error, y emitir un informe de auditoría que incluya nuestra opinión. Una garantía razonable es un alto nivel de fiabilidad, pero no asegura que una auditoría realizada con arreglo a la Ley de 23 de julio de 2016 y a las NIA adoptadas para Luxemburgo por la CSSF detecte siempre una declaración errónea importante cuando exista. Las incorrecciones pueden surgir por fraude o error y se consideran significativas si, individualmente o en su conjunto, es razonable esperar que influyan en las decisiones económicas de los usuarios tomadas sobre la base de estos estados financieros.

Como parte de una auditoría con arreglo a la Ley de 23 de julio de 2016 y a las NIA adoptadas para Luxemburgo por la CSSF, mantenemos nuestro escepticismo y criterio profesional durante la totalidad del transcurso de esta. De la misma forma:

- identificamos y evaluamos los riesgos de incorrecciones significativas en los estados financieros, ya sea por fraude o error, diseñamos y llevamos a cabo procedimientos de auditoría que respondan a dichos riesgos, y obtenemos evidencias de auditoría que sean suficientes y apropiadas para fundamentar nuestra opinión. El riesgo de no detectar una declaración errónea importante que resulte de un fraude es mayor que el de que suceda lo propio con una que derive de un error, ya que el fraude puede implicar conspiración, falsificación, omisión intencional, tergiversación o la transgresión del control interno;
- obtenemos una comprensión del control interno pertinente para la auditoría con el fin de diseñar procedimientos de auditoría que sean apropiados en las circunstancias, pero no con el fin de expresar una opinión sobre la eficacia del control interno del Fondo;
- evaluamos la idoneidad de las políticas de contabilidad utilizadas y el carácter razonable de las estimaciones contables y la información conexa facilitada por el Consejo de Administración del Fondo;



- concluimos sobre la conveniencia de que el Consejo de Administración del Fondo utilice los criterios de contabilidad de la empresa en funcionamiento y, sobre la base de las pruebas de auditoría obtenidas, si existe una incertidumbre importante en relación con acontecimientos o condiciones que puedan poner en duda de forma significativa la capacidad del Fondo o de cualquiera de sus subfondos para continuar como empresa en funcionamiento. Si constatamos que existe una incertidumbre significativa, estamos obligados a señalarla en nuestro informe de auditoría en lo que respecta a la información relacionada con los estados financieros o, si esta información es inadecuada, debemos modificar nuestra opinión. Nuestras conclusiones se basan en las pruebas de auditoría obtenidas hasta la fecha de nuestro informe de auditoría. Sin embargo, los acontecimientos o condiciones futuros pueden hacer que el Fondo o cualquiera de sus subfondos (excepto Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity Portfolio, en el que existe una decisión de liquidación) dejen de continuar como empresa en funcionamiento;
- evaluamos la presentación general, la estructura y el contenido de los estados financieros, incluida la información por publicar, y si los estados financieros representan las transacciones y eventos subyacentes de manera que se obtenga una presentación fidedigna.

Nos comunicamos con los encargados de la gobernanza en relación, entre otras cosas, con el alcance y el calendario previstos de la auditoría, así como con los hallazgos significativos de la misma, lo que incluye cualquier deficiencia significativa en el control interno que identifiquemos durante nuestra labor.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Representada por

Luxemburgo, 15 de junio de 2022

Serene Shtayyeh

Estados financieros agregados de Threadneedle (Lux)

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2, 18	20.323.849.448
Efectivo en el banco	2	197.378.262
Depósitos a plazo	2, 19	31.244.761
Por cobrar para la venta de inversiones		196.644.402
Suscripciones por cobrar		68.010.529
Interés por cobrar en swaps	2	3.822.020
Interés y dividendos por cobrar, neto		50.307.898
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	25.141.442
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	20.013.855
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	28.242.920
Otros activos		10.530.456
Total de activos		20.955.185.993
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(288.723)
Opciones vendidas al valor de mercado	2, 12	(708.254)
Pagadero por inversiones adquiridas		(231.724.129)
Reembolsos pagaderos		(35.271.120)
Interés pagadero en swaps	2	(3.463.343)
Dividendo pagadero en swaps	2	(967.341)
Interés pagadero bancario	2	(7.337)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(1.689.716)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(27.295.765)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(1.768.765)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(17.194.686)
Impuesto por pagar	3	(1.446.527)
Otros pasivos	20	(8.776.770)
Total de pasivos		(330.602.476)
Total de patrimonio neto		20.624.583.517

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		23.052.196.950
Ingresos		
Dividendos, neto	2	203.578.017
Interés sobre bonos, neto	2	117.592.622
Interés bancario	2	74.493
Ingresos por intereses en swaps		3.455.667
Ingresos por intereses en contratos de futuros		2.604
Otros ingresos		882.954
Total de ingresos		325.586.357
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(231.170.317)
Comisiones de rendimiento	8	(734.615)
Interés bancario	2	(1.226.903)
Impuesto extranjero	3	(192.382)
Dividendos pagados en swaps		(3.676.157)
Gastos por intereses en swaps		(32.882.593)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(801.982)
Gastos operativos	3, 5	(44.604.267)
Comisiones varias	4	(10.533)
Total de gastos		(315.299.749)
Ingresos netos de inversiones		10.286.608
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		1.646.875.337
Ganancia neta realizada en swaps		156.500.300
(Pérdida) neta realizada en opciones		(40.858)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(103.314.752)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		6.636.680
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(7.163.215)
Ganancia neta realizada en reembolso de impuestos		115
Ganancia neta realizada		1.699.493.607
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(1.911.704.600)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		62.008.092
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en opciones		(168.444)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		37.642.762
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		21.310.773
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(1.790.911.417)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(81.131.202)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		7.565.792.461
Reembolsos de acciones		(9.097.597.185)
Dividendos	7	(48.155.644)
Total de movimientos de capital		(1.579.960.368)
Diferencias de cambio	2	(778.815.885)
Cambio en las inversiones cruzadas en las Carteras	18	12.294.022
Patrimonio neto al final del ejercicio		20.624.583.517

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	494.660.789
Efectivo en el banco	2	6.036.806
Por cobrar para la venta de inversiones		1.401.125
Suscripciones por cobrar		726.812
Interés por cobrar en swaps	2	48.455
Interés y dividendos por cobrar, neto		3.990.053
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	7.171.721
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	1.674.191
Otros activos		28.197
Total de activos		515.738.149
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(450.359)
Reembolsos pagaderos		(657.620)
Interés pagadero en swaps	2	(88.690)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(1.487.127)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(125.639)
Otros pasivos		(70.928)
Total de pasivos		(2.880.363)
Total de patrimonio neto		512.857.786

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	1.473.330,453
Clase AEH	957.407,951
Clase AKH	70,000
Clase ANH	788,000
Clase AU	983.950,414
Clase AUP	118.898,937
Clase DEC	77.981,486
Clase DEH	196.932,131
Clase DU	204.766,131
Clase DUP	67.986,651
Clase IEC	629.450,498
Clase IEH	1.166.051,037
Clase IEP	74,000
Clase IGC	1.072,350
Clase IGH	1.618.029,313
Clase IKH	80.378,000
Clase INH	785,000
Clase IU	621.088,590
Clase IUP	578.366,295
Clase NEC	206.526,610
Clase NEH	108.095,495
Clase NGC	11.905.046,184
Clase NGH	1.044.866,570
Clase NU	1.544.980,902
Clase NUP	89.705,000
Clase XEH	84,000
Clase XFH	92,000
Clase XGH	9.608.393,047
Clase XU	100,000
Clase ZEH	4.084.775,735
Clase ZFH	93,000
Clase ZGH	29.365,171
Clase ZU	1.818.830,862

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		505.611.566
Ingresos		
Dividendos, neto	2	5.907
Interés sobre bonos, neto	2	12.496.293
Interés bancario	2	4.288
Ingresos por intereses en swaps		311.569
Ingresos por intereses en contratos de futuros		314
Total de ingresos		12.818.371
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.645.818)
Interés bancario	2	(34.416)
Gastos por intereses en swaps		(1.819.363)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(17.352)
Gastos operativos	3, 5	(899.172)
Total de gastos		(4.416.121)
Ingresos netos de inversiones		8.402.250
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		2.494.382
(Pérdida) neta realizada en swaps		(1.096.485)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(16.676.586)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(964.236)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(1.972.102)
(Pérdida) neta realizada		(18.215.027)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(53.536.994)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		2.513.588
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		8.249.277
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		2.019.254
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(40.754.875)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(50.567.652)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		198.795.074
Reembolsos de acciones		(135.955.316)
Dividendos	7	(5.025.886)
Total de movimientos de capital		57.813.872
Patrimonio neto al final del ejercicio		512.857.786

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	512.857.786	505.611.566	231.720.967

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEC	9,8883 ¹	10,7710 ¹	10,1688 ¹
Clase AEH	11,3032 ¹	12,0116 ¹	11,0413 ¹
Clase AKH	113,5556 ²	120,4075 ²	110,4036 ²
Clase ANH	10,1321 ³	10,6766 ³	9,7591 ³
Clase AU	12,8471	13,5238	12,3096
Clase AUP	11,3413	12,2255	11,4274
Clase DEC	8,9807 ¹	9,8546 ¹	9,3773 ¹
Clase DEH	10,7729 ¹	11,5352 ¹	10,6831 ¹
Clase DU	11,1512	11,8269	10,8459
Clase DUP	10,0429	10,9155	10,2875
Clase IEC	9,7281 ¹	10,5732 ¹	9,9649 ¹
Clase IEH	11,6146 ¹	12,3172 ¹	11,3035 ¹
Clase IEP	11,0997 ¹	11,3003 ¹	11,3172 ¹
Clase IGC	10,0201 ⁴	10,8060 ⁴	10,1319 ⁴
Clase IGH	12,4075 ⁴	13,0594 ⁴	11,9152 ⁴
Clase IKH	116,6619 ²	123,3018 ²	112,7923 ²
Clase INH	10,2127 ³	10,7232 ³	9,7783 ³
Clase IU	13,1938	13,8609	12,5914
Clase IUP	10,5391	11,3406	10,5721
Clase NEC	9,8160 ¹	10,6452 ¹	10,0163 ¹
Clase NEH	10,5687 ¹	11,1857 ¹	10,2441 ¹
Clase NGC	9,8219 ⁴	10,5683 ⁴	9,8807 ⁴
Clase NGH	10,9467 ⁴	11,4987 ⁴	10,4701 ⁴
Clase NU	11,4874	12,0441	10,9192
Clase NUP	10,6244	11,4076	10,6268
Clase XEH	9,3311 ¹	9,8476 ¹	–
Clase XFH	9,2943 ⁵	9,8342 ⁵	–
Clase XGH	10,8105 ⁴	11,3216 ⁴	10,2784 ⁴
Clase XU	9,4664	9,8938	–
Clase ZEH	10,6577 ¹	11,2951 ¹	10,3599 ¹
Clase ZFH	9,2148 ⁵	9,8121 ⁵	–
Clase ZGH	12,3692 ⁴	13,0122 ⁴	11,8664 ⁴
Clase ZU	13,1713	13,8304	12,5574

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.

² La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el USD.

³ La clase está denominada en NOK. La divisa base de la Cartera es el USD.

⁴ La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.

⁵ La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	124.952.906
Efectivo en el banco	2	1.319.464
Por cobrar para la venta de inversiones		1.269.349
Interés por cobrar en swaps	2	13.713
Interés y dividendos por cobrar, neto		744.400
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	774.093
Total de activos		129.073.925
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(863.517)
Reembolsos pagaderos		(24.715)
Interés pagadero en swaps	2	(22.171)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(79.923)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(354.847)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(38.441)
Otros pasivos		(15.107)
Total de pasivos		(1.398.721)
Total de patrimonio neto		127.675.204

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	95.025,182
Clase ANH	825,000
Clase IE	3.487.045,137
Clase IEP	85,000
Clase INH	817,000
Clase XE	84,000
Clase XFH	92,000
Clase XGH	72,000
Clase XUH	100,000
Clase ZE	78,000
Clase ZFH	92,000
Clase 1E	6.168.776,381
Clase 1G	141.654,881
Clase 2E	3.812.179,971
Clase 2G	69,000
Clase 3G	558.328,721
Clase 4E	236.424,367
Clase 4G	3.113.105,156
Clase 8E	892.429,248
Clase 8G	132.809,810
Clase 9G	70,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		157.999.564
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	1.892.090
Interés bancario	2	119
Ingresos por intereses en swaps		86.934
Otros ingresos		561
Total de ingresos		1.979.704
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(493.993)
Interés bancario	2	(24.942)
Gastos por intereses en swaps		(410.242)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(3.527)
Gastos operativos	3, 5	(170.393)
Total de gastos		(1.103.097)
Ingresos netos de inversiones		
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		1.490.457
(Pérdida) neta realizada en swaps		(102.907)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(583.941)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		176.670
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(26.970)
Ganancia neta realizada		953.309
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(10.422.614)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		425.794
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		26.286
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		624.788
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(9.345.746)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(7.515.830)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		15.338.278
Reembolsos de acciones		(38.146.796)
Dividendos	7	(12)
Total de movimientos de capital		(22.808.530)
Patrimonio neto al final del ejercicio		127.675.204

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	127.675.204	157.999.564	127.139.343

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	10,1243	10,7975	9,9041
Clase ANH	9,8409 ¹	10,4217 ¹	9,4949 ¹
Clase IE	10,3374	10,9588	9,9912
Clase IEP ²	9,2711	–	–
Clase INH	9,9943 ¹	10,5063 ¹	9,5194 ¹
Clase XE	9,5748	10,1073	–
Clase XFH	9,5292 ²	10,0938 ²	–
Clase XGH	9,6585 ³	10,1315 ³	–
Clase XUH	9,6777 ⁴	10,1441 ⁴	–
Clase ZE	10,2805	10,9309	9,9786
Clase ZFH	9,4512 ²	10,0801 ²	–
Clase 1E	1,3811	1,4728	1,3507
Clase 1G	1,0743 ³	1,1548 ³	1,1002 ³
Clase 2E	10,3490	10,9688	9,9984
Clase 2G	9,7243 ³	10,3939 ³	9,8457 ³
Clase 3G	1,2099 ³	1,2941 ³	1,2267 ³
Clase 4E	10,4502	11,0208	–
Clase 4G	10,1679 ³	10,8094 ³	10,1845 ³
Clase 8E	1,7338	1,8383	1,6764
Clase 8G	1,4667 ³	1,5677 ³	1,4850 ³
Clase 9G	9,7021 ³	10,3783 ³	9,8373 ³

¹ La clase está denominada en NOK. La divisa base de la Cartera es el EUR.

² La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el EUR.

³ La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el EUR.

⁴ La clase está denominada en USD. La divisa base de la Cartera es el EUR.

⁶ Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	433.156.272
Efectivo en el banco	2	1.043.210
Por cobrar para la venta de inversiones		6.367.092
Suscripciones por cobrar		75.950
Interés y dividendos por cobrar, neto		5.427.507
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	1.221.168
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	93.545
Otros activos		23.350
Total de activos		447.408.094
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(2.553.473)
Reembolsos pagaderos		(6.922.052)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(306.895)
Otros pasivos		(62.382)
Total de pasivos		(9.844.802)
Total de patrimonio neto		437.563.292

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	342,253
Clase AKH	81,000
Clase ANH	807,000
Clase IE	4.894.295,707
Clase IEP	5.524.522,913
Clase IKH	80,000
Clase INH	798,000
Clase XE	77,000
Clase ZE	46.685,677
Clase ZEP	473.149,000
Clase 1E	13.253.531,629
Clase 1EP	1.276.410,305
Clase 1G	281.757,587
Clase 1GP	4.413,675
Clase 1UT	287.966,873
Clase 2E	29.925,000
Clase 2EP	84,000
Clase 2FH	6.834,346
Clase 2G	68,000
Clase 2GP	75,000
Clase 3E	3.178.135,347
Clase 3EP	2.299.433,247
Clase 3FC	13.176,825
Clase 3FH	38.048,936
Clase 3G	864.985,116
Clase 3GP	102.573,702
Clase 4E	122.047,648
Clase 4G	1.383.622,706
Clase 8E	1.592.475,724
Clase 8EP	5.555.524,634
Clase 8FH	32.415,940
Clase 8G	9.694,366
Clase 8GP	5.021,867
Clase 9E	1.183.814,572
Clase 9EP	7.573,873
Clase 9FC	92,741
Clase 9FH	2.306,914
Clase 9G	67,000
Clase 9GP	75,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		601.800.632
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.261
Interés sobre bonos, neto	2	19.982.473
Interés bancario	2	944
Total de ingresos		19.984.678
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(4.289.906)
Interés bancario	2	(27.497)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(6.790)
Gastos operativos	3, 5	(894.776)
Total de gastos		(5.218.969)
Ingresos netos de inversiones		14.765.709
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		5.958.865
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.441.547)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		27.105
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(1.166.373)
Ganancia neta realizada		3.378.050
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(33.069.576)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		1.582.416
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		93.545
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(31.393.615)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(13.249.856)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		112.945.621
Reembolsos de acciones		(258.204.398)
Dividendos	7	(5.728.707)
Total de movimientos de capital		(150.987.484)
Patrimonio neto al final del ejercicio		437.563.292

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	437.563.292	601.800.632	476.354.207

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	10,7825	11,2181	—
Clase AKH	101,0117 ¹	104,9357 ¹	88,6643 ¹
Clase ANH	10,2186 ²	10,5488 ²	8,8954 ²
Clase IE	10,8198	11,1683	9,3892
Clase IEP	9,3088	9,9899	8,7058
Clase IKH	102,8317 ¹	105,8588 ¹	88,9089 ¹
Clase INH	10,4003 ²	10,6479 ²	8,9222 ²
Clase XE	10,5517	10,8140	9,0281
Clase ZE	10,7962	11,1495	9,3780
Clase ZEP	9,2891	9,9735	8,7007
Clase 1E	10,6162	11,0164	9,3105
Clase 1EP	9,1329	9,8573	8,6466
Clase 1G	9,9707 ³	10,4297 ³	9,1568 ³
Clase 1GP	8,6028 ³	9,3569 ³	8,5225 ³
Clase 1UT	9,8080 ⁴	10,4752 ⁴	9,1107 ⁴
Clase 2E	10,8306	11,1761	9,3929
Clase 2EP	9,3488	10,0267	8,7357
Clase 2FH	10,6851 ⁵	11,0615 ⁵	9,3252 ⁵
Clase 2G	10,1723 ³	10,5872 ³	9,2443 ³
Clase 2GP	8,7869 ³	9,4995 ³	8,5956 ³
Clase 3E	10,8528	11,1933	9,4027
Clase 3EP	9,4075	10,0878	8,7895
Clase 3FC	9,2459 ⁵	9,9302 ⁵	8,6906 ⁵
Clase 3FH	10,7045 ⁵	11,0760 ⁵	9,3331 ⁵
Clase 3G	10,1921 ³	10,5964 ³	9,2468 ³
Clase 3GP	8,7267 ³	9,4331 ³	8,5390 ³
Clase 4E	11,1273	11,3964	9,5067
Clase 4G	10,6900 ³	11,0365 ³	9,5632 ³
Clase 4GP	—	—	8,7170 ³
Clase 8E	10,8147	11,1642	9,3866
Clase 8EP	9,3469	10,0322	8,7498
Clase 8FH	10,6685 ⁵	11,0486 ⁵	9,3179 ⁵
Clase 8G	10,1593 ³	10,5718 ³	9,2336 ³
Clase 8GP	8,7611 ³	9,4964 ³	8,6037 ³
Clase 9E	10,8653	11,2018	9,4061
Clase 9EP	9,4214	10,0992	8,7964
Clase 9FC	9,3284 ⁵	10,0032 ⁵	8,7510 ⁵
Clase 9FH	10,7239 ⁵	11,0918 ⁵	9,3420 ⁵
Clase 9G	10,2232 ³	10,6161 ³	9,2545 ³
Clase 9GP	8,8161 ³	9,5122 ³	8,6021 ³

¹ La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el EUR.

² La clase está denominada en NOK. La divisa base de la Cartera es el EUR.

³ La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el EUR.

⁴ La clase está denominada en USD. La divisa base de la Cartera es el EUR.

⁵ La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el EUR.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	104.929.913
Efectivo en el banco	2	2.186.678
Suscripciones por cobrar		274.785
Interés por cobrar en swaps	2	1.884
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.190.917
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	467.526
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	10.110
Total de activos		109.061.813
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(766.656)
Reembolsos pagaderos		(1.048)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(3.799)
Otros pasivos		(9.200)
Total de pasivos		(780.703)
Total de patrimonio neto		108.281.110

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	2.810,385
Clase AEP	167,669
Clase AKH	82,000
Clase ANH	82,000
Clase IE	30.849,438
Clase IEP	84.150,000
Clase IGC	8,000
Clase IGH	7,000
Clase IKH	82,000
Clase INH	816,000
Clase XE	33.727,830
Clase XGC	71.543,876
Clase XGH	677.289,644
Clase ZE	8,200

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	102,3925	103,3869	89,6665
Clase AEP	92,7591	97,3234	87,4074
Clase AKH	102,9071 ¹	103,6634 ¹	89,7046 ¹
Clase ANH	104,6701 ²	104,8255 ²	90,4760 ²
Clase IE	103,5067	104,0942	89,9208
Clase IEP	93,8051	97,9620	87,6410
Clase IGC	95,6430 ³	99,1215 ³	88,1422 ³
Clase IGH	105,1039 ³	105,0674 ³	90,3604 ³
Clase IKH	103,4243 ¹	103,8150 ¹	89,4959 ¹
Clase INH	10,4750 ²	10,4542 ²	8,9899 ²
Clase XE	104,6355	104,8093	90,1780
Clase XGC	96,4461 ³	99,6631 ³	88,3048 ³
Clase XGH	106,2932 ³	105,8053 ³	90,6104 ³
Clase ZE	103,3293	104,0037	89,8970

¹ La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el EUR.² La clase está denominada en NOK. La divisa base de la Cartera es el EUR.³ La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el EUR.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		87.774.729
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	3.738.375
Interés bancario	2	374
Ingresos por intereses en swaps		62.523
Total de ingresos		3.801.272
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(24.915)
Interés bancario	2	(14.961)
Gastos operativos	3, 5	(103.620)
Total de gastos		(143.496)
Ingresos netos de inversiones		
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(369.714)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		1.999.866
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(429.636)
Ganancia neta realizada		1.200.516
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(3.327.457)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(53.691)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(396.279)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(3.777.427)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		1.080.865
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		27.219.031
Reembolsos de acciones		(7.179.466)
Dividendos	7	(614.049)
Total de movimientos de capital		19.425.516
Patrimonio neto al final del ejercicio		108.281.110

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	108.281.110	87.774.729	46.407.346

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	392.379.537
Efectivo en el banco	2	3.117.721
Por cobrar para la venta de inversiones		4.330.317
Suscripciones por cobrar		694.407
Interés y dividendos por cobrar, neto		2.038.016
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	544.590
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	629.872
Otros activos		186
Total de activos		403.734.646
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(5.542.827)
Reembolsos pagaderos		(1.033.477)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(102.628)
Otros pasivos		(39.404)
Total de pasivos		(6.718.336)
Total de patrimonio neto		397.016.310

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.691.848,606
Clase AEP	44.986,000
Clase AFH	93,000
Clase AKH	86,000
Clase ANH	861,000
Clase ASC	100,000
Clase ASH	100,000
Clase AUC	100,000
Clase AUH	100,000
Clase ID	22.738.015,068
Clase IE	5.082.316,581
Clase IEP	2.852.290,955
Clase IFH	2.425.182,000
Clase IGH	351,000
Clase IKH	85,000
Clase INH	839,000
Clase ISC	100,000
Clase ISH	100,000
Clase IUC	93.502,243
Clase IUH	100,000
Clase LE	3.762.364,166
Clase NEP	98.063,469
Clase ZD	11.963.717,696
Clase ZE	4.283.570,639
Clase ZEP	608.627,379
Clase ZFH	35.589,000
Clase ZGC	3.705.143,891
Clase ZGH	898.542,981
Clase ZUH	1.505,141

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		329.896.379
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	4.128.364
Interés bancario	2	556
Ingresos por intereses en contratos de futuros		24
Otros ingresos		15
Total de ingresos		4.128.959
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.175.937)
Interés bancario	2	(27.994)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(4.481)
Gastos operativos	3, 5	(440.325)
Total de gastos		(1.648.737)
Ingresos netos de inversiones		2.480.222
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(2.858.070)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(705.599)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		1.271.757
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		266.594
(Pérdida) neta realizada		(2.025.318)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(25.650.147)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		703.190
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		409.686
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(24.537.271)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(24.082.367)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		174.637.963
Reembolsos de acciones		(81.652.736)
Dividendos	7	(1.782.929)
Total de movimientos de capital		91.202.298
Patrimonio neto al final del ejercicio		397.016.310

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	397.016.310	329.896.379	154.103.742

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	9,3388	9,9729	—
Clase AEP	9,1831	9,9137	—
Clase AFH	9,3172 ¹	9,9710 ¹	—
Clase AKH	93,6342 ²	99,5278 ²	—
Clase ANH	9,4392 ³	9,9762 ³	—
Clase ASC	9,3030 ⁴	9,9703 ⁴	—
Clase ASH	9,4156 ⁴	9,9784 ⁴	—
Clase AUC	9,3072 ⁵	9,9704 ⁵	—
Clase AUH	9,4257 ⁵	9,9792 ⁵	—
Clase ID	9,4617 ⁶	10,0874 ⁶	9,5778 ⁶
Clase IE	10,0871	10,7559	10,1785
Clase IEP	9,4700	10,2088	9,7761
Clase IFH	9,8039 ¹	10,4909 ¹	9,9642 ¹
Clase IGH	9,4189 ⁷	9,9775 ⁷	—
Clase IKH	94,8504 ²	100,7592 ²	95,0380 ²
Clase INH	9,6877 ³	10,2330 ³	9,6122 ³
Clase ISC	9,3048 ⁴	9,9703 ⁴	—
Clase ISH	9,4173 ⁴	9,9784 ⁴	—
Clase IUC	9,3112 ⁵	9,9711 ⁵	—
Clase IUH	9,4334 ⁵	9,9799 ⁵	—
Clase LE	10,1185	10,7895	10,2060
Clase NEP	954,3554	1028,6742	984,7206
Clase ZD	9,4477 ⁶	10,0776 ⁶	9,5733 ⁶
Clase ZE	10,0568	10,7290	10,1580
Clase ZEP	9,4219	10,1616	9,7334
Clase ZFH	9,7912 ¹	10,4827 ¹	9,9581 ¹
Clase ZGC	9,7886 ⁷	10,4934 ⁷	—
Clase ZGH	10,0164 ⁷	10,6218 ⁷	—
Clase ZUH	9,6718 ⁵	10,2472 ⁵	—

¹ La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el EUR.

² La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el EUR.

³ La clase está denominada en NOK. La divisa base de la Cartera es el EUR.

⁴ La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el EUR.

⁵ La clase está denominada en USD. La divisa base de la Cartera es el EUR.

⁶ La clase está denominada en DKK. La divisa base de la Cartera es el EUR.

⁷ La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el EUR.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	177.858.523
Efectivo en el banco	2	6.563.505
Por cobrar para la venta de inversiones		646.663
Suscripciones por cobrar		99.234
Interés por cobrar en swaps	2	65.800
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.968.262
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	3.525.916
Total de activos		190.727.903
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(1.050.607)
Reembolsos pagaderos		(136.846)
Interés pagadero en swaps	2	(115.367)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(806.574)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(1.924.769)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(144.719)
Otros pasivos		(35.582)
Total de pasivos		(4.214.464)
Total de patrimonio neto		186.513.439

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	2.623.051,127
Clase AEP	679.856,829
Clase AKH	81,000
Clase ANH	802,000
Clase AUH	86,000
Clase DE	1.105.282,993
Clase DEP	1.596.548,422
Clase DUH	87,000
Clase IE	1.618.286,833
Clase INH	792,000
Clase ZE	85,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	30,0762	31,0867	27,7686
Clase AEP	14,5050	15,3978	14,1492
Clase AKH	102,4839 ¹	105,8567 ¹	94,4608 ¹
Clase ANH	10,4094 ²	10,6864 ²	9,5087 ²
Clase AUH	11,3753 ³	11,6784 ³	10,3501 ³
Clase DE	28,0352	29,1371	26,1701
Clase DEP	10,8231	11,5522	10,6750
Clase DUH	11,1164 ³	11,4774 ³	10,2405 ³
Clase IE	30,5812	31,4196	27,8985
Clase INH	10,6102 ²	10,8071 ²	9,5432 ²
Clase W	—	—	58,8490
Clase ZE ^f	9,6862	—	—

¹ La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el EUR.² La clase está denominada en NOK. La divisa base de la Cartera es el EUR.³ La clase está denominada en USD. La divisa base de la Cartera es el EUR.^f Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		234.144.701
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	5.951.518
Interés bancario	2	1.313
Ingresos por intereses en swaps		334.428
Otros ingresos		7
Total de ingresos		6.287.266
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.967.646)
Interés bancario	2	(64.171)
Gastos por intereses en swaps		(2.303.022)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(26.042)
Gastos operativos	3, 5	(485.730)
Total de gastos		(4.846.611)
Ingresos netos de inversiones		1.440.655
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		1.257.861
Ganancia neta realizada en swaps		366.781
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(3.097.840)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		1.043.209
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(220.861)
(Pérdida) neta realizada		(650.850)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(13.006.234)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		1.672.668
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		829.090
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		2.921.471
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(7.583.005)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(6.793.200)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		64.763.421
Reembolsos de acciones		(104.797.313)
Dividendos	7	(804.170)
Total de movimientos de capital		(40.838.062)
Patrimonio neto al final del ejercicio		186.513.439

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	186.513.439	234.144.701	165.029.205

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	39.699.398
Efectivo en el banco	2	809.788
Suscripciones por cobrar		41.771
Interés y dividendos por cobrar, neto		457.083
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	305.532
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	192.573
Otros activos		22
Total de activos		41.506.167
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(400.000)
Reembolsos pagaderos		(62.244)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(37.886)
Otros pasivos		(9.014)
Total de pasivos		(509.144)
Total de patrimonio neto		40.997.023

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	390.778,324
Clase AEH	255.056,770
Clase AKH	80,000
Clase ANH	792,000
Clase ASH	7.301,436
Clase AU	140.646,184
Clase AUP	725.872,284
Clase DEC	43.808,952
Clase DEH	127.590,832
Clase DU	216.237,424
Clase IEC	194.086,000
Clase IEH	405.978,626
Clase IU	2.093,260
Clase W	6.537,236
Clase WEH	7.298,489
Clase XUP	85,000
Clase ZU	100,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		47.451.659
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.262
Interés sobre bonos, neto	2	2.003.954
Interés bancario	2	426
Total de ingresos		2.005.642
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(542.973)
Interés bancario	2	(47)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(108)
Gastos operativos	3, 5	(129.048)
Total de gastos		(672.176)
Ingresos netos de inversiones		1.333.466
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(332.551)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(3.126.932)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		237.453
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(59.240)
(Pérdida) neta realizada		(3.281.270)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(4.840.486)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		776.382
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		192.573
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(3.871.531)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(5.819.335)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		13.444.852
Reembolsos de acciones		(13.402.373)
Dividendos	7	(677.780)
Total de movimientos de capital		(635.301)
Patrimonio neto al final del ejercicio		40.997.023

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

USD	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
	40.997.023	47.451.659	33.146.518

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEC	11,3376 ¹	12,9505 ¹	11,4485 ¹
Clase AEH	20,5319 ¹	22,5246 ¹	19,0129 ¹
Clase AKH	96,8799 ²	105,9916 ²	89,1452 ²
Clase ANH	9,8352 ³	10,6943 ³	8,9692 ³
Clase ASH	13,7388 ⁴	14,9331 ⁴	12,5045 ⁴
Clase AU	21,9017	23,7934	19,8691
Clase AUP	7,3555	8,3207	7,2747
Clase DEC	8,2123 ¹	9,3896 ¹	8,3093 ¹
Clase DEH	15,7465 ¹	17,2924 ¹	14,6111 ¹
Clase DU	17,0502	18,5415	15,4989
Clase IEC	8,6232 ¹	9,7778 ¹	–
Clase IEH	29,1681 ¹	31,7423 ¹	26,5802 ¹
Clase IU	11,2198	12,0940	10,0191
Clase W	30,0194	32,4983	27,0437
Clase WEH	20,1302 ¹	22,0058 ¹	18,5115 ¹
Clase XUP	10,5075	11,7343	10,0921
Clase ZU ^f	9,1419	–	–

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.

² La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el USD.

³ La clase está denominada en NOK. La divisa base de la Cartera es el USD.

⁴ La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.

^f Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	33.637.866
Efectivo en el banco	2	1.140.981
Suscripciones por cobrar		12.146
Interés y dividendos por cobrar, neto		453.334
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	27.205
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	40.788
Total de activos		35.312.320
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(87.667)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(39.839)
Otros pasivos		(8.908)
Total de pasivos		(136.414)
Total de patrimonio neto		35.175.906

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	48.882,369
Clase AEH	13.030,738
Clase AKH	82,000
Clase ANH	818,000
Clase ASH	2.362,302
Clase AU	53.075,471
Clase AUP	2.772.282,752
Clase DEH	10.133,563
Clase DU	20.420,379
Clase IEH	17.880,178
Clase IU	89,000
Clase SU	403,299
Clase SUP	48.638,874
Clase W	4.779,568
Clase XUP	89,000
Clase ZU	76,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEC	8,0881 ¹	9,2177 ¹	8,1700 ¹
Clase AEH	24,6916 ¹	26,8384 ¹	22,6402 ¹
Clase AKH	92,6360 ²	100,7566 ²	84,8443 ²
Clase ANH	9,3882 ³	10,1328 ³	8,5211 ³
Clase ASH	11,7200 ⁴	12,6134 ⁴	10,5597 ⁴
Clase AU	73,6637	79,1694	66,0483
Clase AUP	10,0463	11,3182	9,9193
Clase DEH	18,3325 ¹	19,9465 ¹	16,8452 ¹
Clase DU	52,3331	56,3008	47,0167
Clase IEH	27,2289 ¹	29,3633 ¹	24,5729 ¹
Clase IU	10,1566	10,8581	9,0048
Clase SU	29,5378	31,7934	26,5644
Clase SUP	9,6466	10,8819	9,5489
Clase W	61,5266	65,8940	54,7816
Clase XUP	9,8204	10,9029	9,3824
Clase ZU	11,8658	12,6758	10,4968

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.² La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el USD.³ La clase está denominada en NOK. La divisa base de la Cartera es el USD.⁴ La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		45.515.822
Ingresos		
Dividendos, neto	2	567
Interés sobre bonos, neto	2	1.992.042
Interés bancario	2	271
Total de ingresos		1.992.880
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(570.873)
Interés bancario	2	(378)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(83)
Gastos operativos	3, 5	(127.138)
Total de gastos		(698.472)
Ingresos netos de inversiones		
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(750.206)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(159.313)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		128.713
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(18.310)
(Pérdida) neta realizada		(799.116)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(3.275.742)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		55.889
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		40.788
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(3.179.065)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(2.683.773)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		602.753
Reembolsos de acciones		(6.638.780)
Dividendos	7	(1.620.116)
Total de movimientos de capital		(7.656.143)
Patrimonio neto al final del ejercicio		35.175.906

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	35.175.906	45.515.822	45.432.000

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	87.794.622
Efectivo en el banco	2	2.481.592
Suscripciones por cobrar		673
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.148.159
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	334.184
Total de activos		91.759.230
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(520.748)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(61.763)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(49.615)
Otros pasivos		(18.680)
Total de pasivos		(650.806)
Total de patrimonio neto		91.108.424

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	2.487.668,829
Clase AEH	195.357,691
Clase AKH	85,000
Clase ANH	835,000
Clase ASC	45.700,410
Clase ASH	17.295,465
Clase AU	651.708,503
Clase AUP	1.449.094,720
Clase DEH	97.589,350
Clase DU	140.352,178
Clase IE	93.034,332
Clase IEH	732.359,331
Clase XU	3.401.210,546
Clase XUP	364.027,797
Clase ZEH	15.664,000
Clase ZU	100,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEC	4,6270 ¹	5,3304 ¹	4,8028 ¹
Clase AEH	13,9674 ¹	15,3274 ¹	13,1271 ¹
Clase AKH	91,6130 ²	100,3800 ²	85,8647 ²
Clase ANH	9,3476 ³	10,1668 ³	8,6667 ³
Clase ASC	6,3399 ⁴	7,2335 ⁴	6,4712 ⁴
Clase ASH	10,5249 ⁴	11,4387 ⁴	9,7217 ⁴
Clase AU	17,1041	18,5735	15,7370
Clase AUP	4,9572	5,6508	5,0421
Clase DEH	10,8662 ¹	11,9416 ¹	10,2427 ¹
Clase DU	13,2928	14,4565	12,2671
Clase IE	9,6301 ¹	9,8260 ¹	8,8511 ¹
Clase IEH	16,0698 ¹	17,5011 ¹	14,8774 ¹
Clase XU	10,6176	11,3638	9,4901
Clase XUP	8,6646	9,7360	8,5602
Clase ZEH	10,3126 ¹	11,2373 ¹	9,5569 ¹
Clase ZU ^f	9,1782	—	—

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.² La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el USD.³ La clase está denominada en NOK. La divisa base de la Cartera es el USD.⁴ La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.^f Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		115.675.743
Ingresos		
Dividendos, neto	2	2.271
Interés sobre bonos, neto	2	5.121.686
Interés bancario	2	585
Total de ingresos		5.124.542
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(692.904)
Interés bancario	2	(34)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(89)
Gastos operativos	3, 5	(235.871)
Total de gastos		(928.898)
Ingresos netos de inversiones		4.195.644
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(1.997.351)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(2.941.209)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(208.141)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(46.834)
(Pérdida) neta realizada		(5.193.535)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(8.933.278)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		931.585
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(111.537)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(8.113.230)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(9.111.121)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		9.195.323
Reembolsos de acciones		(23.121.456)
Dividendos	7	(1.530.065)
Total de movimientos de capital		(15.456.198)
Patrimonio neto al final del ejercicio		91.108.424

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	91.108.424	115.675.743	107.744.487

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	166.681.017
Efectivo en el banco	2	6.240.438
Por cobrar para la venta de inversiones		515.163
Suscripciones por cobrar		23.250
Interés y dividendos por cobrar, neto		2.398.641
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	793.399
Total de activos		176.651.908
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(426.000)
Reembolsos pagaderos		(8.851)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(88.181)
Otros pasivos		(17.223)
Total de pasivos		(540.255)
Total de patrimonio neto		176.111.653

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	20.459,049
Clase AEH	18.287,196
Clase AKH	80,000
Clase ANH	802,000
Clase ASH	31.102,952
Clase AU	102.327,834
Clase AUP	247.838,457
Clase DEC	24.964,374
Clase DEH	27.947,713
Clase DU	47.050,546
Clase IEC	92,000
Clase IEH	2.005.113,485
Clase IKH	79,000
Clase INH	789,000
Clase ISC	153.073,357
Clase IU	7.468.794,297
Clase TEH	4.096,803
Clase XUP	90,000
Clase ZFH	82,000
Clase ZGH	58,000
Clase ZU	312.274,525

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		210.577.608
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	10.093.257
Interés bancario	2	1.649
Total de ingresos		10.094.906
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.174.450)
Interés bancario	2	(4)
Gastos operativos	3, 5	(230.877)
Total de gastos		(1.405.331)
Ingresos netos de inversiones		8.689.575
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		4.553.698
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(6.902.598)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(14.653)
(Pérdida) neta realizada		(2.363.553)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(12.661.189)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		1.906.803
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(10.754.386)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(4.428.364)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		27.649.945
Reembolsos de acciones		(57.454.183)
Dividendos	7	(233.353)
Total de movimientos de capital		(30.037.591)
Patrimonio neto al final del ejercicio		176.111.653

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	176.111.653	210.577.608	109.192.138

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEC	11,6239 ¹	12,5108 ¹	11,1930 ¹
Clase AEH	32,0422 ¹	32,7344 ¹	27,7754 ¹
Clase AKH	102,5833 ²	104,5429 ²	88,5458 ²
Clase ANH	10,3445 ³	10,4867 ³	8,8652 ³
Clase ASH	15,1131 ⁴	15,3006 ⁴	12,8841 ⁴
Clase AU	37,8984	38,3288	32,1520
Clase AUP	12,5588	13,3803	11,8329
Clase DEC	8,7567 ¹	9,4471 ¹	8,4645 ¹
Clase DEH	23,0395 ¹	23,5798 ¹	20,0462 ¹
Clase DU	27,1995	27,5635	23,1677
Clase IEC	8,5796 ¹	9,1542 ¹	8,1216 ¹
Clase IEH	32,1076 ¹	32,5065 ¹	27,3364 ¹
Clase IKH	104,9731 ²	105,9750 ²	88,9411 ²
Clase INH	10,5900 ³	10,6374 ³	8,9074 ³
Clase ISC ^f	9,3701 ⁴	—	—
Clase IU	11,8564	11,8836	9,8795
Clase TEH	11,4601 ¹	11,6033 ¹	9,7602 ¹
Clase XUP	10,4751	10,9963	9,6033
Clase ZFH	10,8909 ⁵	11,0919 ⁵	9,3762 ⁵
Clase ZGH	12,0954 ⁶	12,2029 ⁶	10,2390 ⁶
Clase ZU	13,8130	13,8794	11,5675

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.

² La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el USD.

³ La clase está denominada en NOK. La divisa base de la Cartera es el USD.

⁴ La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.

⁵ La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.

⁶ La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.

^f Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	54.819.159
Efectivo en el banco	2	1.823.080
Suscripciones por cobrar		14.150
Interés y dividendos por cobrar, neto		582.507
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	175.291
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	66.057
Otros activos		49
Total de activos		57.480.293
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(2.858)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(14.430)
Otros pasivos		(8.251)
Total de pasivos		(25.539)
Total de patrimonio neto		57.454.754

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	93.781,956
Clase AKH	82,000
Clase AS	759,583
Clase ASC	4.183,132
Clase ASH	71.456,051
Clase AU	131.726,682
Clase AUP	712.242,927
Clase AVC	100,000
Clase AVH	100,000
Clase DEH	66.267,132
Clase IEH	1.163.835,552
Clase IGH	54,000
Clase ISH	97,000
Clase IU	49.397,659
Clase XU	2.336.349,409
Clase ZU	42.070,000
Clase ZUP	92,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	11,1546 ¹	11,9604 ¹	10,5231 ¹
Clase AKH	96,2683 ²	102,8729 ²	90,2578 ²
Clase AS	11,0373 ³	11,6426 ³	10,7399 ³
Clase ASC	9,8517 ³	10,8641 ³	9,8642 ³
Clase ASH	12,3554 ³	13,1327 ³	11,4606 ³
Clase AU	12,6431	13,4327	11,6914
Clase AUP	10,2865	11,3378	10,2697
Clase AVC	9,3713 ⁴	10,3878 ⁴	9,4610 ⁴
Clase AVH	10,8855 ⁴	11,6150 ⁴	10,1653 ⁴
Clase DEH	10,8323 ¹	11,6515 ¹	10,2773 ¹
Clase IEH	11,6988 ¹	12,4708 ¹	10,9001 ¹
Clase IGH	12,4646 ⁵	13,1827 ⁵	11,4570 ⁵
Clase ISH	13,0166 ³	13,7420 ³	11,9152 ³
Clase IU	13,2854	14,0310	12,1334
Clase XU	12,6016	13,2554	11,3998
Clase ZU	13,2836	14,0429	12,1566
Clase ZUP	9,9161	10,8803	9,8031

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.² La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el USD.³ La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.⁴ La clase está denominada en AUD. La divisa base de la Cartera es el USD.⁵ La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		68.819.183
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	2.480.455
Interés bancario	2	458
Total de ingresos		2.480.913
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(212.434)
Interés bancario	2	(120)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(81)
Gastos operativos	3, 5	(113.467)
Total de gastos		(326.102)
Ingresos netos de inversiones		2.154.811
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(398.559)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.656.781)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		125.311
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		8.003
(Pérdida) neta realizada		(1.922.026)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(4.956.051)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		421.012
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(15.318)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(4.550.357)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(4.317.572)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		9.756.540
Reembolsos de acciones		(16.420.096)
Dividendos	7	(383.301)
Total de movimientos de capital		(7.046.857)
Patrimonio neto al final del ejercicio		57.454.754

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	57.454.754	68.819.183	47.684.339

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	30.898.858
Efectivo en el banco	2	1.372.742
Depósitos a plazo	2, 19	641.677
Por cobrar para la venta de inversiones		807.631
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.117
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	352.619
Otros activos		946
Total de activos		34.075.590
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(347.245)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(6.128)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(15.745)
Otros pasivos		(5.703)
Total de pasivos		(374.821)
Total de patrimonio neto		33.700.769

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	20.014,357
Clase AEP	73,265
Clase DE	31.334,261
Clase IE	696.619,922
Clase IEP	71,925
Clase LE	2.086.916,591
Clase LEP	71,870
Clase ZE	71,748
Clase ZEP	72,538

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	11,5219	11,3495	9,1419
Clase AEP	11,4169	11,2520	9,0786
Clase DE	11,1869	11,1024	9,0100
Clase IE	11,8436	11,5850	9,2667
Clase IEP	11,7510	11,4878	9,2021
Clase LE	11,9147	11,6371	9,2945
Clase LEP	11,8287	11,5394	9,2290
Clase ZE	11,7517	11,5196	9,2308
Clase ZEP	11,6583	11,4285	9,1673

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		31.879.013
Ingresos		
Interés bancario	2	319
Ingresos por intereses en contratos de futuros		241
Total de ingresos		560
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(186.282)
Interés bancario	2	(18.466)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(3.697)
Gastos operativos	3, 5	(67.388)
Comisiones varias	4	(8.909)
Total de gastos		(284.742)
(Pérdida) neta de inversiones		
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		508.184
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(136.707)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(76.019)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(33.158)
Ganancia neta realizada		262.300
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		339.782
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		126.911
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		298.503
Cambio neto en ganancia no realizada		765.196
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		743.314
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		2.456.665
Reembolsos de acciones		(1.378.222)
Dividendos	7	(1)
Total de movimientos de capital		1.078.442
Patrimonio neto al final del ejercicio		33.700.769

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	33.700.769	31.879.013	26.502.999

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	40.813.583
Efectivo en el banco	2	4.293.576
Por cobrar para la venta de inversiones		325.811
Suscripciones por cobrar		29.229
Interés por cobrar en swaps	2	14.280
Interés y dividendos por cobrar, neto		58.212
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	279.763
Otros activos		9.787
Total de activos		45.824.241
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(771)
Reembolsos pagaderos		(97.093)
Interés pagadero en swaps	2	(8.500)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(20.139)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(812.342)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(51.421)
Otros pasivos		(10.719)
Total de pasivos		(1.000.985)
Total de patrimonio neto		44.823.256

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	61.552,006
Clase AEH	307.002,175
Clase AKH	74,000
Clase AU	331.881,458
Clase AUP	322.825,336
Clase DEH	105.202,605
Clase DU	197.868,446
Clase IEH	73,000
Clase IGH	12.133,135
Clase IU	217.119,983
Clase W	5.683,832
Clase ZU	100,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEC	13,3778 ¹	14,0361 ¹	11,8961 ¹
Clase AEH	27,7017 ¹	28,7145 ¹	23,9870 ¹
Clase AKH	108,2209 ²	112,0590 ²	93,4570 ²
Clase AU	42,0736	43,1173	35,5588
Clase AUP	15,6687	16,2512	13,5959
Clase DEH	19,8712 ¹	20,7320 ¹	17,4306 ¹
Clase DU	27,3970	28,2598	23,4573
Clase IEH	10,9147 ¹	11,2478 ¹	9,3386 ¹
Clase IGH	28,7174 ³	29,3439 ³	24,2056 ³
Clase IU	31,4158	31,9704	26,1826
Clase W	69,2136	71,0014	58,6132
Clase ZU ⁴	9,4818	-	-

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.² La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el USD.³ La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.⁴ Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		58.030.727
Ingresos		
Dividendos, neto	2	309.559
Interés sobre bonos, neto	2	7.171
Interés bancario	2	585
Ingresos por intereses en swaps		249.449
Ingresos por intereses en contratos de futuros		201
Total de ingresos		566.965
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(706.282)
Interés bancario	2	(10.114)
Gastos por intereses en swaps		(6.154)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(10.720)
Gastos operativos	3, 5	(147.980)
Total de gastos		(881.250)
(Pérdida) neta de inversiones		(314.285)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		7.880.727
Ganancia neta realizada en swaps		106.901
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.844.617)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(1.666.012)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(85.769)
(Pérdida) neta realizada en reembolso de impuestos		(43)
Ganancia neta realizada		4.391.187
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(5.262.521)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(313.272)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		450.609
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(905.184)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(6.030.368)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(1.953.466)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		5.003.687
Reembolsos de acciones		(16.175.803)
Dividendos	7	(81.889)
Total de movimientos de capital		(11.254.005)
Patrimonio neto al final del ejercicio		44.823.256

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	44.823.256	58.030.727	49.565.024

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	131.380.163
Efectivo en el banco	2	10.206.995
Por cobrar para la venta de inversiones		235.483
Suscripciones por cobrar		132.922
Interés por cobrar en swaps	2	1.868
Interés y dividendos por cobrar, neto		856.697
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	846.360
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	676.561
Otros activos		39.334
Total de activos		144.376.383
Pasivos		
Opciones vendidas al valor de mercado	2, 12	(708.254)
Pagadero por inversiones adquiridas		(633.451)
Reembolsos pagaderos		(188.389)
Interés pagadero en swaps	2	(2.556)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(26.417)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(180.772)
Otros pasivos		(35.987)
Total de pasivos		(1.775.826)
Total de patrimonio neto		142.600.557

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	63.760,621
Clase AEC	4.563.335,475
Clase AEH	714.136,941
Clase AEP	1.840.513,862
Clase AS	100,000
Clase ASC	19.002,043
Clase ASH	639,122
Clase ASP	5.528,839
Clase AU	458.533,368
Clase AUM	40.835,902
Clase AUP	1.059.816,412
Clase DEC	2.650.332,445
Clase DEH	250.240,508
Clase DEP	287.247,132
Clase DU	372.918,153
Clase DUP	2.034.247,326
Clase ZE	73,000
Clase ZEC	93,000
Clase ZEH	18.582,159
Clase ZFH	85,000
Clase ZU	3.067,015
Clase ZUP	100,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		175.207.757
Ingresos		
Dividendos, neto	2	2.172.659
Interés sobre bonos, neto	2	2.207.116
Interés bancario	2	1.933
Ingresos por intereses en swaps		23.496
Ingresos por intereses en contratos de futuros		1.794
Total de ingresos		4.406.998
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(2.463.678)
Interés bancario	2	(6.281)
Gastos por intereses en swaps		(66.230)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(23.079)
Gastos operativos	3, 5	(490.029)
Comisiones varias	4	(73)
Total de gastos		(3.049.370)
Ingresos netos de inversiones		1.357.628
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		7.482.265
(Pérdida) neta realizada en swaps		(56.528)
(Pérdida) neta realizada en opciones		(40.858)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(3.447.863)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(1.300.034)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(685.792)
(Pérdida) neta realizada en reembolso de impuestos		(4)
Ganancia neta realizada		1.951.186
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(10.232.015)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		94.700
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en opciones		(168.444)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		1.600.278
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		646.452
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(8.059.029)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(4.750.215)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		14.671.315
Reembolsos de acciones		(36.601.494)
Dividendos	7	(5.926.806)
Total de movimientos de capital		(27.856.985)
Patrimonio neto al final del ejercicio		142.600.557

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	142.600.557	175.207.757	191.964.823

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	11,8451 ¹	11,1664 ¹	9,2855 ¹
Clase AEC	7,7505 ¹	8,1761 ¹	6,7662 ¹
Clase AEH	17,9084 ¹	18,0258 ¹	14,1869 ¹
Clase AEP	9,4049 ¹	9,2989 ¹	8,1331 ¹
Clase AQ	—	—	81,0335 ²
Clase AQM	—	—	80,0166 ²
Clase AS	11,1952 ³	11,0946 ³	9,1444 ³
Clase ASC	9,1249 ³	9,5406 ³	7,8280 ³
Clase ASH	11,0880 ³	11,0586 ³	8,6294 ³
Clase ASP	9,1289 ³	9,4660 ³	8,1919 ³
Clase AU	20,5295	20,4434	15,8709
Clase AUM	9,7159	10,1632	8,2835
Clase AUP	9,1953	9,6048	7,8434
Clase DEC	7,3229 ¹	7,7834 ¹	6,4921 ¹
Clase DEH	10,1960 ¹	10,3401 ¹	8,1990 ¹
Clase DEP	8,8122 ¹	8,7797 ¹	7,7380 ¹
Clase DU	12,6175	12,6591	9,9014
Clase DUP	8,3429	8,7793	7,2225
Clase ZE	12,1429 ¹	11,3949 ¹	9,4286 ¹
Clase ZEC	8,5885 ¹	9,0180 ¹	7,4323 ¹
Clase ZEH	10,8301 ¹	10,8464 ¹	8,4917 ¹
Clase ZFH	10,6752 ⁴	10,7251 ⁴	8,4161 ⁴
Clase ZU	12,0281	11,9183	9,2068
Clase ZUP	9,2576	9,6307	7,8321

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.

² La clase está denominada en HKD. La divisa base de la Cartera es el USD.

³ La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.

⁴ La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	6.087.459
Efectivo en el banco	2	113.214
Interés y dividendos por cobrar, neto		18.828
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	1.056
Total de activos		6.220.557
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(68.995)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(3.530)
Otros pasivos	20	(53.606)
Total de pasivos		(126.131)
Total de patrimonio neto		6.094.426

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	100,000
Clase AEC	100,000
Clase AEH	9.264,036
Clase AU	600,000
Clase AUP	100,000
Clase IE	100,000
Clase IEH	100,000
Clase IG	100,000
Clase IU	100,000
Clase LE	97.000,000
Clase LG	100,000
Clase XU	100,000
Clase ZE	100,000
Clase ZEC	100,000
Clase ZEH	100,000
Clase ZU	498.187,100
Clase ZUP	100,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	10,1300 ¹	13,1238 ¹
Clase AEC	9,3082 ¹	13,0744 ¹
Clase AEH	9,4264 ¹	13,1208 ¹
Clase AU	9,6534	13,2113
Clase AUP	9,5286	13,1684
Clase IE	10,2725 ¹	13,1851 ¹
Clase IEH	9,5604 ¹	13,1794 ¹
Clase IG	9,4923 ²	12,2808 ²
Clase IU	9,7979	13,2780
Clase LE	10,3264 ¹	13,2092 ¹
Clase LG	9,5344 ²	12,2989 ²
Clase XU	9,8914	13,3214
Clase ZE	10,2464 ¹	13,1739 ¹
Clase ZEC	9,4153 ¹	13,1241 ¹
Clase ZEH	9,5353 ¹	13,1675 ¹
Clase ZU	9,7613	13,2623
Clase ZUP	9,6378	13,2192

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.² La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		9.412.889
Ingresos		
Dividendos, neto	2	66.527
Interés bancario	2	80
Total de ingresos		66.607
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(57.320)
Interés bancario	2	(9)
Gastos operativos	3, 5	(22.726)
Total de gastos		(80.055)
(Pérdida) neta de inversiones		(13.448)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(574.777)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(11.857)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(6.538)
(Pérdida) neta realizada		(593.172)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(1.707.710)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		3.001
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(1.704.709)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(2.311.329)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		1.668.929
Reembolsos de acciones		(2.676.017)
Dividendos	7	(46)
Total de movimientos de capital		(1.007.134)
Patrimonio neto al final del ejercicio		6.094.426

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

USD	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
	6.094.426	9.412.889

Threadneedle (Lux) - Global Focus

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	2.404.351.805
Efectivo en el banco	2	6.925.592
Por cobrar para la venta de inversiones		26.866.167
Suscripciones por cobrar		8.754.926
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.193.486
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	1.874.184
Otros activos		505.383
Total de activos		2.450.471.543
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(41.067.316)
Reembolsos pagaderos		(1.707.613)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(2.109.417)
Otros pasivos		(492.782)
Total de pasivos		(45.377.128)
Total de patrimonio neto		2.405.094.415

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	1.477.671,395
Clase AEP	3.074.878,953
Clase AU	7.523.220,429
Clase AUP	39.384,886
Clase DEH	547.936,599
Clase DU	1.395.157,223
Clase IE	5.899.820,781
Clase IEH	2.842.654,312
Clase IU	38.509.594,525
Clase IUP	50.445,119
Clase W	18.021,468
Clase XU	3.640.839,172
Clase ZE	3.698.636,331
Clase ZEH	93.641,491
Clase ZEP	3.306.243,038
Clase ZFH	101.715,000
Clase ZG	635.440,696
Clase ZU	2.369.130,029

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		1.676.310.766
Ingresos		
Dividendos, neto	2	12.116.419
Interés bancario	2	1.666
Total de ingresos		12.118.085
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(23.896.758)
Interés bancario	2	(3.558)
Gastos operativos	3, 5	(5.645.550)
Total de gastos		(29.545.866)
(Pérdida) neta de inversiones		(17.427.781)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		158.788.558
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(17.035.649)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(1.000.087)
Ganancia neta realizada		140.752.822
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(105.523.703)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		4.068.728
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(101.454.975)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		21.870.066
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		1.658.149.514
Reembolsos de acciones		(950.258.673)
Dividendos	7	(977.258)
Total de movimientos de capital		706.913.583
Patrimonio neto al final del ejercicio		2.405.094.415

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	2.405.094.415	1.676.310.766	781.859.426

Threadneedle (Lux) - Global Focus

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	60,3566 ¹	57,4173 ¹	39,4473 ¹
Clase AEP	21,3430 ¹	19,1012 ¹	13,9549 ¹
Clase AU	102,8279	96,5311	65,4043
Clase AUP	16,3197	15,4283	10,5256
Clase DEH	43,2512 ¹	41,4515 ¹	28,6905 ¹
Clase DU	53,0512	50,1776	34,2524
Clase IE	20,7896 ¹	18,3198 ¹	13,1834 ¹
Clase IEH	16,3912 ¹	15,4630 ¹	10,5330 ¹
Clase IU	21,1779	19,7127	13,2437
Clase IUP	16,8469	15,7922	10,6770
Clase W	157,1578	147,4604	99,8614
Clase XU	24,7993	22,8996	15,2627
Clase ZE	23,4189 ¹	20,6574 ¹	14,8804 ¹
Clase ZEH	11,7932 ¹	11,1310 ¹	–
Clase ZEP	22,1355 ¹	19,6580 ¹	14,2420 ¹
Clase ZFH	11,7503 ²	11,1109 ²	–
Clase ZG	23,1166 ³	20,5546 ³	15,3810 ³
Clase ZU	25,6233	23,8745	16,0557

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.

² La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.

³ La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	132.697.467
Efectivo en el banco	2	3.310.181
Por cobrar para la venta de inversiones		63.698
Suscripciones por cobrar		101.705
Interés y dividendos por cobrar, neto		351.271
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	22.574
Otros activos		11.923
Total de activos		136.558.819
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(608.201)
Reembolsos pagaderos		(2.560)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(103.419)
Impuesto por pagar	3	(587.926)
Otros pasivos	20	(1.149.832)
Total de pasivos		(2.451.938)
Total de patrimonio neto		134.106.881

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	12.312,883
Clase AU	27.468,354
Clase DEH	45.247,603
Clase DU	65.171,226
Clase IE	24.771,363
Clase IEH	37.444,190
Clase IU	6.770.592,201
Clase XU	100,000
Clase ZU	138.296,669
Clase 1E	3.414.046,177
Clase 1U	2.241.486,693
Clase 2E	2.016.097,894
Clase 2U	53,000
Clase 8E	3.214.240,535
Clase 8U	1.625.502,942

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	29,8455 ¹	42,3802 ¹	23,6114 ¹
Clase AU	48,9816	68,3931	37,5590
Clase DEH	21,1131 ¹	30,1969 ¹	16,9558 ¹
Clase DU	34,0169	47,8562	26,4784
Clase IE	11,8421 ¹	15,5210 ¹	–
Clase IEH	18,1198 ¹	25,5028 ¹	14,0970 ¹
Clase IU	11,7660	16,2895	8,8704
Clase XU [†]	10,2512	–	–
Clase ZU	11,2539	15,5962	8,5014
Clase 1E	1,4248 ¹	1,8817 ¹	1,1059 ¹
Clase 1U	1,5851	2,2113	1,2133
Clase 2E	13,0947 ¹	17,1886 ¹	10,0408 ¹
Clase 2U	12,8579	17,8242	9,7175
Clase 8E	1,5656 ¹	2,0559 ¹	1,2015 ¹
Clase 8U	1,7421	2,4165	1,3184

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.[†] Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		170.104.097
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.555.711
Interés bancario	2	1.447
Total de ingresos		1.557.158
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.576.846)
Interés bancario	2	(369)
Impuesto extranjero	3	(49.654)
Gastos operativos	3, 5	(304.326)
Total de gastos		(1.931.195)
(Pérdida) neta de inversiones		(374.037)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(4.793.522)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(306.345)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(1.482)
(Pérdida) neta realizada		(5.101.349)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(46.613.739)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		77.524
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(46.536.215)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(52.011.601)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		33.123.322
Reembolsos de acciones		(17.108.937)
Total de movimientos de capital		16.014.385
Patrimonio neto al final del ejercicio		134.106.881

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	134.106.881	170.104.097	79.154.413

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	214.560.597
Efectivo en el banco	2	1.007.770
Suscripciones por cobrar		173.185
Interés y dividendos por cobrar, neto		607.433
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	46.258
Otros activos		82.033
Total de activos		216.477.276
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(203.475)
Reembolsos pagaderos		(148.373)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(175.301)
Otros pasivos		(31.414)
Total de pasivos		(558.563)
Total de patrimonio neto		215.918.713

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	4.826,000
Clase AUP	84,000
Clase DEC	77,000
Clase DUP	49.298,838
Clase IU	1.696.964,000
Clase TE	66,000
Clase ZU	75,000
Clase 1E	1.711.851,263
Clase 1EP	1.456.672,606
Clase 1SC	448.331,157
Clase 1SH	46.927,167
Clase 1ST	57.134,593
Clase 1U	332.643,826
Clase 1UP	414.444,366
Clase 1VT	8.209,275
Clase 2E	758.317,796
Clase 2EP	72,000
Clase 2U	75,000
Clase 2UP	82,000
Clase 3E	168.288,744
Clase 3EP	8.253.236,205
Clase 3U	17.230,767
Clase 3UP	39.425,389
Clase 8E	121.882,621
Clase 8EP	237,977
Clase 8U	13.233,578
Clase 8UP	57.981,704
Clase 9E	16.536,344
Clase 9EP	72,000
Clase 9U	74,000
Clase 9UP	82,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		220.612.038
Ingresos		
Dividendos, neto	2	5.019.124
Interés bancario	2	383
Total de ingresos		5.019.507
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(2.181.903)
Interés bancario	2	(606)
Gastos operativos	3, 5	(381.951)
Total de gastos		(2.564.460)
Ingresos netos de inversiones		2.455.047
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		21.812.732
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(88.378)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		16.877
Ganancia neta realizada		21.741.231
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(13.634.521)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		38.151
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(13.596.370)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		10.599.908
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		50.057.803
Reembolsos de acciones		(61.017.036)
Dividendos	7	(4.334.000)
Total de movimientos de capital		(15.293.233)
Patrimonio neto al final del ejercicio		215.918.713

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	215.918.713	220.612.038	302.458.662

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEC	10,9032 ¹	10,8646 ¹	7,7949 ¹
Clase AUP	11,7207	11,5197	8,1529
Clase DEC	10,7205 ¹	10,7367 ¹	7,7468 ¹
Clase DUP	11,5104	11,3689	8,0829
Clase IU	13,5078	12,8194	8,7152
Clase TE	13,8508 ¹	12,4675 ¹	9,0928 ¹
Clase ZU	13,4839	12,8038	8,7095
Clase 1E	13,6005 ¹	12,3011 ¹	9,0161 ¹
Clase 1EP	12,1468 ¹	11,2887 ¹	8,5463 ¹
Clase 1SC	11,4630 ²	11,2960 ²	8,0406 ²
Clase 1SH	12,8545 ²	12,3246 ²	8,4957 ²
Clase 1ST	11,4849 ²	11,3150 ²	8,0568 ²
Clase 1U	13,2084	12,6191	8,6349
Clase 1UP	11,7772	11,5601	8,1749
Clase 1VT	11,1290 ³	11,0336 ³	7,9347 ³
Clase 2E	14,1440 ¹	12,7149 ¹	9,2630 ¹
Clase 2EP	12,4187 ¹	11,4725 ¹	8,6258 ¹
Clase 2U	13,4831	12,8080	8,7103
Clase 2UP	12,0644	11,7699	8,2624
Clase 3E	13,9552 ¹	12,5276 ¹	9,1138 ¹
Clase 3EP	12,4603 ¹	11,4904 ¹	8,6418 ¹
Clase 3U	13,5528	12,8514	8,7285
Clase 3UP	12,1163	11,8020	8,2797
Clase 8E	13,8635 ¹	12,4677 ¹	9,0865 ¹
Clase 8EP	12,3593 ¹	11,4170 ¹	8,5947 ¹
Clase 8U	13,4674	12,7934	8,7047
Clase 8UP	12,0275	11,7367	8,2462
Clase 9E	13,9945 ¹	12,5555 ¹	9,1275 ¹
Clase 9EP	12,4988 ¹	11,5171 ¹	8,6420 ¹
Clase 9U	13,6064	12,8935	8,7456
Clase 9UP	12,1372	11,8108	8,2711

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.

² La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.

³ La clase está denominada en AUD. La divisa base de la Cartera es el USD.

Threadneedle (Lux) - Global Select

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	592.254.382
Efectivo en el banco	2	3.753.594
Por cobrar para la venta de inversiones		6.999.102
Suscripciones por cobrar		5.664.048
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.144.345
Otros activos		157.754
Total de activos		609.973.225
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(73.573)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(656.436)
Otros pasivos		(79.654)
Total de pasivos		(809.663)
Total de patrimonio neto		609.163.562

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IU	66.837,831
Clase ZU	1.378,995
Clase 1E	25.948.688,749
Clase 1U	70.305.963,273
Clase 2E	53,000
Clase 2U	229.045,849
Clase 3U	7.105.719,536
Clase 8E	83.261,592
Clase 8U	20.688.020,702
Clase 9U	1.566.267,050

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase IU	15,7040	15,4100	10,4063
Clase ZU	15,6678	15,3846	10,3985
Clase 1E	3,8796 ¹	3,6305 ¹	2,6451 ¹
Clase 1U	4,3160	4,2662	2,9019
Clase 2E	16,0460 ¹	14,9212 ¹	10,8024 ¹
Clase 2U	15,6533	15,3787	10,3974
Clase 3U	4,6059	4,5175	3,0491
Clase 8E	5,6972 ¹	5,3010 ¹	3,8404 ¹
Clase 8U	6,3379	6,2292	4,2132
Clase 9U	15,7566	15,4477	10,4222

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		605.915.496
Ingresos		
Dividendos, neto	2	5.373.466
Interés bancario	2	547
Total de ingresos		5.374.013
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(8.439.459)
Interés bancario	2	(727)
Gastos operativos	3, 5	(1.013.683)
Total de gastos		(9.453.869)
(Pérdida) neta de inversiones		(4.079.856)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		63.256.075
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(900)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		161.247
Ganancia neta realizada		63.416.422
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(52.800.069)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		230
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(52.799.839)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		6.536.727
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		144.895.359
Reembolsos de acciones		(148.184.020)
Total de movimientos de capital		(3.288.661)
Patrimonio neto al final del ejercicio		609.163.562

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	609.163.562	605.915.496	365.150.642

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.877.091.618
Efectivo en el banco	2	3.222.465
Por cobrar para la venta de inversiones		23.111.308
Suscripciones por cobrar		7.297.960
Interés y dividendos por cobrar, neto		2.066.315
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	283.806
Otros activos		216.825
Total de activos		1.913.290.297
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(15.957.105)
Reembolsos pagaderos		(2.412.099)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.789.105)
Otros pasivos		(413.804)
Total de pasivos		(20.572.113)
Total de patrimonio neto		1.892.718.184

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	15.240.273,036
Clase AEP	18.987.567,259
Clase AK	1.178.978,335
Clase AUP	74.083,248
Clase DE	1.629.789,153
Clase IE	6.655.119,670
Clase IEP	2.631.535,479
Clase NE	5.944.183,000
Clase XE	1.529.301,228
Clase XFH	78,000
Clase XG	41,000
Clase XGH	30,000
Clase XU	5.717.517,656
Clase ZE	3.278.110,407
Clase ZFH	2.159.595,023
Clase ZG	1.141.692,065
Clase ZGH	76.250,526
Clase ZU	5.985.199,343

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		2.108.588.124
Ingresos		
Dividendos, neto	2	12.107.842
Interés bancario	2	901
Total de ingresos		12.108.743
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(21.988.536)
Interés bancario	2	(9.126)
Gastos operativos	3, 5	(5.209.945)
Total de gastos		(27.207.607)
(Pérdida) neta de inversiones		(15.098.864)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		216.602.513
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		1.510.905
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		1.101.825
Ganancia neta realizada		219.215.243
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(295.458.887)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		251.045
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(295.207.842)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(91.091.463)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		1.070.664.332
Reembolsos de acciones		(1.193.047.824)
Dividendos	7	(2.394.985)
Total de movimientos de capital		(124.778.477)
Patrimonio neto al final del ejercicio		1.892.718.184

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	1.892.718.184	2.108.588.124	467.243.010

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	45,6690	47,2890	28,8263
Clase AEP	14,9359	15,5848	9,5558
Clase AK	123,9807 ¹	126,8311 ¹	82,0449 ¹
Clase AUP	14,1101 ²	15,5516 ²	8,9026 ²
Clase DE	34,6525	36,0617	22,0920
Clase IE	66,7097	68,4913	41,3989
Clase IEP	12,6727	13,1106	–
Clase NE	14,6609	15,0223	9,0621
Clase XE	17,0020	17,3169	10,3840
Clase XFH	11,2077 ³	11,4338 ³	–
Clase XG	16,3517 ⁴	16,7790 ⁴	10,4565 ⁴
Clase XGH	23,1206 ⁴	23,4350 ⁴	14,0424 ⁴
Clase XU	10,5772 ²	11,3797 ²	–
Clase ZE	16,4090	16,8641	10,2035
Clase ZFH	16,1495 ³	16,6452 ³	10,1002 ³
Clase ZG	15,8031 ⁴	16,3719 ⁴	10,2901 ⁴
Clase ZGH	47,7950 ⁴	48,9276 ⁴	29,5931 ⁴
Clase ZU	15,4806 ²	16,8058 ²	9,4930 ²

¹ La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el EUR.

² La clase está denominada en USD. La divisa base de la Cartera es el EUR.

³ La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el EUR.

⁴ La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el EUR.

Threadneedle (Lux) - American

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.233.305.410
Efectivo en el banco	2	3.847.642
Suscripciones por cobrar		3.267.191
Interés y dividendos por cobrar, neto		833.684
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	1.894.412
Total de activos		1.243.148.339
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(474.975)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.057.603)
Otros pasivos		(198.184)
Total de pasivos		(1.730.762)
Total de patrimonio neto		1.241.417.577

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	1.502.751,217
Clase AU	292.740,609
Clase DEH	48.750,188
Clase DU	582.533,656
Clase IEH	436.245,326
Clase IU	6.763.199,353
Clase W	1.598,035
Clase ZE	52,000
Clase ZEH	1.561.051,905
Clase ZU	60,000
Clase 1E	2.698.411,157
Clase 1EH	185.644,732
Clase 1EP	309.785,190
Clase 1U	12.462.435,100
Clase 2E	745.901,784
Clase 2U	5.344.860,837
Clase 3EH	45.378,315
Clase 3U	189.130,202
Clase 8E	1.632.956,392
Clase 8U	2.567.454,782
Clase 9EH	55,000
Clase 9U	325.296,350

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		1.120.251.631
Ingresos		
Dividendos, neto	2	10.327.147
Interés bancario	2	1.082
Total de ingresos		10.328.229
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(12.654.988)
Interés bancario	2	(118)
Gastos operativos	3, 5	(2.285.762)
Total de gastos		(14.940.868)
(Pérdida) neta de inversiones		(4.612.639)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		209.569.433
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(15.065.206)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		3.757
Ganancia neta realizada		194.507.984
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(92.091.530)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		4.026.321
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(88.065.209)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		101.830.136
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		275.919.659
Reembolsos de acciones		(256.517.711)
Dividendos	7	(66.138)
Total de movimientos de capital		19.335.810
Patrimonio neto al final del ejercicio		1.241.417.577

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	1.241.417.577	1.120.251.631	845.435.297

Threadneedle (Lux) - American

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	67,7231 ¹	62,4805 ¹	39,8500 ¹
Clase AU	118,2788	107,7058	67,7834
Clase DEH	49,9448 ¹	46,2355 ¹	29,5927 ¹
Clase DU	45,8481	41,8962	26,4589
Clase IEH	73,6686 ¹	67,3710 ¹	42,5805 ¹
Clase IU	81,4356	73,4915	45,8385
Clase W	157,8424	143,3024	89,9169
Clase ZE	17,7345 ¹	15,1672 ¹	10,1443 ¹
Clase ZEH	15,6669 ¹	14,3367 ¹	9,0706 ¹
Clase ZU	17,0528	15,4031	9,6205
Clase 1E	16,9814 ¹	14,6201 ¹	9,8427 ¹
Clase 1EH	15,2219 ¹	14,0242 ¹	8,9324 ¹
Clase 1EP	16,1234 ¹	14,0455 ¹	9,5797 ¹
Clase 1U	16,3179	14,8399	9,3272
Clase 2E	17,3483 ¹	14,8451 ¹	9,9337 ¹
Clase 2U	16,6678	15,0659	9,4120
Clase 3EH	15,6415 ¹	14,2960 ¹	9,0365 ¹
Clase 3U	16,7719	15,1327	9,4368
Clase 8E	17,3225 ¹	14,8290 ¹	9,9269 ¹
Clase 8U	16,6398	15,0466	9,4037
Clase 9EH	15,6785 ¹	14,3200 ¹	9,0418 ¹
Clase 9U	16,7881	15,1413	9,4383

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.

Threadneedle (Lux) - American Select

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	406.006.373
Efectivo en el banco	2	8.809.492
Suscripciones por cobrar		69.573
Interés y dividendos por cobrar, neto		241.187
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	24.480
Otros activos		188
Total de activos		415.151.293
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(486.252)
Reembolsos pagaderos		(417.492)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(501.597)
Otros pasivos		(57.932)
Total de pasivos		(1.463.273)
Total de patrimonio neto		413.688.020

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AD	405,000
Clase AEH	18.379,716
Clase AN	524,000
Clase AU	140.489,621
Clase DEH	11.494,640
Clase DU	99.029,031
Clase ID	399,000
Clase IE	54,000
Clase IEH	12.549,933
Clase IN	517,000
Clase W	4.870,367
Clase ZEH	53,000
Clase ZU	5.988,946
Clase 1E	12.684.226,950
Clase 1EH	76.418,179
Clase 1EP	392.323,835
Clase 1U	40.558.822,737
Clase 2EH	712,000
Clase 2U	3.119,818
Clase 3E	1.339.364,838
Clase 3U	955.639,839
Clase 8EH	4.562,812
Clase 8U	2.553.512,444
Clase 9E	50,000
Clase 9U	2.418,367

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		438.535.319
Ingresos		
Dividendos, neto	2	3.242.008
Interés bancario	2	2.234
Total de ingresos		3.244.242
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(6.487.243)
Interés bancario	2	(392)
Gastos operativos	3, 5	(756.643)
Total de gastos		(7.244.278)
(Pérdida) neta de inversiones		(4.000.036)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		156.102.766
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(235.516)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(762)
Ganancia neta realizada		155.866.488
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(111.432.503)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		76.175
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(111.356.328)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		40.510.124
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		33.389.025
Reembolsos de acciones		(98.718.086)
Dividendos	7	(28.362)
Total de movimientos de capital		(65.357.423)
Patrimonio neto al final del ejercicio		413.688.020

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	413.688.020	438.535.319	315.353.771

Threadneedle (Lux) - American Select

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AD	16,1001 ¹	14,0643 ¹	9,5986 ¹
Clase AEH	43,2612 ²	40,4315 ²	26,0234 ²
Clase AN	16,2724 ³	14,6605 ³	11,4489 ³
Clase AU	39,9888	36,9044	23,4327
Clase DEH	29,3649 ²	27,6535 ²	17,9318 ²
Clase DU	34,9947	32,5387	20,8155
Clase ID	16,4501 ¹	14,2588 ¹	9,6523 ¹
Clase IE	16,5155 ²	14,3186 ²	9,6644 ²
Clase IEH	46,2659 ²	42,8992 ²	27,3895 ²
Clase IN	16,6107 ³	14,8493 ³	11,5094 ³
Clase W	42,3137	39,0305	24,7704
Clase ZEH	15,5785 ²	14,4664 ²	9,2429 ²
Clase ZU	16,9458	15,5296	9,7922
Clase 1E	6,1787 ²	5,3911 ²	3,6619 ²
Clase 1EH	4,5896 ²	4,2840 ²	2,7534 ²
Clase 1EP	5,9576 ²	5,2548 ²	3,5938 ²
Clase 1U	6,8745	6,3360	4,0179
Clase 2EH	16,1111 ²	14,9450 ²	9,5434 ²
Clase 2U	17,2032	15,7585	9,9304
Clase 3E	5,0705 ²	4,3890 ²	2,9575 ²
Clase 3U	5,6415	5,1582	3,2451
Clase 8EH	4,0452 ²	3,7559 ²	2,4004 ²
Clase 8U	7,9480	7,2838	4,5928
Clase 9E	17,7121 ²	15,3150 ²	10,3117 ²
Clase 9U	17,3500	15,8570	9,9683

¹ La clase está denominada en DKK. La divisa base de la Cartera es el USD.

² La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.

³ La clase está denominada en NOK. La divisa base de la Cartera es el USD.

Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	334.512.584
Efectivo en el banco	2	1.797.188
Por cobrar para la venta de inversiones		171.596
Suscripciones por cobrar		238.521
Interés y dividendos por cobrar, neto		28.296
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	158.026
Otros activos		213
Total de activos		336.906.424
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(164.934)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(329.365)
Otros pasivos		(46.767)
Total de pasivos		(541.066)
Total de patrimonio neto		336.365.358

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	140.088,752
Clase AU	29.665,968
Clase DEH	25.620,198
Clase DU	63.591,422
Clase IE	1.204.957,367
Clase IU	649.471,862
Clase ZU	8.531,509
Clase 1E	640.959,194
Clase 1EP	1.024.064,250
Clase 1U	6.728.679,099
Clase 2U	1.591.530,857
Clase 3EH	576.674,863
Clase 3U	1.048.042,443
Clase 8U	1.285.290,649
Clase 9EH	35.041,179
Clase 9U	3.273.503,110

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	16,5581 ¹	16,6368 ¹	8,2252 ¹
Clase AU	17,7793	17,6124	8,5873
Clase DEH	16,2757 ¹	16,4357 ¹	8,1660 ¹
Clase DU	17,4841	17,4069	8,5270
Clase IE	17,1002 ¹	15,9009 ¹	8,2360 ¹
Clase IU	18,3099	17,9845	8,6950
Clase ZU	18,2631	17,9572	8,6865
Clase 1E	18,4235 ¹	17,2570 ¹	8,9994 ¹
Clase 1EP	17,4744 ¹	16,5639 ¹	8,7169 ¹
Clase 1U	17,8692	17,6803	8,6079
Clase 2U	18,2483	17,9455	8,6842
Clase 3EH	17,0721 ¹	17,0018 ¹	8,3303 ¹
Clase 3U	18,3319	18,0025	8,6996
Clase 8U	18,2318	17,9365	8,6833
Clase 9EH	17,1199 ¹	17,0449 ¹	8,3502 ¹
Clase 9U	18,3630	18,0258	8,7074

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		317.052.344
Ingresos		
Dividendos, neto	2	2.876.072
Interés bancario	2	596
Total de ingresos		2.876.668
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(4.024.509)
Interés bancario	2	(53)
Gastos operativos	3, 5	(554.391)
Total de gastos		(4.578.953)
(Pérdida) neta de inversiones		(1.702.285)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		43.364.588
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.119.296)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		8.651
Ganancia neta realizada		42.253.943
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(37.199.775)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		173.761
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(37.026.014)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		3.525.644
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		140.996.526
Reembolsos de acciones		(124.970.358)
Dividendos	7	(238.798)
Total de movimientos de capital		15.787.370
Patrimonio neto al final del ejercicio		336.365.358

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	336.365.358	317.052.344	172.396.358

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	95.320.024
Efectivo en el banco	2	1.724.758
Suscripciones por cobrar		1.188.438
Interés y dividendos por cobrar, neto		338.964
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	3.161
Otros activos		17.111
Total de activos		98.592.456
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(1.287.208)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(3.994)
Impuesto por pagar	3	(259.959)
Otros pasivos	20	(1.427.289)
Total de pasivos		(2.978.450)
Total de patrimonio neto		95.614.006

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.735,856
Clase AF	51,000
Clase AS	857,690
Clase ASH	33.786,135
Clase AU	259.450,496
Clase DE	24.615,097
Clase IF	49,000
Clase ISH	71,000
Clase IU	2.098,250
Clase XU	4.637.251,800
Clase XUP	2.557.578,913
Clase ZE	45,000
Clase ZEH	49,000
Clase ZF	49,000
Clase ZG	60,000
Clase ZU	4.199,804

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	15,4485 ¹	18,3066 ¹	11,6808 ¹
Clase AF	14,5713 ²	18,6638 ²	11,4321 ²
Clase AS	11,4961 ³	14,2865 ³	9,0235 ³
Clase ASH	14,2590 ³	17,9279 ³	10,7767 ³
Clase AU	15,0003	18,7762	11,1870
Clase DE	14,6194 ¹	17,4547 ¹	11,2228 ¹
Clase IF	15,3389 ²	19,4667 ²	11,8248 ²
Clase ISH	15,2033 ³	18,9488 ³	11,2943 ³
Clase IU	15,9526	19,7990	11,6971
Clase XU	12,1685	14,9820	8,7810
Clase XUP	13,4480	16,9577	10,1785
Clase ZE	16,2137 ¹	19,0713 ¹	12,0806 ¹
Clase ZEH	13,8883 ¹	17,5088 ¹	10,5075 ¹
Clase ZF	15,3088 ²	19,4570 ²	11,8269 ²
Clase ZG	10,2500 ⁴	12,1521 ⁴	7,9962 ⁴
Clase ZU	15,8950	19,7473	11,6781

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.² La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.³ La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.⁴ La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		188.088.458
Ingresos		
Dividendos, neto	2	2.644.345
Interés bancario	2	329
Otros ingresos		108.485
Total de ingresos		2.753.159
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(60.597)
Interés bancario	2	(49)
Gastos operativos	3, 5	(203.344)
Total de gastos		(263.990)
Ingresos netos de inversiones		
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		14.934.251
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(13.053)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(48.235)
Ganancia neta realizada		14.872.963
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(42.662.660)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		11.408
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(42.651.252)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		
		(25.289.120)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		22.833.437
Reembolsos de acciones		(88.801.010)
Dividendos	7	(1.217.759)
Total de movimientos de capital		(67.185.332)
Patrimonio neto al final del ejercicio		95.614.006

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	95.614.006	188.088.458	124.384.661

Threadneedle (Lux) - Asia Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	144.400.621
Efectivo en el banco	2	2.419.586
Suscripciones por cobrar		32.223
Interés y dividendos por cobrar, neto		332.057
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	16
Otros activos		32.005
Total de activos		147.216.508
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(2.057.217)
Reembolsos pagaderos		(31.388)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(154.380)
Impuesto por pagar	3	(518.672)
Otros pasivos	20	(2.073.873)
Total de pasivos		(4.835.530)
Total de patrimonio neto		142.380.978

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	83,000
Clase AEH	83,000
Clase DE	83,000
Clase DEH	83,000
Clase IE	453.731,789
Clase IU	172.488,901
Clase ZU	19.857,424
Clase 1E	1.410.663,064
Clase 1U	23.971.662,820
Clase 2E	55,000
Clase 2U	1.631.669,711
Clase 3U	4.551.379,745
Clase 8E	676,483
Clase 8U	1.554.803,944
Clase 9U	8.216,061

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE [#]	8,9696 ¹	—	—
Clase AEH [#]	8,0913 ¹	—	—
Clase DE [#]	8,9361 ¹	—	—
Clase DEH [#]	8,0618 ¹	—	—
Clase IE	12,8045 ¹	14,5096 ¹	9,0252 ¹
Clase IU	13,3897	16,0271	9,3071
Clase ZU	13,3540	16,0024	9,3012
Clase 1E	3,2041 ¹	3,6581 ¹	2,2925 ¹
Clase 1U	3,5648	4,2991	2,5152
Clase 2E	13,6717 ¹	15,5085 ¹	9,6601 ¹
Clase 2U	13,3414	15,9916	9,2995
Clase 3U	3,2148	3,8480	2,2346
Clase 8E	3,6646 ¹	4,1593 ¹	2,5930 ¹
Clase 8U	4,0790	4,8912	2,8455
Clase 9U	13,4178	16,0542	9,3192

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.[#] Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		343.930.526
Ingresos		
Dividendos, neto	2	5.354.187
Interés bancario	2	369
Total de ingresos		5.354.556
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(3.281.756)
Interés bancario	2	(330)
Impuesto extranjero	3	(62.940)
Gastos operativos	3, 5	(408.329)
Comisiones varias	4	(11)
Total de gastos		(3.753.366)
Ingresos netos de inversiones		
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		43.121.982
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(243)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(495.257)
Ganancia neta realizada		42.626.482
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(92.367.691)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		16
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(92.367.675)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(48.140.003)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		77.479.320
Reembolsos de acciones		(230.888.865)
Total de movimientos de capital		(153.409.545)
Patrimonio neto al final del ejercicio		142.380.978

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

USD	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
	142.380.978	343.930.526	195.909.991

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	370.623.854
Efectivo en el banco	2	7.069.308
Por cobrar para la venta de inversiones		1.250.885
Suscripciones por cobrar		129.415
Interés y dividendos por cobrar, neto		204.789
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	1.064.274
Total de activos		380.342.525
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(769.612)
Reembolsos pagaderos		(247.047)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(179.502)
Otros pasivos		(77.347)
Total de pasivos		(1.273.508)
Total de patrimonio neto		379.069.017

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	339,290
Clase AEH	21.509,877
Clase AU	77.410,274
Clase AUP	9.499,092
Clase DU	7.929,831
Clase IU	2.101.415,251
Clase XS	69,000
Clase XSH	7.079.213,360
Clase ZEH	338.268,660
Clase ZFH	48,000
Clase ZGH	35,000
Clase ZU	3.546.486,328

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEC	18,8839 ¹	17,5161 ¹	11,3591 ¹
Clase AEH	31,2589 ¹	28,6186 ¹	18,3280 ¹
Clase AU	57,7098	52,1802	32,9720
Clase AUP	20,8998	19,1464	12,2618
Clase DU	28,6587	26,0427	16,5381
Clase IU	83,5904	74,9789	47,0024
Clase XS	20,4221 ²	18,0154 ²	11,8570 ²
Clase XSH	20,6253 ²	18,3848 ²	11,4988 ²
Clase ZEH	20,4263 ¹	18,5596 ¹	11,8015 ¹
Clase ZFH	19,9729 ³	18,1775 ³	11,5719 ³
Clase ZGH	21,2839 ⁴	19,2281 ⁴	12,2135 ⁴
Clase ZU	23,1731	20,7962	13,0432

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.² La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.³ La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.⁴ La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		484.292.226
Ingresos		
Dividendos, neto	2	4.491.304
Interés bancario	2	2.301
Total de ingresos		4.493.605
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(3.032.540)
Interés bancario	2	(88)
Gastos operativos	3, 5	(1.213.281)
Total de gastos		(4.245.909)
Ingresos netos de inversiones		247.696
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		99.783.973
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(2.596.655)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		6.854
Ganancia neta realizada		97.194.172
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(46.629.273)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		1.029.713
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(45.599.560)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		51.842.308
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		75.414.402
Reembolsos de acciones		(232.477.048)
Dividendos	7	(2.871)
Total de movimientos de capital		(157.065.517)
Patrimonio neto al final del ejercicio		379.069.017

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	379.069.017	484.292.226	462.376.758

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	78.078.137
Efectivo en el banco	2	969.724
Suscripciones por cobrar		94.415
Interés y dividendos por cobrar, neto		41.686
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	8.256
Otros activos		998
Total de activos		79.193.216
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(513.814)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(5.614)
Otros pasivos		(6.548)
Total de pasivos		(525.976)
Total de patrimonio neto		78.667.240

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.819,435
Clase AEH	54,100
Clase AU	59,094
Clase AUP	63,640
Clase DE	14.551,531
Clase DEH	38.328,105
Clase DU	917,649
Clase IE	10.594,394
Clase IEC	58,100
Clase IEH	54,100
Clase IFH	59,100
Clase IG	18.962,461
Clase IU	57,576
Clase NE	65,000
Clase NG	3.280.184,537
Clase NU	68.874,000
Clase XG	886.059,000
Clase ZEH	54,100
Clase ZFH	60,100
Clase ZU	755,717

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		26.554.871
Ingresos		
Dividendos, neto	2	891.842
Interés bancario	2	36
Total de ingresos		891.878
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(61.538)
Gastos operativos	3, 5	(69.775)
Total de gastos		(131.313)
Ingresos netos de inversiones		760.565
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		1.282.766
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(32.838)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(39.688)
Ganancia neta realizada		1.210.240
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		5.297.502
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		8.487
Cambio neto en ganancia no realizada		5.305.989
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		7.276.794
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		56.550.113
Reembolsos de acciones		(11.714.462)
Dividendos	7	(76)
Total de movimientos de capital		44.835.575
Patrimonio neto al final del ejercicio		78.667.240

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	78.667.240	26.554.871	5.455.757

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	18,2898 ¹	15,2404 ¹	10,9422 ¹
Clase AEH	16,4623 ¹	14,6709 ¹	9,9686 ¹
Clase AU	18,2540	16,0663	10,7691
Clase AUP	16,5908	14,8613	10,1509
Clase DE	18,1073 ¹	15,1186 ¹	10,8764 ¹
Clase DEH	16,3108 ¹	14,5633 ¹	9,9148 ¹
Clase DU	18,0794	15,9450	10,7091
Clase IE	18,5659 ¹	15,4165 ¹	11,0332 ¹
Clase IEC	15,1809 ¹	13,7286 ¹	9,4747 ¹
Clase IEH	16,7198 ¹	14,8479 ¹	10,0566 ¹
Clase IFH	16,5489 ²	14,7157 ²	9,9810 ²
Clase IG	14,8037 ³	12,3891 ³	9,2032 ³
Clase IU	18,5671	16,2814	10,8750
Clase NE	14,9581 ¹	12,3904 ¹	–
Clase NG	13,8493 ³	11,5750 ³	–
Clase NU	14,0857	12,3331	–
Clase XG	13,9108 ³	11,6147 ³	–
Clase ZEH	16,6597 ¹	14,8103 ¹	10,0367 ¹
Clase ZFH	16,4549 ²	14,6448 ²	9,9435 ²
Clase ZU	18,4729	16,2192	10,8446

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.

² La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.

³ La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.

Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	470.198.593
Efectivo en el banco	2	3.029.049
Suscripciones por cobrar		499.876
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.360.886
Otros activos		521.522
Total de activos		475.609.926
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(130.578)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(13.825)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(262.573)
Otros pasivos		(57.766)
Total de pasivos		(464.742)
Total de patrimonio neto		475.145.184

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	149.800,138
Clase ASH	350.628,150
Clase AUH	8.273,433
Clase DE	160.199,669
Clase IE	2.820.505,413
Clase W	30.997,242
Clase XE	1.490.998,743
Clase ZE	400.244,742
Clase ZUH	2.325,637
Clase 1E	3.106.721,280
Clase 1EP	65,000
Clase 1G	167.406,283
Clase 1GP	59,000
Clase 2E	7.442.673,214
Clase 2G	483.687,752
Clase 2U	73,000
Clase 3E	403.975,888
Clase 3G	253.272,292
Clase 3GP	373,964
Clase 4E	663.946,597
Clase 4G	55,000
Clase 8E	250.019,854
Clase 8G	36.980,246
Clase 8U	73,000
Clase 9E	62,000
Clase 9G	56,000
Clase 9GP	57,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		386.572.137
Ingresos		
Dividendos, neto	2	10.306.835
Interés bancario	2	3.203
Total de ingresos		10.310.038
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(3.135.338)
Interés bancario	2	(15.727)
Gastos operativos	3, 5	(645.497)
Total de gastos		(3.796.562)
Ingresos netos de inversiones		6.513.476
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		16.098.564
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		443.624
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		115.415
Ganancia neta realizada en reembolso de impuestos		8
Ganancia neta realizada		16.657.611
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		1.447.436
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(71.664)
Cambio neto en ganancia no realizada		1.375.772
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		24.546.859
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		160.966.833
Reembolsos de acciones		(96.940.436)
Dividendos	7	(209)
Total de movimientos de capital		64.026.188
Patrimonio neto al final del ejercicio		475.145.184

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	475.145.184	386.572.137	169.655.099

Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	83,5781	78,4220	55,8171
Clase ASH	24,0735 ¹	22,3960 ¹	15,8502 ¹
Clase AUH	28,9294 ²	26,8262 ²	18,8909 ²
Clase DE	30,1163	28,3149	20,2086
Clase IE	59,3341	55,2576	39,0176
Clase W	70,0340	65,8450	46,8999
Clase XE	69,2730	64,0957	44,9324
Clase ZE [#]	9,8259	—	—
Clase ZUH	18,9486 ²	17,4726 ²	12,2253 ²
Clase 1E	13,3070	12,4836	8,8812
Clase 1EP	12,6891	12,2262	8,8718
Clase 1G	12,4978 ³	11,8186 ³	8,7345 ³
Clase 1GP	11,9244 ³	11,5799 ³	8,7278 ³
Clase 2E	13,5821	12,6844	8,9747
Clase 2G	12,7552 ³	12,0079 ³	8,8258 ³
Clase 2U	12,9544 ²	12,7712 ²	8,4323 ²
Clase 3E	13,6488	12,7289	8,9937
Clase 3G	12,8183 ³	12,0504 ³	8,8448 ³
Clase 3GP	12,2439 ³	11,8079 ³	8,8385 ³
Clase 4E	14,0773	13,0161	9,1182
Clase 4G	13,2403 ³	12,3357 ³	8,9746 ³
Clase 8E	13,5570	12,6660	8,9653
Clase 8G	12,7375 ³	11,9961 ³	8,8207 ³
Clase 8U	12,9310 ²	12,7491 ²	8,4188 ²
Clase 9E	13,7069	12,7770	9,0171
Clase 9G	12,8673 ³	12,0896 ³	8,8664 ³
Clase 9GP	12,3004 ³	11,8602 ³	8,8664 ³

¹ La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el EUR.

² La clase está denominada en USD. La divisa base de la Cartera es el EUR.

³ La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el EUR.

[#] Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	60.188.439
Efectivo en el banco	2	177.650
Suscripciones por cobrar		184.444
Interés y dividendos por cobrar, neto		325.927
Otros activos		225.114
Total de activos		61.101.574
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(75.924)
Reembolsos pagaderos		(47.348)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(45.759)
Otros pasivos		(7.508)
Total de pasivos		(176.539)
Total de patrimonio neto		60.925.035

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	412,301
Clase AEP	27.104,892
Clase AUP	80,000
Clase DE	4.762,182
Clase DEP	5.262,133
Clase IE	397.178,548
Clase IEP	853.397,000
Clase ZE	35.002,221
Clase ZEP	22.802,000
Clase 1E	4.143.033,310
Clase 1EP	10.859.585,399
Clase 1G	178.505,501
Clase 1GP	353.190,637
Clase 2E	974.334,004
Clase 2EP	72,000
Clase 2G	58,000
Clase 2GP	63,000
Clase 3EP	71.251,006
Clase 3G	76.223,627
Clase 3GP	680.529,245
Clase 4GP	5.519.764,743
Clase 8E	301.271,001
Clase 8EP	860.721,752
Clase 8G	47.778,663
Clase 8GP	458.523,153
Clase 9EP	71,000
Clase 9G	57,000
Clase 9GP	63,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		72.471.914
Ingresos		
Dividendos, neto	2	2.705.757
Interés bancario	2	209
Total de ingresos		2.705.966
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(659.535)
Interés bancario	2	(5.348)
Gastos operativos	3, 5	(116.617)
Comisiones varias	4	(474)
Total de gastos		(781.974)
Ingresos netos de inversiones		1.923.992
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		4.866.347
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(5.349)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(8.953)
Ganancia neta realizada		4.852.045
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(5.046.085)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(5.046.085)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		1.729.952
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		16.615.466
Reembolsos de acciones		(28.556.605)
Dividendos	7	(1.335.692)
Total de movimientos de capital		(13.276.831)
Patrimonio neto al final del ejercicio		60.925.035

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	60.925.035	72.471.914	40.776.458

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	12,2899	12,2123	8,4207
Clase AEP	10,7997	11,1512	7,9601
Clase AUP	10,9127 ¹	11,9099 ¹	7,9466 ¹
Clase DE	12,1356	12,1020	8,3747
Clase DEP	10,6571	11,0429	7,9168
Clase IE	12,6707	12,4632	8,5228
Clase IEP	11,1344	11,3788	8,0572
Clase ZE	12,6183	12,4458	8,5167
Clase ZEP	11,0767	11,3507	8,0497
Clase 1E	2,0062	1,9917	1,3718
Clase 1EP	1,0714	1,1057	0,7893
Clase 1G	1,6952 ²	1,6964 ²	1,2138 ²
Clase 1GP	0,9066 ²	0,9428 ²	0,6989 ²
Clase 2E	12,5994	12,4322	8,5107
Clase 2EP	11,0904	11,3572	8,0536
Clase 2G	12,1240 ²	12,0502 ²	8,5638 ²
Clase 2GP	10,6484 ²	10,9938 ²	8,0970 ²
Clase 3EP	1,7509	1,7928	1,2698
Clase 3G	1,6454 ²	1,6343 ²	1,1606 ²
Clase 3GP	1,4708 ²	1,5182 ²	1,1214 ²
Clase 4GP	1,3081 ²	1,3394 ²	0,9796 ²
Clase 8E	2,2182	2,1897	1,4996
Clase 8EP	1,1693	1,1990	0,8512
Clase 8G	1,8760 ²	1,8667 ²	1,3280 ²
Clase 8GP	0,9875 ²	1,0208 ²	0,7528 ²
Clase 9EP	11,1480	11,4256	8,0816
Clase 9G	12,1739 ²	12,0857 ²	8,5782 ²
Clase 9GP	10,6983 ²	11,0352 ²	8,1121 ²

¹ La clase está denominada en USD. La divisa base de la Cartera es el EUR.

² La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el EUR.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	673.161.083
Efectivo en el banco	2	2.059.536
Suscripciones por cobrar		366.836
Interés y dividendos por cobrar, neto		457.608
Otros activos		541.350
Total de activos		676.586.413
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(2.043.478)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(24.556)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(739.786)
Otros pasivos		(180.645)
Total de pasivos		(2.988.465)
Total de patrimonio neto		673.597.948

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	6.710.995,772
Clase ASH	489.065,793
Clase AUH	14.504,457
Clase DE	1.269.184,850
Clase DUH	1.177,000
Clase IE	3.325.935,046
Clase W	9.912,171
Clase XE	88,000
Clase ZE	4.170.201,128
Clase ZFH	2.681,004

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	50,4135	53,6034	34,7061
Clase ASH	34,6658 ¹	36,5279 ¹	23,5023 ¹
Clase AUH	13,4075 ²	14,0753 ²	9,0044 ²
Clase DE	45,0490	48,3327	31,5752
Clase DUH	12,9610 ²	13,7346 ²	8,8604 ²
Clase IE	63,8189	67,3496	43,2819
Clase W	84,2877	89,6657	58,0840
Clase XE [#]	10,4050	—	—
Clase ZE	12,8349	13,5449	8,7046
Clase ZFH	12,3467 ³	13,0545 ³	8,4083 ³

¹ La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el EUR.² La clase está denominada en USD. La divisa base de la Cartera es el EUR.³ La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el EUR.[#] Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		967.772.792
Ingresos		
Dividendos, neto	2	10.932.899
Interés bancario	2	7.232
Total de ingresos		10.940.131
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(12.007.090)
Interés bancario	2	(26.515)
Gastos operativos	3, 5	(3.128.669)
Total de gastos		(15.162.274)
(Pérdida) neta de inversiones		(4.222.143)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		54.814.360
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		1.559.020
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		620.014
Ganancia neta realizada en reembolso de impuestos		136
Ganancia neta realizada		56.993.530
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(86.593.775)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(331.978)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(86.925.753)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(34.154.366)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		274.055.250
Reembolsos de acciones		(534.075.728)
Total de movimientos de capital		(260.020.478)
Patrimonio neto al final del ejercicio		673.597.948

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	673.597.948	967.772.792	435.284.977

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.236.815.189
Efectivo en el banco	2	1.565.833
Suscripciones por cobrar		1.949.816
Interés y dividendos por cobrar, neto		620.755
Otros activos		1.450.218
Total de activos		1.242.401.811
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(4.520.681)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(291.620)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.031.470)
Otros pasivos		(162.066)
Total de pasivos		(6.005.837)
Total de patrimonio neto		1.236.395.974

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IE	1.351.581,452
Clase ZE	1.713.558,640
Clase 1E	27.660.548,767
Clase 1EP	919.976,875
Clase 1FH	287.955,400
Clase 1G	720.581,820
Clase 1UH	2.056.222,029
Clase 2E	17.586.197,336
Clase 2G	56,000
Clase 3E	18.839.423,660
Clase 3EP	1.212.846,309
Clase 3FH	810.617,242
Clase 3G	2.201.541,710
Clase 3GP	219.372,249
Clase 3UH	1.167.898,932
Clase 4E	8.426.104,711
Clase 4G	1.832.020,560
Clase 8E	6.547.531,023
Clase 8G	635.357,275
Clase 9E	9.072.194,700
Clase 9EP	64,000
Clase 9FH	20.330,242
Clase 9G	927.888,277
Clase 9GP	57,000
Clase 9UH	263.587,729

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		1.980.272.935
Ingresos		
Dividendos, neto	2	24.874.764
Interés bancario	2	10.568
Total de ingresos		24.885.332
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(19.118.026)
Interés bancario	2	(41.158)
Gastos operativos	3, 5	(3.050.423)
Total de gastos		(22.209.607)
Ingresos netos de inversiones		2.675.725
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		72.024.793
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		5.343.243
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		433.508
Ganancia neta realizada		77.801.544
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(247.204.353)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(817.779)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(248.022.132)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(167.544.863)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		483.250.537
Reembolsos de acciones		(1.059.165.487)
Dividendos	7	(417.148)
Total de movimientos de capital		(576.332.098)
Patrimonio neto al final del ejercicio		1.236.395.974

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	1.236.395.974	1.980.272.935	922.670.066

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase IE	12,1084	13,0732	8,6065
Clase ZE	11,7537	12,7094	8,3794
Clase 1E	11,4986	12,5109	8,2996
Clase 1EP	10,9343	12,0777	8,0712
Clase 1FH	11,3955 ¹	12,4182 ¹	8,2583 ¹
Clase 1G	10,7968 ²	11,8416 ²	8,1606 ²
Clase 1UH	12,2785 ³	13,1915 ³	8,6456 ³
Clase 2E	11,7673	12,7202	8,3840
Clase 2G	11,0646 ²	12,0514 ²	8,2490 ²
Clase 3E	11,8366	12,7747	8,4066
Clase 3EP	11,2596	12,3346	8,1761
Clase 3FH	11,7317 ¹	12,6823 ¹	8,3663 ¹
Clase 3G	11,1130 ²	12,0901 ²	8,2649 ²
Clase 3GP	10,5711 ²	11,6735 ²	8,0380 ²
Clase 3UH	12,6338 ³	13,4644 ³	8,7556 ³
Clase 4E	12,1985	13,0550	8,5195
Clase 4G	12,8182 ²	13,8285 ²	9,3745 ²
Clase 8E	11,7527	12,7095	8,3804
Clase 8G	11,0354 ²	12,0297 ²	8,2400 ²
Clase 9E	11,8550	12,7895	8,4130
Clase 9EP	11,2856	12,3547	8,1797
Clase 9FH	11,7487 ¹	12,6978 ¹	8,3720 ¹
Clase 9G	11,1328 ²	12,1068 ²	8,2730 ²
Clase 9GP	10,6036 ²	11,7010 ²	8,0468 ²
Clase 9UH	12,6594 ³	13,4863 ³	8,7665 ³

¹ La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el EUR.

² La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el EUR.

³ La clase está denominada en USD. La divisa base de la Cartera es el EUR.

Threadneedle (Lux) - European Select

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.619.990.880
Efectivo en el banco	2	3.076.914
Suscripciones por cobrar		406.008
Otros activos		2.912.881
Total de activos		1.626.386.683
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(973.122)
Interés pagadero bancario		(2.663)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(103.527)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.738.892)
Otros pasivos		(181.508)
Total de pasivos		(2.999.712)
Total de patrimonio neto		1.623.386.971

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	120.639,994
Clase AGH	3.784,833
Clase AUH	12.616,145
Clase DUH	66,000
Clase IE	1.117.568,067
Clase ZE	85,000
Clase ZG	22.581,768
Clase ZGH	243.861,343
Clase 1E	74.418.310,684
Clase 1EP	875.759,556
Clase 1SH	2.405.384,391
Clase 1U	49.354,772
Clase 1UH	329.971,730
Clase 2E	11.321.027,255
Clase 2EP	79.176,000
Clase 3E	3.831.725,812
Clase 3U	527.547,916
Clase 8E	3.044.950,107
Clase 8EP	33.970,558
Clase 9E	11.806.406,524
Clase 9U	63,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		1.641.460.241
Ingresos		
Dividendos, neto	2	20.103.352
Interés bancario	2	564
Otros ingresos		16.185
Total de ingresos		20.120.101
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(23.234.982)
Interés bancario	2	(24.467)
Gastos operativos	3, 5	(2.432.115)
Total de gastos		(25.691.564)
(Pérdida) neta de inversiones		(5.571.463)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		50.157.180
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		2.915.792
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(63.425)
Ganancia neta realizada en reembolso de impuestos		2
Ganancia neta realizada		53.009.549
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(5.472.348)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(559.525)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(6.031.873)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		41.406.213
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		228.249.523
Reembolsos de acciones		(287.537.364)
Dividendos	7	(191.642)
Total de movimientos de capital		(59.479.483)
Patrimonio neto al final del ejercicio		1.623.386.971

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	1.623.386.971	1.641.460.241	1.246.832.227

Threadneedle (Lux) - European Select

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	30,1120	29,4285	21,7556
Clase AGH	32,2683 ¹	31,3771 ¹	23,1092 ¹
Clase AUH	34,1941 ²	33,0305 ²	24,1474 ²
Clase DUH	14,2740 ²	13,8650 ²	10,1924 ²
Clase IE	43,7595	42,4042	31,0840
Clase ZE [‡]	9,1184	—	—
Clase ZG	14,5919 ¹	14,2678 ¹	10,8756 ¹
Clase ZGH	33,3203 ¹	32,1562 ¹	23,5152 ¹
Clase 1E	14,3703	14,0231	10,3514
Clase 1EP	13,6418	13,5040	10,0817
Clase 1SH	14,9506 ³	14,4595 ³	10,6075 ³
Clase 1U	13,8075 ²	14,2325 ²	9,8084 ²
Clase 1UH	15,2829 ²	14,7401 ²	10,7592 ²
Clase 2E	14,6652	14,2266	10,4401
Clase 2EP	13,9345	13,7092	10,1699
Clase 3E	14,7570	14,2900	10,4678
Clase 3U	14,1771 ²	14,5014 ²	9,9173 ²
Clase 8E	14,6457	14,2134	10,4345
Clase 8EP	13,9187	13,7016	10,1732
Clase 9E	14,7765	14,3031	10,4732
Clase 9U	14,2172 ²	14,5368 ²	9,9286 ²

¹ La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el EUR.

² La clase está denominada en USD. La divisa base de la Cartera es el EUR.

³ La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el EUR.

[‡] Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.769.745.752
Efectivo en el banco	2	2.771.293
Por cobrar para la venta de inversiones		88.580
Suscripciones por cobrar		1.926.278
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.048.608
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	88.083
Otros activos		2.569.291
Total de activos		1.778.237.885
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(1.339.878)
Reembolsos pagaderos		(2.051.775)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.922.460)
Otros pasivos		(288.572)
Total de pasivos		(5.602.685)
Total de patrimonio neto		1.772.635.200

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IE	271.829,655
Clase ZE	1.117.879,034
Clase 1E	91.427.361,993
Clase 1EP	3.287.607,961
Clase 1FH	61,000
Clase 2E	5.243.604,633
Clase 3E	7.313.851,042
Clase 3EP	772.210,917
Clase 3FH	774.453,805
Clase 8E	7.197.758,534
Clase 9E	10.115.662,517
Clase 9EP	625.374,000
Clase 9FH	105,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase IE	12,6494	13,0435	8,4587
Clase ZE	14,0668	14,5269	9,4347
Clase 1E	13,7718	14,3106	9,3519
Clase 1EP	13,1298	13,8388	9,1237
Clase 1FH	13,6535 ¹	14,2143 ¹	9,3161 ¹
Clase 2E	14,0850	14,5412	9,4412
Clase 3E	14,1189	14,5559	9,4377
Clase 3EP	13,4851	14,0994	9,2225
Clase 3FH	14,0261 ¹	14,4944 ¹	9,4251 ¹
Clase 8E	14,0682	14,5297	9,4375
Clase 9E	14,1693	14,6020	9,4637
Clase 9EP	13,5144	14,1156	9,2293
Clase 9FH	14,0265 ¹	14,4918 ¹	9,4226 ¹

¹ La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el EUR.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		1.932.987.086
Ingresos		
Dividendos, neto	2	21.872.670
Interés bancario	2	1.179
Otros ingresos		9.443
Total de ingresos		21.883.292
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(26.883.130)
Interés bancario	2	(32.877)
Gastos operativos	3, 5	(4.009.298)
Total de gastos		(30.925.305)
(Pérdida) neta de inversiones		(9.042.013)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		98.981.901
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		705.537
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		63.542
Ganancia neta realizada		99.750.980
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(152.268.669)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		87.893
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(152.180.776)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(61.471.809)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		290.273.909
Reembolsos de acciones		(388.285.721)
Dividendos	7	(868.265)
Total de movimientos de capital		(98.880.077)
Patrimonio neto al final del ejercicio		1.772.635.200

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	1.772.635.200	1.932.987.086	1.390.747.109

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	52.513.464
Efectivo en el banco	2	372.173
Por cobrar para la venta de inversiones		807.140
Suscripciones por cobrar		30.870
Interés y dividendos por cobrar, neto		224.538
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	43.422
Total de activos		53.991.607
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(899.496)
Reembolsos pagaderos		(24.918)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(31.533)
Impuesto por pagar	3	(79.970)
Otros pasivos	20	(790.750)
Total de pasivos		(1.826.667)
Total de patrimonio neto		52.164.940

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	25.073,970
Clase AU	39.517,654
Clase AUP	145.908,493
Clase DEH	74.216,370
Clase DU	37.279,686
Clase DUP	41.114,572
Clase IEP	826.622,287
Clase IU	70,000
Clase W	25.604,957
Clase XU	1.341.544,014
Clase XUP	282.875,299
Clase ZG	51,000
Clase ZGH	6.917,198
Clase ZGP	56,000
Clase ZU	100,000
Clase ZUP	3.674,751

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	45,2875 ¹	49,6140 ¹	28,5781 ¹
Clase AU	114,4216	123,7850	70,3078
Clase AUP	13,4844	15,1272	8,9182
Clase DEH	31,9765 ¹	35,2821 ¹	20,4762 ¹
Clase DU	55,2874	60,2623	34,4843
Clase DUP	13,1305	14,8423	8,7791
Clase IEP	14,0025 ¹	14,7448 ¹	9,1986 ¹
Clase IU	13,2161	14,1867	7,9943
Clase W	84,5649	91,6683	52,1698
Clase XU	14,7814	15,7291	8,7885
Clase XUP	14,1419	15,6032	8,9896
Clase ZG	13,8913 ²	14,2390 ²	8,9304 ²
Clase ZGH	25,8292 ²	27,9288 ²	15,9734 ²
Clase ZGP	12,2208 ²	12,9909 ²	8,4224 ²
Clase ZU ^f	9,8775	—	—
Clase ZUP	15,6966	17,4725	10,1806

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.² La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.^f Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		52.863.212
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.695.374
Interés bancario	2	165
Total de ingresos		1.695.539
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(312.184)
Interés bancario	2	(15)
Impuesto extranjero	3	(79.788)
Gastos operativos	3, 5	(104.101)
Comisiones varias	4	(9)
Total de gastos		(496.097)
Ingresos netos de inversiones		1.199.442
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		1.698.553
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(348.170)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(64.853)
Ganancia neta realizada		1.285.530
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(6.694.490)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		91.990
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(6.602.500)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(4.117.528)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		17.460.576
Reembolsos de acciones		(13.394.852)
Dividendos	7	(646.468)
Total de movimientos de capital		3.419.256
Patrimonio neto al final del ejercicio		52.164.940

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	52.164.940	52.863.212	41.795.505

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Technology

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	637.799.338
Efectivo en el banco	2	21.096.330
Por cobrar para la venta de inversiones		2.307.766
Suscripciones por cobrar		25.934.870
Interés y dividendos por cobrar, neto		211.639
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	966.982
Total de activos		688.316.925
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(35.151.085)
Reembolsos pagaderos		(594.063)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(759.553)
Otros pasivos		(148.971)
Total de pasivos		(36.653.672)
Total de patrimonio neto		651.663.253

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	562.926,037
Clase AS	782.662,846
Clase AU	3.062.575,834
Clase AUP	72.808,394
Clase BU	59.245,502
Clase DEH	63.331,643
Clase DU	527.476,907
Clase IE	342.259,875
Clase IEH	1.468.977,387
Clase IG	6.543,913
Clase IU	6.030.673,242
Clase ZEH	68.849,133
Clase ZFH	50.725,815
Clase ZG	5.854,502
Clase ZU	1.028.367,784

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	73,7380 ¹	67,4347 ¹	34,4250 ¹
Clase AS	25,6949 ²	23,0106 ²	12,2847 ²
Clase AU	98,4809	88,8329	44,7525
Clase AUP	21,0644	19,1460	9,7092
Clase BU	124,3152	112,5857	56,9448
Clase DEH	21,1515 ¹	19,4109 ¹	9,9444 ¹
Clase DU	144,4193	130,7275	66,0879
Clase IE	17,4019 ¹	14,7271 ¹	7,8762 ¹
Clase IEH	25,0771 ¹	22,7318 ¹	11,5005 ¹
Clase IG	23,2680 ³	19,8499 ³	11,0263 ³
Clase IU	17,4419	15,5922	7,7851
Clase ZEH	20,7904 ¹	18,8611 ¹	9,5567 ¹
Clase ZFH	24,2713 ⁴	22,0485 ⁴	11,1832 ⁴
Clase ZG	23,1988 ³	19,8092 ³	11,01680 ³
Clase ZU	45,0572	40,3192	20,1512

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.² La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.³ La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.⁴ La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		537.276.170
Ingresos		
Dividendos, neto	2	3.263.994
Interés bancario	2	2.273
Total de ingresos		3.266.267
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(9.188.529)
Interés bancario	2	(111)
Gastos operativos	3, 5	(1.797.284)
Total de gastos		(10.985.924)
(Pérdida) neta de inversiones		(7.719.657)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		88.189.474
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(11.765.137)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(3.133)
Ganancia neta realizada		76.421.204
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(23.640.209)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		2.546.988
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(21.093.221)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		47.608.326
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		397.022.400
Reembolsos de acciones		(330.231.852)
Dividendos	7	(11.791)
Total de movimientos de capital		66.778.757
Patrimonio neto al final del ejercicio		651.663.253

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

USD	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
	651.663.253	537.276.170	275.490.723

Threadneedle (Lux) - UK Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 GBP
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	272.380.604
Efectivo en el banco	2	877.256
Suscripciones por cobrar		261.324
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.774.173
Total de activos		275.293.357
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(583.325)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(36.841)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(181.556)
Otros pasivos		(38.397)
Total de pasivos		(840.119)
Total de patrimonio neto		274.453.238

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	124.032,982
Clase AEH	298.704,716
Clase AFH	9.942,000
Clase AG	710.331,295
Clase AGP	72.437,446
Clase DEH	119.589,129
Clase DG	3.049,404
Clase IE	1.240.384,043
Clase IEH	281.048,167
Clase IG	1.468.077,107
Clase IGP	698.619,829
Clase NEH	66,000
Clase NFH	73,000
Clase NG	120.232,000
Clase NGP	57,000
Clase NUH	78,000
Clase TEH	66,000
Clase TFH	73,000
Clase TG	57,000
Clase TGP	57,000
Clase TUH	78,000
Clase ZE	17.068,935
Clase ZEH	400.895,694
Clase ZFH	3.325,000
Clase ZG	234.674,829
Clase ZGP	1.302.016,526
Clase ZUH	86.959,355
Clase 3EH	3.289.687,897
Clase 3FH	42.371,000
Clase 3UH	2.097.839,912
Clase 9EH	3.512,000
Clase 9EP	2.589.832,979
Clase 9FH	6.085,000
Clase 9G	8.957.945,165
Clase 9UH	87,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 GBP
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		296.943.244
Ingresos		
Dividendos, neto	2	9.547.579
Interés bancario	2	1.661
Total de ingresos		9.549.240
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(2.610.366)
Interés bancario	2	(156)
Gastos operativos	3, 5	(576.928)
Total de gastos		(3.187.450)
Ingresos netos de inversiones		6.361.790
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		7.338.073
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(315.263)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(10.054)
Ganancia neta realizada		7.012.756
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(12.809.567)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		86.280
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(12.723.287)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		651.259
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		181.039.225
Reembolsos de acciones		(201.142.799)
Dividendos	7	(3.037.691)
Total de movimientos de capital		(23.141.265)
Patrimonio neto al final del ejercicio		274.453.238

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
GBP	274.453.238	296.943.244	206.285.143

Threadneedle (Lux) - UK Equities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	9,3165 ¹	9,2845 ¹	6,8397 ¹
Clase AEH	19,9122 ¹	20,1489 ¹	15,5141 ¹
Clase AFH	9,7085 ²	9,8231 ²	7,5610 ²
Clase AG	27,8526	27,9800	21,4122
Clase AGP	20,3018	21,0118	16,5430
Clase DEH	9,3874 ¹	9,5731 ¹	7,4306 ¹
Clase DG	9,7276	9,8507	7,5987
Clase IE	9,9716 ¹	9,8435 ¹	7,1738 ¹
Clase IEH	30,1611 ¹	30,2322 ¹	23,0551 ¹
Clase IG	40,7193	40,5187	30,7157
Clase IGP	29,9926	30,7471	23,9808
Clase NEH	12,3773 ¹	12,3770 ¹	–
Clase NFH	12,3772 ²	12,3746 ²	–
Clase NG	12,5034	12,4164	–
Clase NGP	12,0225	12,2963	–
Clase NUH	12,6056 ³	12,4477 ³	–
Clase TEH	12,3724 ¹	12,3766 ¹	–
Clase TFH	12,3703 ²	12,3738 ²	–
Clase TG	12,5042	12,4163	–
Clase TGP	12,0170	12,2962	–
Clase TUH	12,6005 ³	12,4472 ³	–
Clase ZE	9,4643 ¹	9,3628 ¹	6,8468 ¹
Clase ZEH	12,3480 ¹	12,4008 ¹	9,4773 ¹
Clase ZFH	11,9648 ²	12,0143 ²	9,1823 ²
Clase ZG	26,9947	26,9156	20,4444
Clase ZGP	10,7776	11,0735	8,6352
Clase ZUH	10,9752 ³	10,8824 ³	10,3032 ³
Clase 3EH	1,7608 ¹	1,7651 ¹	1,3466 ¹
Clase 3FH	1,8918 ²	1,8962 ²	–
Clase 3UH	2,1863 ³	2,1639 ³	1,6280 ³
Clase 9EH	10,5479 ¹	10,5716 ¹	8,0642 ¹
Clase 9EP	9,9562 ¹	10,1260 ¹	7,5850 ¹
Clase 9FH	10,5292 ²	10,5498 ²	8,0444 ²
Clase 9G	10,1044	10,0527	7,6191
Clase 9UH	11,2422 ³	11,1280 ³	8,3708 ³

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el GBP.

² La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el GBP.

³ La clase está denominada en USD. La divisa base de la Cartera es el GBP.

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 GBP
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	229.358.950
Efectivo en el banco	2	2.223.706
Suscripciones por cobrar		990.960
Interés y dividendos por cobrar, neto		753.647
Otros activos		835
Total de activos		233.328.098
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(423.461)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(91.711)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(141.181)
Otros pasivos		(40.445)
Total de pasivos		(696.798)
Total de patrimonio neto		232.631.300

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	2.301.698,636
Clase AEC	76.812,853
Clase AEH	161.069,583
Clase AG	652.629,576
Clase ASC	133,600
Clase AUC	596.048,094
Clase DE	6.446,693
Clase DEC	12.739,967
Clase DEH	4.780,573
Clase DG	65.805,590
Clase DGP	401,659
Clase IE	2.475.935,150
Clase IEH	235.253,572
Clase IG	252.123,585
Clase IGP	1.290.206,180
Clase IU	462.184,559
Clase IUH	80,000
Clase LG	324.460,364
Clase LGP	10.488.137,635
Clase ZE	23.944,120
Clase ZEH	25.641,600
Clase ZFH	10.046,000
Clase ZG	196.890,795
Clase ZGP	125.949,927
Clase ZUH	121.342,889
Clase 1EH	224.001,179
Clase 1FH	29.291,102
Clase 1UH	97.083,387
Clase 3EH	103.003,293
Clase 3FH	40.290,742
Clase 3UH	267.910,899
Clase 9EH	42.173,000
Clase 9FH	81,000
Clase 9G	811.054,244
Clase 9UH	2.174,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 GBP
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		203.529.182
Ingresos		
Dividendos, neto	2	7.512.818
Interés bancario	2	751
Total de ingresos		7.513.569
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.705.648)
Interés bancario	2	(44)
Gastos operativos	3, 5	(488.332)
Total de gastos		(2.194.024)
Ingresos netos de inversiones		5.319.545
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		1.659.849
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		203.793
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(33.323)
Ganancia neta realizada		1.830.319
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		12.938.288
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		7.525
Cambio neto en ganancia no realizada		12.945.813
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		20.095.677
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		115.377.001
Reembolsos de acciones		(102.326.922)
Dividendos	7	(4.043.638)
Total de movimientos de capital		9.006.441
Patrimonio neto al final del ejercicio		232.631.300

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
GBP	232.631.300	203.529.182	149.344.890

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	12,6812 ¹	11,6608 ¹	8,7982 ¹
Clase AEC	9,6686 ¹	9,3261 ¹	7,5630 ¹
Clase AEH	11,5877 ¹	10,8296 ¹	8,5501 ¹
Clase AG	12,1852	11,2947	8,8527
Clase ASC	10,1013 ²	9,6533 ²	7,8020 ²
Clase AUC	10,6068 ³	10,1151 ³	8,1166 ³
Clase DE	12,1725 ¹	11,2772 ¹	8,5721 ¹
Clase DEC	9,2267 ¹	8,9790 ¹	7,3487 ¹
Clase DEH	11,1182 ¹	10,4678 ¹	8,3235 ¹
Clase DG	11,6992	10,9259	8,6278
Clase DGP	10,0965	9,7473	7,9234
Clase IE	13,3535 ¹	12,1630 ¹	9,0906 ¹
Clase IEH	12,1998 ¹	11,2958 ¹	8,8310 ¹
Clase IG	12,8573	11,8052	9,1656
Clase IGP	10,7015	10,1383	8,0999
Clase IU	13,2640 ³	12,7617 ³	8,9046 ³
Clase IUH	13,0077 ³	11,8874 ³	9,1572 ³
Clase LG	12,9575	11,8792	9,2094
Clase LGP	10,7649	10,1870	8,1168
Clase ZE	13,2156 ¹	12,0615 ¹	9,0335 ¹
Clase ZEH	12,0729 ¹	11,2040 ¹	8,7774 ¹
Clase ZFH	11,8925 ⁴	11,0386 ⁴	8,6609 ⁴
Clase ZG	12,7064	11,6899	9,0942
Clase ZGP	11,1107	10,5523	8,4466
Clase ZUH	13,3271 ³	12,2225 ³	9,5384 ³
Clase 1EH	11,4780 ¹	10,7111 ¹	8,4410 ¹
Clase 1FH	11,4101 ⁴	10,6537 ⁴	8,4075 ⁴
Clase 1UH	12,2298 ³	11,2829 ³	8,7794 ³
Clase 3EH	11,7863 ¹	10,9193 ¹	8,5370 ¹
Clase 3FH	11,7136 ⁴	10,8540 ⁴	8,5004 ⁴
Clase 3UH	12,5625 ³	11,5019 ³	8,8809 ³
Clase 9EH	11,7980 ¹	10,9227 ¹	8,5371 ¹
Clase 9FH	11,7077 ⁴	10,8516 ⁴	8,4985 ⁴
Clase 9G	11,4924	10,5508	8,1909
Clase 9UH	12,5653 ³	11,4992 ³	8,8800 ³

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el GBP.

² La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el GBP.

³ La clase está denominada en USD. La divisa base de la Cartera es el GBP.

⁴ La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el GBP.

Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Efectivo en el banco	2	1.559.505
Interés y dividendos por cobrar, neto		14
Otros activos		21.106
Total de activos		1.580.625
Pasivos		
Otros pasivos		(470)
Total de pasivos		(470)
Total de patrimonio neto		1.580.155

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IU	398.459,064
Clase ZU	12.351,905

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase IU	3,8464	3,8047	2,9775
Clase ZU	3,8469	3,8053	2,9779

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		6.857.182
Ingresos		
Dividendos, neto	2	96.488
Interés bancario	2	113
Otros ingresos		21.106
Total de ingresos		117.707
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(17.778)
Interés bancario	2	(3)
Gastos operativos	3, 5	(10.558)
Total de gastos		(28.339)
Ingresos netos de inversiones		89.368
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(610.247)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(2.311)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(42.745)
(Pérdida) neta realizada		(655.303)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		814.708
Cambio neto en ganancia no realizada		814.708
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		248.773
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		14.466
Reembolsos de acciones		(5.540.266)
Total de movimientos de capital		(5.525.800)
Patrimonio neto al final del ejercicio		1.580.155

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	1.580.155	6.857.182	5.920.259

* Consulte la nota 1.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	23.271.668
Efectivo en el banco	2	2.304.542
Suscripciones por cobrar		37.929
Interés por cobrar en swaps	2	882
Interés y dividendos por cobrar, neto		9.577
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	218.622
Otros activos		26
Total de activos		25.843.246
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(32.401)
Dividendo pagadero en swaps	2	(20.934)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(140.624)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(894.660)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(9.251)
Otros pasivos		(3.891)
Total de pasivos		(1.101.761)
Total de patrimonio neto		24.741.485

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	48.677,463
Clase AFH	764,000
Clase AGH	1.191,640
Clase AU	104.795,388
Clase DEH	6.140,089
Clase DU	74.292,501
Clase IEH	113.122,400
Clase IGH	79.194,611
Clase IU	39.866,488
Clase XGH	1.013.084,972
Clase ZE	80,000
Clase ZEH	83,000
Clase ZGH	1.832,931
Clase ZU	100,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	15,5801 ¹	15,3714 ¹	14,9909 ¹
Clase AFH	14,1612 ²	13,9949 ²	13,6841 ²
Clase AGH	16,7573 ³	16,4018 ³	15,9091 ³
Clase AU	17,6966	17,2872	16,6795
Clase DEH	12,0140 ¹	11,9135 ¹	11,6756 ¹
Clase DU	13,5433	13,2965	12,8939
Clase IEH	22,7694 ¹	22,2720 ¹	21,5363 ¹
Clase IGH	24,2352 ³	23,5814 ³	22,6795 ³
Clase IU	25,5384	24,8005	23,7275
Clase XGH	10,8426 ³	10,4372 ³	9,9603 ³
Clase ZE	11,0174 ¹	10,1161 ¹	10,3731 ¹
Clase ZEH	9,9289 ¹	9,7263 ¹	9,4119 ¹
Clase ZGH	16,6367 ³	16,1525 ³	15,5508 ³
Clase ZU	10,6198	10,3329	9,8971

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.² La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.³ La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		103.961.830
Ingresos		
Dividendos, neto	2	168.950
Interés bancario	2	1.353
Ingresos por intereses en swaps		11.715
Otros ingresos		461.019
Total de ingresos		643.037
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(101.684)
Comisiones de rendimiento	8	(10.424)
Interés bancario	2	(179)
Dividendos pagados en swaps		(167.029)
Gastos por intereses en swaps		(40.735)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(13.424)
Gastos operativos	3, 5	(60.007)
Total de gastos		(393.482)
Ingresos netos de inversiones		249.555
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		29.489.180
Ganancia neta realizada en swaps		391.197
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		927.331
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(2.291.352)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(465.699)
Ganancia neta realizada		28.050.657
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(25.722.032)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		210.410
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		500.269
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(474.322)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(25.485.675)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		2.814.537
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		4.740.225
Reembolsos de acciones		(86.775.107)
Total de movimientos de capital		(82.034.882)
Patrimonio neto al final del ejercicio		24.741.485

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

USD	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
	24.741.485	103.961.830	180.468.553

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	927.040.046
Efectivo en el banco	2	24.642.662
Depósitos a plazo	2, 19	22.045.718
Por cobrar para la venta de inversiones		4.523.125
Suscripciones por cobrar		343.208
Interés por cobrar en swaps	2	503.657
Interés y dividendos por cobrar, neto		10.249.985
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	4.507.807
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	16.594.551
Otros activos		4.285
Total de activos		1.010.455.044
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(7.313.599)
Reembolsos pagaderos		(790.226)
Interés pagadero en swaps	2	(1.063.067)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(19.848.526)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(485.942)
Otros pasivos		(74.611)
Total de pasivos		(29.575.971)
Total de patrimonio neto		980.879.073

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	85,000
Clase IE	85,000
Clase ZE	81.677,475
Clase 1E	12.550.279,486
Clase 1EP	59.691,343
Clase 1GH	172.168,325
Clase 1UH	196.850,647
Clase 2E	53.447.204,987
Clase 2EP	58.548,305
Clase 2GC	76,000
Clase 2GH	8.804,776
Clase 4GH	242.001,138
Clase 8E	29.498.264,817
Clase 8EP	121.516,811
Clase 8GC	37.093,763
Clase 8GH	906.353,358

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		1.105.181.704
Ingresos		
Dividendos, neto	2	5.646
Interés sobre bonos, neto	2	35.780.406
Interés bancario	2	1.519
Ingresos por intereses en swaps		1.825.906
Total de ingresos		37.613.477
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(6.394.014)
Interés bancario	2	(645.048)
Gastos por intereses en swaps		(22.073.515)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(606.452)
Gastos operativos	3, 5	(968.217)
Total de gastos		(30.687.246)
Ingresos netos de inversiones		6.926.231
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(1.581.060)
(Pérdida) neta realizada en swaps		(2.715.833)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(19.481.745)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		7.967.788
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(2.337.453)
(Pérdida) neta realizada		(18.148.303)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(50.711.806)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		18.829.453
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		7.681.966
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		12.813.307
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(11.387.080)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(22.609.152)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		266.552.665
Reembolsos de acciones		(368.158.596)
Dividendos	7	(87.548)
Total de movimientos de capital		(101.693.479)
Patrimonio neto al final del ejercicio		980.879.073

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	980.879.073	1.105.181.704	1.551.456.289

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE [‡]	9,7720	—	—
Clase IE [‡]	9,8024	—	—
Clase ZE	9,9967	10,2122	9,3241
Clase 1E	9,8622	10,1181	9,2723
Clase 1EP	8,7147	9,2533	8,7619
Clase 1GH	10,1307 ¹	10,3276 ¹	9,4190 ¹
Clase 1UH	10,4460 ²	10,6393 ²	9,6685 ²
Clase 2E	10,0810	10,2797	9,3632
Clase 2EP	8,8919	9,3705	8,8321
Clase 2GC	9,1211 ¹	9,5453 ¹	8,9432 ¹
Clase 2GH	10,3563 ¹	10,4925 ¹	9,5119 ¹
Clase 4GH	10,5443 ¹	10,6305 ¹	9,5888 ¹
Clase 8E	10,0626	10,2650	9,3536
Clase 8EP	8,8993	9,3952	8,8706
Clase 8GC	9,1415 ¹	9,5801 ¹	8,9861 ¹
Clase 8GH	10,3438 ¹	10,4843 ¹	9,5069 ¹

¹ La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el EUR.

² La clase está denominada en USD. La divisa base de la Cartera es el EUR.

[‡] Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	41.612.044
Efectivo en el banco	2	1.994.512
Por cobrar para la venta de inversiones		695.676
Interés por cobrar en swaps	2	17.452
Interés y dividendos por cobrar, neto		392.264
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	1.031.021
Otros activos		11.153
Total de activos		45.754.122
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(669.403)
Interés pagadero en swaps	2	(32.914)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(22.268)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(394.002)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.081)
Otros pasivos		(6.050)
Total de pasivos		(1.125.718)
Total de patrimonio neto		44.628.404

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	374,659
Clase AFH	92,200
Clase AKH	84,000
Clase ANH	830,000
Clase AUH	92,000
Clase DE	17.592,059
Clase IE	283.028,942
Clase IEP	89,999
Clase IGH	67,800
Clase INH	826,000
Clase IU	92,000
Clase IUH	90,000
Clase JE	80,997
Clase JGH	67,800
Clase JUH	91,000
Clase LE	9.581,001
Clase LEP	89,320
Clase LGH	67,800
Clase XE	305.450,604
Clase XGH	3.137.880,322
Clase XUH	92,000
Clase YE	82,001
Clase YGH	68,800
Clase YUH	91,000
Clase ZE	81,997
Clase ZFH	90,200
Clase ZGH	67,800
Clase ZUH	91,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		53.361.804
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	1.311.801
Interés bancario	2	337
Ingresos por intereses en swaps		101.624
Otros ingresos		16
Total de ingresos		1.413.778
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(13.357)
Interés bancario	2	(27.828)
Gastos por intereses en swaps		(795.220)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(9.993)
Gastos operativos	3, 5	(83.684)
Total de gastos		(930.082)
Ingresos netos de inversiones		483.696
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		122.149
(Pérdida) neta realizada en swaps		(420.291)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		316.072
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		608.022
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(15.182)
Ganancia neta realizada		610.770
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(2.765.999)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		1.048.387
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(371.290)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		740.167
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(1.348.735)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(254.269)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		3.362.176
Reembolsos de acciones		(11.841.263)
Dividendos	7	(44)
Total de movimientos de capital		(8.479.131)
Patrimonio neto al final del ejercicio		44.628.404

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	44.628.404	53.361.804	65.678.771

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	9,9429	10,2349	9,4969
Clase AFH	9,8101 ¹	10,1268 ¹	9,4156 ¹
Clase AKH	99,6323 ²	102,3358 ²	94,6358 ²
Clase ANH	10,1446 ³	10,3661 ³	9,5560 ³
Clase AUH	10,6635 ⁴	10,8977 ⁴	10,0302 ⁴
Clase DE	9,7208	10,0608	9,3822
Clase IE	10,2044	10,4353	9,6157
Clase IEP	9,0524	9,4983	9,0726
Clase IGH	10,5320 ⁵	10,6920 ⁵	9,8133 ⁵
Clase INH	10,2572 ³	10,4013 ³	9,5374 ³
Clase IU	10,0660 ⁴	10,8726 ⁴	9,3587 ⁴
Clase IUH	10,9297 ⁴	11,0910 ⁴	10,1441 ⁴
Clase JE	10,1884	10,4159	9,6164
Clase JGH	10,5456 ⁵	10,6939 ⁵	9,8127 ⁵
Clase JUH	10,8783 ⁴	11,0321 ⁴	10,1046 ⁴
Clase LE	10,2635	10,4800	9,6450
Clase LEP	9,1580	9,5877	9,1359
Clase LGH	10,6048 ⁵	10,7382 ⁵	9,8349 ⁵
Clase XE	10,5895	10,7859	–
Clase XGH	10,2913 ⁵	10,4148 ⁵	9,5116 ⁵
Clase XUH	10,7628 ⁴	10,8737 ⁴	–
Clase YE	10,1443	10,3910	9,5989
Clase YGH	10,4650 ⁵	10,6432 ⁵	9,7812 ⁵
Clase YUH	10,8066 ⁴	10,9872 ⁴	10,0801 ⁴
Clase ZE	10,1272	10,3835	9,5865
Clase ZFH	9,9880 ¹	10,2620 ¹	9,4998 ¹
Clase ZGH	10,4758 ⁵	10,6642 ⁵	9,7911 ⁵
Clase ZUH	10,8614 ⁴	11,0490 ⁴	10,1215 ⁴

¹ La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el EUR.

² La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el EUR.

³ La clase está denominada en NOK. La divisa base de la Cartera es el EUR.

⁴ La clase está denominada en USD. La divisa base de la Cartera es el EUR.

⁵ La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el EUR.

Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	120.954.454
Efectivo en el banco	2	2.724.513
Suscripciones por cobrar		29.207
Interés por cobrar en swaps	2	2.769.351
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	947
Otros activos		124.813
Total de activos		126.603.285
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(94.734)
Interés pagadero en swaps	2	(1.684.080)
Dividendo pagadero en swaps	2	(798.926)
Interés pagadero bancario		(3.931)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(47.003)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(107.778)
Otros pasivos		(27.757)
Total de pasivos		(2.764.209)
Total de patrimonio neto		123.839.076

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	2.285.948,793
Clase AEP	28.384,783
Clase AUH	2.007,000
Clase DE	2.318.243,552
Clase IE	2.599.445,200
Clase IGH	17.209,797
Clase LE	1.493.004,591
Clase XGH	783.616,969
Clase ZE	226.874,173
Clase ZF	76,000
Clase ZFH	6.377,000
Clase ZGH	57,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	12,1389	11,9823	11,8815
Clase AEP	12,3867	12,3580	12,2004
Clase AUH	13,1642 ¹	12,8933 ¹	12,6049 ¹
Clase DE	11,7798	11,7839	11,6749
Clase IE	12,6164	12,5007	12,2490
Clase IGH	12,9699 ²	12,7513 ²	12,4217 ²
Clase LE	12,8174	12,6752	12,3472
Clase XGH	14,3002 ²	13,8662 ²	13,3602 ²
Clase ZE	12,6671	12,5092	12,2555
Clase ZF	11,5379 ³	12,2367 ³	11,4828 ³
Clase ZFH	11,9019 ³	11,8267 ³	11,6341 ³
Clase ZGH	13,1142 ²	12,7204 ²	12,3878 ²

¹ La clase está denominada en USD. La divisa base de la Cartera es el EUR.² La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el EUR.³ La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el EUR.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		235.387.755
Ingresos		
Dividendos, neto	2	3.002.152
Interés bancario	2	2.503
Ingresos por intereses en swaps		69.426
Otros ingresos		236.518
Total de ingresos		3.310.599
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.664.853)
Comisiones de rendimiento	8	(650.870)
Interés bancario	2	(40.013)
Dividendos pagados en swaps		(2.785.573)
Gastos por intereses en swaps		(882.355)
Gastos operativos	3, 5	(430.584)
Total de gastos		(6.454.248)
(Pérdida) neta de inversiones		(3.143.649)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		34.866.611
(Pérdida) neta realizada en swaps		(8.777.916)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		562.354
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(196.715)
Ganancia neta realizada		26.454.334
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(19.964.207)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		2.175.281
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(888.134)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(18.677.060)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		4.633.625
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		63.347.675
Reembolsos de acciones		(179.528.760)
Dividendos	7	(1.219)
Total de movimientos de capital		(116.182.304)
Patrimonio neto al final del ejercicio		123.839.076

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	123.839.076	235.387.755	145.122.405

Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	123.021.949
Efectivo en el banco	2	3.106.415
Suscripciones por cobrar		47.606
Interés y dividendos por cobrar, neto		40.870
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	25.457
Otros activos		5
Total de activos		126.242.302
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(240.126)
Reembolsos pagaderos		(96.019)
Interés pagadero en swaps	2	(2.933)
Dividendo pagadero en swaps	2	(16.672)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(530.036)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(139.685)
Otros pasivos		(18.386)
Total de pasivos		(1.043.857)
Total de patrimonio neto		125.198.445

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	573,326
Clase AU	1.878,961
Clase DEH	219,748
Clase DU	30.219,037
Clase IU	202.738,502
Clase ZU	57,000
Clase 1E	3.457.515,996
Clase 1EH	365.391,742
Clase 1U	7.051.234,817
Clase 2E	49,000
Clase 2U	186,000
Clase 3U	45.196,000
Clase 8E	304.516,502
Clase 8U	2.052.290,097
Clase 9U	56,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	16,4272 ¹	14,7944 ¹	9,6105 ¹
Clase AU	17,4066	15,4832	9,9317
Clase DEH	16,1610 ¹	14,6365 ¹	9,5551 ¹
Clase DU	17,1211	15,3058	9,8657
Clase IU	17,9132	15,7911	10,0392
Clase ZU	17,8411	15,7432	10,0184
Clase 1E	8,1204 ¹	6,8306 ¹	4,6882 ¹
Clase 1EH	5,9805 ¹	5,3803 ¹	3,4943 ¹
Clase 1U	9,0336	8,0266	5,1432
Clase 2E	18,3931 ¹	15,3339 ¹	10,4354 ¹
Clase 2U	17,9863	15,8326	10,0509
Clase 3U	5,1096	4,5061	2,8659
Clase 8E	8,9701 ¹	7,4837 ¹	5,0947 ¹
Clase 8U	9,9191	8,7414	5,5557
Clase 9U	17,9452	15,8025	10,0466

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		112.622.890
Ingresos		
Dividendos, neto	2	727.808
Interés bancario	2	513
Ingresos por intereses en swaps		24.066
Total de ingresos		752.387
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.603.305)
Interés bancario	2	(121)
Dividendos pagados en swaps		(127.712)
Gastos por intereses en swaps		(241.566)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(1.474)
Gastos operativos	3, 5	(211.328)
Total de gastos		(2.185.506)
(Pérdida) neta de inversiones		(1.433.119)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		36.575.786
Ganancia neta realizada en swaps		2.343.050
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(254.883)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(14.619)
Ganancia neta realizada		38.649.334
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(22.959.388)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(431.043)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		83.848
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(23.306.583)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		13.909.632
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		31.151.939
Reembolsos de acciones		(32.486.016)
Total de movimientos de capital		(1.334.077)
Patrimonio neto al final del ejercicio		125.198.445

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	125.198.445	112.622.890	107.950.260

Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	85.756.625
Efectivo en el banco	2	3.966.191
Depósitos a plazo	2, 19	6.001.631
Por cobrar para la venta de inversiones		2.154.642
Suscripciones por cobrar		41.733
Interés por cobrar en swaps	2	4.839
Interés y dividendos por cobrar, neto		174.699
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	14.339
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	1.865.712
Otros activos		45.733
Total de activos		100.026.144
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(600.459)
Reembolsos pagaderos		(48.238)
Interés pagadero en swaps	2	(75.760)
Dividendo pagadero en swaps	2	(40.810)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(118.226)
Otros pasivos		(15.347)
Total de pasivos		(898.840)
Total de patrimonio neto		99.127.304

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	69.693,942
Clase AU	17.894,673
Clase DEH	15.040,656
Clase DU	618,597
Clase IU	208.389,000
Clase ZU	58,000
Clase 1E	14.787.097,762
Clase 1U	924.780,204
Clase 2E	52,000
Clase 2U	1.214,250
Clase 8E	208.344,215
Clase 8U	202.845,119

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	14,5886 ¹	15,0223 ¹	10,3913 ¹
Clase AU	15,4367	15,6740	10,7050
Clase DEH	14,4782 ¹	14,9762 ¹	10,4242 ¹
Clase DU	15,2753	15,5884	10,6942
Clase IU	16,0451	16,1456	10,9288
Clase ZU	15,8776	15,9900	10,8327
Clase 1E	5,2295 ¹	5,0213 ¹	3,6694 ¹
Clase 1U	5,8275	5,9106	4,0324
Clase 2E	16,3297 ¹	15,5305 ¹	11,2523 ¹
Clase 2U	15,9419	16,0307	10,8434
Clase 8E	5,8070 ¹	5,5302 ¹	4,0084 ¹
Clase 8U	6,5431	6,5821	4,4540

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		209.555.266
Ingresos		
Dividendos, neto	2	868.157
Interés bancario	2	2.973
Ingresos por intereses en swaps		64.043
Total de ingresos		935.173
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.793.772)
Interés bancario	2	(920)
Dividendos pagados en swaps		(282.048)
Gastos por intereses en swaps		(418.876)
Gastos operativos	3, 5	(232.688)
Total de gastos		(2.728.304)
(Pérdida) neta de inversiones		(1.793.131)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		38.877.425
Ganancia neta realizada en swaps		2.548.639
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(274.739)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(24.307)
Ganancia neta realizada		41.127.018
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(36.814.864)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		1.378.985
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		56.037
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(35.379.842)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		3.954.045
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		10.897.165
Reembolsos de acciones		(125.279.172)
Total de movimientos de capital		(114.382.007)
Patrimonio neto al final del ejercicio		99.127.304

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

USD	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
	99.127.304	209.555.266	163.281.752

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	509.285.871
Efectivo en el banco	2	18.384.421
Por cobrar para la venta de inversiones		106.992.835
Suscripciones por cobrar		3.832.326
Interés y dividendos por cobrar, neto		2.927
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	1.206.919
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	17.857.131
Otros activos		6.549
Total de activos		657.568.979
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(107.327.904)
Reembolsos pagaderos		(2.919.498)
Interés pagadero en swaps	2	(38.637)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(122.260)
Otros pasivos		(75.947)
Total de pasivos		(110.484.246)
Total de patrimonio neto		547.084.733

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	309.845,928
Clase AFH	230.991,729
Clase AGH	77.463,636
Clase ASH	2.408.777,989
Clase AU	1.972.778,299
Clase DEH	198.616,812
Clase DU	631.463,177
Clase IEH	411.970,554
Clase IG	64,000
Clase IGH	3.037.876,866
Clase IU	628.133,021
Clase NG	87.673,069
Clase XU	16.497.669,269
Clase ZEH	26.682,627
Clase ZFH	160,000
Clase ZGH	475.194,725
Clase ZU	156.990,605

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		528.893.598
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	206.387
Interés bancario	2	7.235
Ingresos por intereses en swaps		11.022
Total de ingresos		224.644
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.585.265)
Interés bancario	2	(3.612)
Gastos por intereses en swaps		(844.106)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(130)
Gastos operativos	3, 5	(810.073)
Total de gastos		(3.243.186)
(Pérdida) neta de inversiones		(3.018.542)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(2.916)
Ganancia neta realizada en swaps		165.226.083
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(6.954.576)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		315.210
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(109.769)
Ganancia neta realizada		158.474.032
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		305.638
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		31.742.204
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		1.598.080
Cambio neto en ganancia no realizada		33.645.922
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		189.101.412
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		243.291.141
Reembolsos de acciones		(414.201.418)
Total de movimientos de capital		(170.910.277)
Patrimonio neto al final del ejercicio		547.084.733

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	547.084.733	528.893.598	292.751.295

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	12,2529 ¹	8,4906 ¹	6,3865 ¹
Clase AFH	9,0157 ²	6,2739 ²	4,7274 ²
Clase AGH	13,1736 ³	9,0951 ³	6,8077 ³
Clase ASH	6,9266 ⁴	4,7702 ⁴	3,5575 ⁴
Clase AU	14,5604	10,0129	7,4279
Clase DEH	9,2625 ¹	6,4457 ¹	4,8729 ¹
Clase DU	11,0114	7,6039	5,6690
Clase IEH	18,1687 ¹	12,4903 ¹	9,2968 ¹
Clase IG	15,4257 ³	10,0476 ³	8,2193 ³
Clase IGH	19,4921 ³	13,3493 ³	9,8874 ³
Clase IU	21,5661	14,7124	10,8005
Clase NG	14,9110 ³	9,6735 ³	7,8743 ³
Clase XU	22,9751	15,5436	11,3145
Clase ZEH	7,6710 ¹	5,2751 ¹	3,9285 ¹
Clase ZFH	7,3902 ²	5,1075 ²	3,8109 ²
Clase ZGH	11,1531 ³	7,6437 ³	5,6644 ³
Clase ZU	8,8906	6,0682	4,4569

¹ La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.

² La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.

³ La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.

⁴ La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
AUSTRALIA				DINAMARCA					
EUR	2.106.000	APT Pipelines Limited 1.25% 15/03/2033	2.060.376	0,40	EUR	476.000	Danske Bank AS FRN 15/05/2031	499.710	0,10
USD	1.508.000	Ausgrid Finance Pty Limited 4.35% 01/08/2028	1.540.915	0,30			Total de Dinamarca	499.710	0,10
EUR	1.072.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	1.192.266	0,23					
USD	2.215.000	SGSP Australia Assets Pty 3.50% 07/07/2027	2.213.536	0,43					
		Total de Australia	7.007.093	1,36					
BÉLGICA				FINLANDIA					
EUR	835.000	Anheuser-Busch InBev SA 3.70% 02/04/2040	1.120.120	0,22	EUR	946.000	Nordea Bank Abp 0.50% 14/05/2027	1.014.027	0,20
EUR	250.000	Anheuser-Busch InBev SA 3.70% 02/04/2040	335.365	0,07	EUR	3.895.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	4.019.674	0,78
		Total de Bélgica	1.455.485	0,29			Total de Finlandia	5.033.701	0,98
BERMUDAS				FRANCIA					
USD	1.922.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	2.154.889	0,42	EUR	2.900.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.25% 29/06/2028	2.980.919	0,58
		Total de Bermudas	2.154.889	0,42	EUR	600.000	BPCE SA 0.25% 14/01/2031	589.933	0,12
CANADÁ				ALEMANIA					
USD	1.102.000	Canadian Pacific Railway Company 3.10% 02/12/2051	980.000	0,20	EUR	1.000.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	1.045.444	0,20
USD	450.000	Rogers Communications Inc. 3.70% 15/11/2049	406.249	0,08	EUR	3.200.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	2.995.555	0,58
		Total de Canadá	1.386.249	0,28	EUR	1.000.000	Commerzbank AG FRN 29/12/2031	1.004.795	0,20
ISLAS CAIMÁN				FRANCIA (continuación)					
USD	732.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	684.091	0,13	EUR	2.200.000	Credit Agricole SA FRN 21/09/2029	1.738.180	0,34
GBP	3.580.000	Southern Water Services Limited 1.63% 30/03/2027	4.483.485	0,87	EUR	2.200.000	Electricite de France SA Perp FRN	2.198.905	0,43
GBP	2.804.000	Southern Water Services Limited 2.38% 28/05/2028	3.608.946	0,70	EUR	2.035.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	1.960.523	0,38
GBP	560.000	Southern Water Services Limited 3.00% 28/05/2037	712.060	0,14	EUR	1.200.000	Holding d'infrastructures de Transport SASU 1.48% 18/01/2031	1.263.446	0,25
USD	566.000	Tencent Holdings Limited 3.24% 03/06/2050	443.045	0,09	EUR	900.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 0.63% 08/07/2032	905.854	0,18
USD	1.008.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	986.933	0,19	EUR	1.000.000	Sanef SA 1.88% 16/03/2026	1.118.103	0,22
USD	1.000.000	Tencent Holdings Limited 3.93% 19/01/2038	927.472	0,18			Total de Francia	14.877.901	2,91
		Total de Islas Caimán	11.846.032	2,30					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ALEMANIA (continuación)				JERSEY - ISLAS DEL CANAL					
EUR	349.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	385.859	0,08	USD	1.447.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	1.303.078	0,25
EUR	1.400.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	1.329.929	0,26	USD	2.364.160	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.94% 30/09/2040	2.147.200	0,42
EUR	491.000	Volkswagen Financial Services AG 3.38% 06/04/2028	584.543	0,11	EUR	1.176.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	1.189.217	0,23
EUR	1.100.000	Vonovia SE 1.50% 14/06/2041	1.005.875	0,20	EUR	300.000	Heathrow Funding Limited 1.88% 14/03/2034	307.936	0,06
Total de Alemania			16.654.161	3,24	Total de Jersey - Islas del Canal			4.947.431	0,96
INDIA				LUXEMBURGO					
USD	1.830.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	1.764.842	0,33	EUR	1.600.000	Aroundtown SA 0.00% 16/07/2026	1.628.199	0,32
USD	1.380.000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	1.265.561	0,25	EUR	2.900.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	2.947.127	0,57
Total de India			3.030.403	0,58	EUR	1.000.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	1.039.031	0,20
IRLANDA				PAÍSES BAJOS					
EUR	2.330.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	2.535.515	0,49	EUR	302.000	Airbus SE 2.38% 09/06/2040	343.491	0,07
EUR	900.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	989.542	0,19	EUR	746.000	Akelius Residential Property Financing BV 0.75% 22/02/2030	712.661	0,14
EUR	1.482.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	1.531.356	0,30	EUR	1.036.000	Akelius Residential Property Financing BV 1.13% 11/01/2029	1.042.836	0,20
EUR	1.350.000	Eaton Capital Unlimi 0.58% 08/03/2030	1.379.481	0,27	EUR	1.020.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	1.046.543	0,20
EUR	2.057.000	Experian Europe DAC 1.56% 16/05/2031	2.249.896	0,44	Total de Países Bajos				
Total de Irlanda			8.685.790	1,69	Total de Países Bajos				
ITALIA				MÉXICO					
EUR	427.000	Aeroporti di Roma SpA 1.63% 02/02/2029	451.242	0,09	EUR	700.000	Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	723.475	0,14
EUR	598.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	610.142	0,12	Total de México			723.475	0,14
EUR	950.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 26/09/2029	999.439	0,19					
EUR	801.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	867.662	0,17					
EUR	1.284.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	1.343.218	0,26					
EUR	749.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	758.732	0,15					
EUR	673.000	Eni SpA Perp FRN	717.074	0,14					
EUR	663.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	704.225	0,14					
Total de Italia			6.451.734	1,26					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
PAÍSES BAJOS (continuación)				SUIZA (continuación)					
EUR	1.193.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	1.167.706	0,23	USD	330.000	Credit Suisse Group AG Perp FRN	342.427	0,07
GBP	2.114.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	3.467.624	0,68	EUR	2.497.000	UBS AG 0.50% 31/03/2031	2.531.367	0,49
EUR	1.127.000	Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	1.168.644	0,23	USD	623.000	UBS AG 5.13% 15/05/2024	638.158	0,12
EUR	1.300.000	Iberdrola International BV Perp FRN	1.317.350	0,26	USD	530.000	UBS Group AG Perp FRN	533.986	0,10
EUR	2.000.000	ING Groep NV FRN 16/02/2031	2.188.349	0,43	USD	900.000	UBS Group AG Perp FRN	956.942	0,20
USD	1.025.000	ING Groep NV FRN 28/03/2033	1.054.838	0,21	USD	768.000	UBS Group Funding Switzerland AG Perp FRN	803.426	0,16
EUR	850.000	Sagax Euro MTN BV 0.75% 26/01/2028	831.103	0,16	Total de Suiza			12.207.628	2,38
GBP	820.000	Shell International Finance BV 1.75% 10/09/2052	785.385	0,15	REINO UNIDO				
EUR	3.300.000	Stedin Holding NV Perp FRN	3.540.783	0,69	USD	491.000	Anglo American Capital plc 4.75% 16/03/2052	513.809	0,10
EUR	1.000.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	965.052	0,19	USD	3.779.000	BAE Systems plc 3.40% 15/04/2030	3.732.219	0,73
EUR	500.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	577.211	0,11	USD	2.257.000	Barclays plc FRN 24/11/2032	2.047.879	0,40
EUR	3.883.000	Tennet Holding BV Perp FRN	4.337.819	0,84	GBP	1.680.000	BAT International Finance plc 2.25% 26/06/2028	1.998.343	0,39
EUR	2.297.000	Thermo Fisher Scientific Finance BV 1.63% 18/10/2041	2.303.025	0,45	USD	2.001.000	Bp Capital Markets plc Perp FRN	2.017.224	0,39
EUR	2.100.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	2.207.340	0,43	EUR	1.443.000	BP Capital Markets plc Perp FRN	1.612.722	0,31
EUR	1.600.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	2.134.595	0,42	EUR	2.459.000	British American Tobacco plc Perp FRN	2.497.289	0,48
Total de Paises Bajos			31.192.355	6,09	GBP	750.000	Broadgate Financing plc 5.00% 05/10/2031	1.084.564	0,21
ESPAÑA					GBP	479.716	Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	702.307	0,14
EUR	1.300.000	Merlin Properties Socimi SA 1.38% 01/06/2030	1.275.381	0,25	EUR	2.591.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	2.611.364	0,51
EUR	309.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	342.807	0,07	EUR	507.000	Cadent Finance plc 0.75% 11/03/2032	501.028	0,10
Total de España			1.618.188	0,32	GBP	1.626.000	Ds Smith plc 2.88% 26/07/2029	2.097.626	0,41
SUECIA					GBP	425.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	566.719	0,11
EUR	2.254.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	2.353.992	0,46	EUR	424.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	500.297	0,10
EUR	573.000	Sagax AB 2.00% 17/01/2024	644.595	0,13	EUR	28.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	33.039	0,01
Total de Suecia			2.998.587	0,59	GBP	1.398.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	2.171.663	0,42
SUIZA					GBP	950.000	HSBC Holdings plc FRN 24/07/2027	1.178.857	0,23
EUR	1.714.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	1.716.567	0,33	USD	931.000	HSBC Holdings plc FRN 22/11/2032	848.051	0,17
USD	4.104.000	Credit Suisse Group AG FRN 14/05/2032	3.696.345	0,72	USD	850.000	Imperial Brands Finance plc 3.50% 26/07/2026	831.894	0,16
USD	1.000.000	Credit Suisse Group AG FRN 01/04/2031	988.410	0,19	GBP	453.000	Imperial Brands Finance plc 5.50% 28/09/2026	646.558	0,13

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
REINO UNIDO (continuación)				ESTADOS UNIDOS					
EUR	773.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	868.161	0,17	USD	2.982.000	AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	3.131.031	0,60
GBP	278.000	Legal & General Group plc FRN 01/11/2050	376.198	0,07	USD	1.217.000	AbbVie Inc. 4.88% 14/11/2048	1.388.042	0,27
GBP	520.000	Legal & General Group plc FRN 27/06/2064	754.679	0,15	USD	875.000	AEP Texas Inc. 3.45% 15/05/2051	781.144	0,15
GBP	2.070.000	Lloyds TSB Bank plc 7.63% 22/04/2025	3.075.711	0,60	USD	2.720.000	Amazon.com Inc. 3.10% 12/05/2051	2.566.773	0,50
EUR	867.000	Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	889.685	0,17	USD	1.265.000	Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	1.242.487	0,24
EUR	1.626.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	1.612.502	0,31	USD	1.805.000	Amgen Inc. 3.15% 21/02/2040	1.654.460	0,32
EUR	780.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	773.525	0,15	USD	481.000	Amgen Inc. 4.20% 22/02/2052	499.351	0,10
GBP	720.000	National Grid plc 3.50% 16/10/2026	982.249	0,19	USD	2.012.000	Anheuser-Busch Companies LLC 4.70% 01/02/2036	2.191.665	0,43
EUR	2.685.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	2.714.474	0,52	USD	540.000	Anheuser-Busch Companies LLC 4.90% 01/02/2046	602.301	0,12
USD	2.864.000	Nationwide Building Society 1.50% 13/10/2026	2.642.355	0,52	USD	2.274.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	2.659.093	0,51
EUR	1.758.000	Natwest Group plc FRN 26/02/2030	1.804.623	0,35	USD	1.306.000	Apple Inc. 2.65% 11/05/2050	1.140.304	0,22
USD	1.255.000	NatWest Group plc FRN 08/05/2030	1.289.318	0,25	EUR	854.000	Ardagh Metal Packaging 2.00% 01/09/2028	878.112	0,17
GBP	458.000	Natwest Group plc Perp FRN	597.025	0,12	USD	533.000	AT&T Inc. 3.10% 01/02/2043	462.491	0,09
EUR	2.505.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	2.608.235	0,51	USD	535.000	AT&T Inc. 3.50% 01/06/2041	493.690	0,10
GBP	683.000	Phoenix Group Holdings plc 5.63% 28/04/2031	984.864	0,19	USD	4.127.000	AT&T Inc. 3.50% 15/09/2053	3.660.307	0,70
GBP	270.000	Santander UK plc Perp 10.06%	625.206	0,12	CAD	1.500.000	AT&T Inc. 4.00% 25/11/2025	1.218.881	0,24
GBP	1.121.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	1.404.863	0,27	USD	1.997.000	AT&T Inc. 4.90% 15/08/2037	2.175.493	0,41
GBP	419.829	Tesco Property Finance plc 7.62% 13/07/2039	738.200	0,14	USD	1.350.000	Bank of America Corp. FRN 21/07/2032	1.199.748	0,23
GBP	1.208.680	Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	1.877.617	0,37	USD	1.617.000	Bank of America Corp. FRN 13/02/2031	1.488.215	0,29
GBP	489.325	Tesco Property Finance 6 plc 5.41% 13/07/2044	745.227	0,15	USD	1.933.000	Bank of America Corp. FRN 29/04/2031	1.787.415	0,35
GBP	1.120.000	Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	1.424.576	0,28	USD	6.226.000	Bank of America Corp. FRN 11/03/2032	5.720.679	1,13
EUR	2.798.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	2.959.136	0,58	USD	3.000.000	Bank of America Corp. FRN 04/02/2033	2.816.612	0,55
GBP	1.010.000	Virgin Money UK plc FRN 19/08/2031	1.254.529	0,24	USD	1.238.000	Bank of America Corp. FRN 23/07/2030	1.198.913	0,23
EUR	1.463.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	1.584.254	0,31	USD	1.500.000	Bayer US Finance II LLC 4.63% 25/06/2038	1.577.186	0,31
		Total de Reino Unido	62.780.664	12,23	USD	1.349.000	Becton Dickinson 4.69% 15/12/2044	1.458.165	0,28
					USD	844.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 4.25% 15/01/2049	921.433	0,18
					USD	2.011.000	Boeing Company 3.95% 01/08/2059	1.750.362	0,34
					USD	750.000	Boeing Company 5.93% 01/05/2060	872.380	0,17
					USD	693.000	Bristol-Myers Squibb Company 3.70% 15/03/2052	699.240	0,14

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	1.002.000	Broadcom Inc. 4.15% 15/11/2030	1.014.942	0,20	USD	1.750.000	General Motors Financial Company Inc. 2.40% 15/10/2028	1.573.264	0,31
USD	630.000	Broadcom Inc. 5.00% 15/04/2030	671.234	0,13	USD	491.000	Georgia Power Company 3.70% 30/01/2050	460.945	0,09
USD	2.376.000	Charter Communications Operating LLC 3.95% 30/06/2062	1.928.082	0,38	USD	489.000	Goodman USA Finance Three 3.70% 15/03/2028	489.431	0,10
USD	1.548.000	Chubb Ina Holdings Inc. 3.05% 15/12/2061	1.341.924	0,26	USD	1.000.000	Intel Corp. 3.05% 12/08/2051	901.468	0,18
USD	757.000	Cigna Corp. 4.90% 15/12/2048	854.603	0,17	USD	849.000	Intel Corp. 4.75% 25/03/2050	993.971	0,19
EUR	1.012.000	Citigroup Inc. FRN 06/07/2026	1.122.191	0,22	EUR	1.119.000	Iqvia Inc. 1.75% 15/03/2026	1.216.885	0,24
USD	3.020.000	Citigroup Inc. FRN 31/03/2031	3.143.039	0,61	EUR	400.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/01/2028	423.675	0,08
USD	343.000	Commonwealth Edison Company 4.00% 01/03/2049	358.752	0,07	EUR	330.000	Iqvia Inc. 2.88% 15/09/2025	369.548	0,07
USD	250.000	Conagra Brands Inc. 5.40% 01/11/2048	287.157	0,06	USD	1.710.000	JPMorgan Chase & Company FRN 04/02/2032	1.499.614	0,29
USD	303.000	Consolidated Edison Co of NY 3.95% 01/04/2050	313.818	0,06	USD	2.673.000	JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	2.438.738	0,48
USD	150.000	CSX Corp. 3.80% 01/11/2046	150.902	0,03	USD	5.249.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	4.813.050	0,95
USD	726.000	CSX Corp. 3.80% 15/04/2050	735.578	0,14	USD	1.358.000	JPMorgan Chase & Company FRN 25/01/2033	1.281.725	0,25
USD	721.000	CVS Health Corp. 5.05% 25/03/2048	819.083	0,16	USD	1.557.000	JPMorgan Chase & Company FRN 24/07/2038	1.579.462	0,31
USD	925.000	Duke Energy Progress Inc. 4.20% 15/08/2045	972.513	0,19	USD	1.120.000	Kimco Realty Corp. 2.25% 01/12/2031	999.848	0,19
EUR	995.000	Eli Lilly & Company 1.38% 14/09/2061	863.962	0,17	USD	1.591.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	1.646.110	0,32
USD	760.000	Emera USA Finance LP 4.75% 15/06/2046	796.496	0,16	GBP	3.600.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	4.978.133	0,97
USD	1.802.000	Enterprise Products Operating LLC 4.45% 15/02/2043	1.815.483	0,35	USD	312.000	Kraft Heinz Foods Company 4.38% 01/06/2046	310.830	0,06
USD	3.515.000	Eversource Energy 2.55% 15/03/2031	3.224.578	0,63	USD	3.028.000	Lowe's Cos Inc. 3.75% 01/04/2032	3.062.373	0,60
USD	1.072.000	Eversource Energy 3.38% 01/03/2032	1.050.550	0,20	USD	3.217.000	Morgan Stanley FRN 21/01/2033	3.015.022	0,59
USD	580.000	Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	531.182	0,10	EUR	3.622.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	4.274.699	0,83
USD	1.597.000	Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	1.462.581	0,29	EUR	1.443.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	1.748.752	0,34
USD	335.000	Fedex Corp. 4.95% 17/10/2048	374.893	0,07	USD	925.000	Nisource Finance Corp. 4.38% 15/05/2047	944.338	0,18
EUR	700.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	774.323	0,15	USD	3.727.000	Nisource Finance Corp. 4.80% 15/02/2044	3.886.180	0,76
EUR	917.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	1.014.362	0,20	USD	1.992.000	Oracle Corp. 2.88% 25/03/2031	1.819.444	0,36
EUR	584.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	653.933	0,13	USD	1.176.000	Oracle Corp. 3.60% 01/04/2040	1.022.656	0,20
EUR	267.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 21/05/2039	315.600	0,06	USD	1.200.000	Oracle Corp. 3.65% 25/03/2041	1.046.680	0,20
EUR	350.000	General Electric Company 4.13% 19/09/2035	462.256	0,09	USD	3.042.000	Pacific Gas and Electric Company 4.95% 01/07/2050	2.895.998	0,56
					USD	640.000	Piedmont Natural Gas Company Inc. 3.35% 01/06/2050	573.244	0,11
					USD	524.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	507.079	0,10
					USD	1.639.000	Plains All American Pipeline LP 4.70% 15/06/2044	1.536.231	0,30

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				CANADÁ					
USD	726.000	PPL Electric Utilities Corp 4.15% 15/06/2048	769.207	0,15	CAD	3.300.000	Canada (Govt of) 1.00% 01/09/2026	2.490.091	0,49
EUR	2.263.000	Prologis Euro Finance LLC 1.00% 08/02/2029	2.388.572	0,47	CAD	2.250.000	Canada (Govt of) 2.75% 01/12/2048	1.927.824	0,38
USD	1.565.000	Relx Capital Inc. 3.50% 16/03/2023	1.578.709	0,31			Total de Canadá	4.417.915	0,87
USD	1.043.000	San Diego Gas & Electric Company 4.15% 15/05/2048	1.104.217	0,22					
USD	460.000	Southern California Edison Company 3.65% 01/02/2050	427.030	0,08	ALEMANIA				
USD	654.000	Southern California Edison Company 4.13% 01/03/2048	643.807	0,13	EUR	5.710.000	Germany (Govt of) 0.00% 10/10/2025	6.307.043	1,22
EUR	1.105.000	Southern Company FRN 15/09/2081	1.097.611	0,21	EUR	313.000	Germany (Govt of) 0.00% 09/10/2026	343.029	0,07
USD	747.000	Southern Company 4.40% 01/07/2046	767.842	0,15	EUR	1.290.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2050	1.203.472	0,23
EUR	615.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	619.180	0,12	EUR	2.780.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 15/09/2028	2.938.015	0,57
GBP	1.300.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	1.942.154	0,38	GBP	6.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.00% 15/12/2022	7.899.307	1,54
USD	934.000	T-Mobile USA Inc. 2.63% 15/02/2029	854.943	0,17			Total de Alemania	18.690.866	3,63
USD	1.440.000	T-Mobile USA Inc. 3.40% 15/10/2052	1.236.116	0,24	JAPÓN				
USD	566.000	Tsmc Arizona Corp. 2.50% 25/10/2031	523.904	0,10	JPY	200.000.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.40% 20/06/2049	1.451.782	0,28
USD	1.955.000	Verizon Communications Inc. 2.65% 20/11/2040	1.667.516	0,33			Total de Japón	1.451.782	0,28
USD	1.461.000	Verizon Communications Inc. 3.70% 22/03/2061	1.370.561	0,27	SUPRANACIONAL				
USD	3.401.000	Verizon Communications Inc. 4.40% 01/11/2034	3.631.176	0,70	USD	13.000.000	European Investment Bank 2.38% 15/06/2022	13.015.115	2,54
USD	763.000	Williams Cos Inc. 3.50% 15/10/2051	670.905	0,13	EUR	2.300.000	IBRD 0.00% 15/01/2027	2.456.547	0,48
USD	1.136.000	Williams Partners LP 4.85% 01/03/2048	1.216.683	0,24	USD	4.000.000	IBRD 0.75% 24/11/2027	3.624.424	0,71
		Total de Estados Unidos	150.109.516	29,26	USD	5.465.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 11/03/2025	5.190.235	1,01
							Total de supranacional	24.286.321	4,74
ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)				REINO UNIDO					
USD	1.572.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	1.706.469	0,33	GBP	3.382.000	United Kingdom Gilt 0.63% 31/07/2035	3.833.733	0,75
		Total de Islas Vírgenes (Británicas)	1.706.469	0,33	GBP	239.000	United Kingdom Gilt 1.25% 22/10/2041	284.498	0,06
Total de bonos			364.921.615	71,13			Total de Reino Unido	4.118.231	0,81

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS				FRANCIA (continuación)					
USD	2.600.000	United States Treasury N/B 0.38% 15/07/2024	2.482.188	0,48	USD	1.289.000	Credit Agricole SA Perp FRN	1.171.289	0,23
USD	1.500.000	United States Treasury N/B 0.38% 30/09/2027	1.339.688	0,26			Total de Francia	4.738.873	0,92
USD	6.822.000	United States Treasury N/B 1.13% 15/08/2040	5.363.263	1,05	ITALIA				
USD	5.493.000	United States Treasury N/B 1.25% 15/05/2050	4.100.009	0,80	USD	300.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	291.175	0,06
USD	691.000	United States Treasury N/B 2.00% 15/11/2041	626.381	0,12			Total de Italia	291.175	0,06
		Total de Estados Unidos	13.911.529	2,71	PAÍSES BAJOS				
		Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda	66.876.644	13,04	USD	249.000	E.ON International Finance BV 6.65% 30/04/2038	312.521	0,06
		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	431.798.259	84,17	USD	409.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	419.701	0,08
		Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente					Total de Países Bajos	732.222	0,14
		Bonos			NORUEGA				
		AUSTRALIA			USD	2.117.000	DNB Bank ASA 1.13% 16/09/2026	1.943.645	0,38
USD	1.347.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	1.383.437	0,27			Total de Noruega	1.943.645	0,38
USD	4.378.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	4.522.845	0,89	ESTADOS UNIDOS				
		Total de Australia	5.906.282	1,16	USD	879.000	American Transmission Systems Inc. 2.65% 15/01/2032	811.241	0,16
		CANADÁ			USD	1.701.000	Atlantic City Electric 2.30% 15/03/2031	1.581.812	0,31
USD	655.000	Rogers Communications 3.80% 15/03/2032	650.108	0,13	USD	5.013.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	4.716.425	0,92
		Total de Canadá	650.108	0,13	USD	568.000	Guardian Life Insurance Company of America 4.85% 24/01/2077	629.074	0,12
		DINAMARCA			USD	1.912.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	1.784.038	0,35
USD	4.527.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	4.123.681	0,80	USD	2.726.000	Magallanes Inc. 5.14% 15/03/2052	2.796.286	0,55
		Total de Dinamarca	4.123.681	0,80	USD	2.589.000	Magallanes Inc. 5.39% 15/03/2062	2.683.553	0,52
		FRANCIA			USD	1.406.000	Metropolitan Edison Company 4.30% 15/01/2029	1.462.337	0,29
USD	2.384.000	BNP Paribas SA FRN 15/09/2029	2.125.721	0,41	USD	3.000.000	Metropolitan Life Global Funding I 1.55% 07/01/2031	2.587.713	0,50
USD	1.516.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	1.441.863	0,28	USD	493.000	New York Life Insurance Company 4.45% 04/04/2069	513.294	0,10
					USD	394.000	Northwestern Mutual 3.85% 30/09/2047	387.496	0,08

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS					
USD	3.530.000	Northwestern Mutual L 3.45% 30/03/2051	3.222.684	0,64	USD	1.833.000	Broadcom Inc. 2.45% 15/02/2031	1.629.861	0,32
USD	308.000	Northwestern Mutual Life Insurance Co/The 3.63% 30/09/2059	281.579	0,05			Total de Estados Unidos	1.629.861	0,32
USD	495.000	Peachtree Fund Trust 3.98% 15/02/2025	502.006	0,10	Total de bonos			4.241.699	0,83
USD	2.322.000	Roche Holdings Inc. 1.93% 13/12/2028	2.162.488	0,42	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			4.241.699	0,83
USD	889.000	Teachers Insurance & Annuity Association America 4.90% 15/09/2044	985.804	0,19	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				
USD	2.267.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.27% 15/05/2047	2.416.364	0,47	Fondos				
USD	824.000	T-Mobile USA Inc. 3.60% 15/11/2060	703.893	0,14	IRLANDA				
Total de Estados Unidos				5,91		10.006.758	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	10.006.758	1,95
Total de bonos		48.614.073	9,50	Total de fondos			Total de Irlanda	10.006.758	1,95
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		48.614.073	9,50	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			Total de Irlanda	10.006.758	1,95
				Valor total de las inversiones				494.660.789	96,45
				(Coste total: 537.909.310 USD)					
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario									
Bonos									
CANADÁ									
CAD	1.980.000	Rogers Communications Inc. 3.65% 31/03/2027	1.568.514	0,31					
		Total de Canadá	1.568.514	0,31					
FRANCIA									
USD	1.100.000	BNP Paribas SA FRN 20/01/2033	1.018.846	0,20					
		Total de Francia	1.018.846	0,20					
PORTUGAL									
EUR	200.000	Banco Espírito Santo SA 4.00% 21/01/2099**	24.478	0,00					
		Total de Portugal	24.478	0,00					

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

** Título a su valor razonable.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
AUSTRALIA				DINAMARCA (continuación)					
EUR	423.000	APT Pipelines Limited 1.25% 15/03/2033	371.938	0,29	EUR	157.000	Danske Bank AS FRN 15/05/2031	148.133	0,12
EUR	239.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	210.651	0,16			Total de Dinamarca	884.175	0,70
EUR	312.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	274.993	0,22					
EUR	1.588.000	Ausgrid Finance Pty Limited 1.25% 30/07/2025	1.583.908	1,24					
EUR	544.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd 0.63% 25/08/2030	485.712	0,38					
EUR	600.000	Australia & New Zealand Banking Group Limited FRN 05/05/2031	563.986	0,44					
EUR	1.072.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	1.071.555	0,84					
		Total de Australia	4.562.743	3,57					
BÉLGICA				FRANCIA					
EUR	926.000	Anheuser-Busch InBev SA 3.70% 02/04/2040	1.116.427	0,88	EUR	400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.01% 07/03/2025	388.734	0,30
EUR	162.000	Anheuser-Busch InBev SA 3.70% 02/04/2040	195.315	0,15	EUR	900.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.25% 29/06/2028	831.450	0,65
EUR	600.000	Argenta Spaarbank NV FRN 08/02/2029	569.969	0,45	EUR	600.000	BNP Paribas SA FRN 11/07/2030	555.519	0,44
EUR	400.000	Belfius Bank SA 0.00% 28/08/2026	378.928	0,30	EUR	200.000	BPCE SA 0.25% 14/01/2031	176.735	0,14
EUR	400.000	Belfius Bank SA Perp FRN	363.154	0,28	EUR	800.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	693.525	0,54
EUR	500.000	Belfius Bank SA/ NV 0.13% 08/02/2028	459.778	0,36	EUR	500.000	CNP Assurances FRN 12/10/2053	441.932	0,35
EUR	500.000	Elia Transmission Belgium SA 0.88% 28/04/2030	464.769	0,36	EUR	400.000	Credit Agricole SA FRN 21/09/2029	367.576	0,29
EUR	600.000	Elia Transmission Belgium SA 1.38% 27/05/2024	607.574	0,48	EUR	600.000	Credit Agricole SA 1.00% 03/07/2029	578.838	0,45
EUR	500.000	Vgp NV 1.63% 17/01/2027	465.353	0,36	EUR	800.000	Credit Agricole SA 1.13% 24/02/2029	783.735	0,61
		Total de Bélgica	4.621.267	3,62	EUR	300.000	Credit Mutuel Arkea SA 1.13% 23/05/2029	288.394	0,23
BERMUDAS				FRANCIA (continuación)					
USD	500.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	503.829	0,39	EUR	900.000	Danone SA 2.60% 28/06/2023	927.080	0,73
		Total de Bermudas	503.829	0,39	EUR	200.000	Electricite de France SA 1.00% 29/11/2033	181.375	0,14
DINAMARCA				FRANCIA (continuación)					
EUR	747.000	Danske Bank AS 0.63% 26/05/2025	736.042	0,58	EUR	200.000	Electricite de France SA 2.00% 09/12/2049	182.869	0,14
					EUR	800.000	Electricite de France SA Perp FRN	718.646	0,56
					EUR	200.000	Elo Saca 3.25% 23/07/2027	201.587	0,16
					EUR	758.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	656.324	0,52
					EUR	100.000	Holding d'infrastructures de Transport SASU 1.48% 18/01/2031	94.627	0,07
					EUR	1.100.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADR 0.63% 08/07/2032	995.062	0,78
					EUR	700.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADR 0.75% 12/01/2034	635.816	0,50
					EUR	2.100.000	Sanef SA 1.88% 16/03/2026	2.110.293	1,66

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
FRANCIA (continuación)				IRLANDA (continuación)					
EUR	1.400.000	Schneider Electric SE 0.25% 09/09/2024	1.384.821	1,09	EUR	650.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	603.647	0,47
EUR	500.000	Societe Generale SA FRN 17/11/2026	478.523	0,37	EUR	198.000	Eaton Capital Unlimi 0.58% 08/03/2030	181.840	0,14
EUR	600.000	TotalEnergies SE Perp FRN	551.316	0,43	EUR	565.000	Experian Europe DAC 1.56% 16/05/2031	555.416	0,43
Total de Francia			14.224.777	11,15	Total de Irlanda			2.573.061	2,01
ALEMANIA				ITALIA					
EUR	1.600.000	Allianz SE FRN 08/07/2050	1.546.555	1,21	EUR	241.000	Aeroporti di Roma SpA 1.63% 08/06/2027	236.980	0,19
EUR	700.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	657.719	0,52	EUR	214.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	196.239	0,15
EUR	900.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	757.201	0,59	EUR	283.000	Assicurazioni Generali SpA 5.00% 08/06/2048	311.419	0,24
EUR	600.000	Bayer AG 1.00% 12/01/2036	497.457	0,39	EUR	420.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 01/02/2027	410.108	0,33
EUR	686.000	Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	678.295	0,53	EUR	149.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	145.059	0,11
EUR	700.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	717.383	0,56	EUR	358.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	336.594	0,26
EUR	823.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	828.842	0,65	EUR	211.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	192.101	0,15
EUR	900.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	842.436	0,66	EUR	195.000	Eni SpA Perp FRN	186.735	0,15
EUR	435.000	E.ON SE 0.13% 18/01/2026	417.472	0,33	EUR	194.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	185.200	0,15
EUR	500.000	Eurogrid GmbH 0.74% 21/04/2033	437.100	0,34	EUR	309.000	Snam SpA 0.00% 15/08/2025	297.369	0,23
EUR	800.000	Eurogrid GmbH 0.74% 21/04/2033	699.359	0,55	EUR	450.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale Perp FRN	430.798	0,34
EUR	700.000	Eurogrid GmbH 1.63% 03/11/2023	711.857	0,56	Total de Italia			2.928.602	2,30
EUR	122.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	121.229	0,09	JAPÓN				
EUR	1.500.000	Hamburg Commercial Bank AG 0.38% 09/03/2026	1.451.333	1,14	EUR	900.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0.01% 10/09/2025	868.867	0,68
EUR	840.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.01% 05/05/2027	808.993	0,63	Total de Japón			868.867	0,68
EUR	500.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	426.886	0,33	JERSEY - ISLAS DEL CANAL				
EUR	100.000	Volkswagen Financial Services AG 3.38% 06/04/2028	106.998	0,08	EUR	315.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	286.290	0,22
EUR	115.000	Volkswagen Financial Services AG 3.38% 06/04/2028	123.048	0,10	EUR	487.000	Heathrow Funding Limited 1.88% 14/03/2034	449.272	0,36
EUR	700.000	Vonovia SE 1.50% 14/06/2041	575.295	0,45	Total de Jersey - Islas del Canal			735.562	0,58
EUR	500.000	Vonovia SE 1.88% 28/06/2028	496.607	0,39	LUXEMBURGO				
Total de Alemania			12.902.065	10,10	EUR	700.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	639.352	0,50
IRLANDA				LUXEMBURGO					
EUR	886.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	866.534	0,68					
EUR	370.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	365.624	0,29					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
LUXEMBURGO (continuación)				PAÍSES BAJOS (continuación)					
EUR	900.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	840.450	0,67	EUR	400.000	Iberdrola International BV Perp FRN	364.300	0,29
EUR	400.000	Aroundtown SA 1.63% 31/01/2028	383.063	0,30	EUR	300.000	ING Groep NV FRN 01/02/2030	268.557	0,21
EUR	110.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 12/02/2036	97.099	0,08	EUR	400.000	ING Groep NV FRN 29/09/2028	371.284	0,29
EUR	953.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	785.352	0,61	EUR	300.000	ING Groep NV FRN 29/11/2030	277.919	0,22
EUR	600.000	Grand City Properties 0.13% 11/01/2028	525.733	0,41	EUR	600.000	ING Groep NV FRN 16/02/2031	590.037	0,46
EUR	924.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.38% 15/10/2040	824.212	0,64	EUR	1.695.000	Relx Finance 1.00% 22/03/2024	1.702.536	1,33
EUR	1.479.000	Novartis Finance SA 0.00% 23/09/2028	1.370.511	1,07	EUR	415.000	Royal Schiphol Group NV 0.75% 22/04/2033	374.470	0,29
EUR	910.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	834.086	0,66	EUR	480.000	Sagax Euro MTN BV 0.75% 26/01/2028	421.812	0,33
		Total de Luxemburgo	6.299.858	4,94	EUR	345.000	Shell International Finance BV 1.88% 07/04/2032	355.204	0,28
MÉXICO					EUR	618.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	573.842	0,45
EUR	300.000	Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	278.669	0,22	EUR	1.163.000	Stedin Holding NV Perp FRN	1.121.518	0,88
		Total de México	278.669	0,22	EUR	400.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	370.434	0,29
PAÍSES BAJOS					EUR	700.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	726.280	0,57
EUR	260.000	Airbus SE 2.38% 07/04/2032	278.409	0,22	EUR	184.000	TenneT Holding BV 0.88% 16/06/2035	162.661	0,13
EUR	300.000	Airbus SE 2.38% 09/06/2040	306.670	0,24	EUR	798.000	Tennet Holding BV Perp FRN	801.214	0,63
EUR	461.000	Akelius Residential Property Financing BV 0.75% 22/02/2030	395.810	0,31	EUR	638.000	Thermo Fisher Scientific Finance BV 1.63% 18/10/2041	574.910	0,45
EUR	174.000	Akelius Residential Property Financing BV 1.13% 11/01/2029	157.415	0,12	EUR	500.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	472.347	0,37
EUR	400.000	Allianz Finance II BV 0.00% 22/11/2026	382.808	0,30	EUR	466.000	Unilever Finance Netherlands BV 1.25% 28/02/2031	464.941	0,36
EUR	1.100.000	Allianz Finance II BV 0.25% 06/06/2023	1.102.964	0,86	EUR	1.000.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	1.199.049	0,94
EUR	942.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	868.659	0,67	Total de Países Bajos			17.699.652	13,85
EUR	100.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	87.970	0,07	NORUEGA				
EUR	345.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	303.496	0,24	EUR	1.250.000	DNB Bank ASA FRN 23/02/2029	1.139.966	0,89
EUR	500.000	EDP Finance BV 1.88% 21/09/2029	502.189	0,39	Total de Noruega			1.139.966	0,89
EUR	482.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	438.777	0,34	ESPAÑA				
EUR	1.038.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	944.917	0,74	EUR	400.000	Merlin Properties Socimi SA 1.38% 01/06/2030	352.694	0,28
EUR	790.000	Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	736.253	0,58	Total de España			352.694	0,28
					SUECIA				
					EUR	791.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	742.453	0,58
					EUR	566.000	Swedbank AB 0.25% 02/11/2026	539.269	0,42
					Total de Suecia			1.281.722	1,00

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
SUIZA				REINO UNIDO (continuación)					
EUR	514.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	462.652	0,36	USD	898.000	Nationwide Building Society 1.50% 13/10/2026	744.622	0,58
EUR	1.136.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	923.422	0,72	EUR	670.000	Natwest Group plc FRN 26/02/2030	618.136	0,48
EUR	803.000	UBS AG 0.50% 31/03/2031	731.633	0,57	USD	1.050.000	NatWest Markets plc 1.60% 29/09/2026	864.975	0,68
		Total de Suiza	2.117.707	1,65	EUR	1.020.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	954.510	0,75
REINO UNIDO				ESTADOS UNIDOS					
EUR	336.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	307.171	0,24	EUR	2.214.000	AbbVie Inc. 0.75% 18/11/2027	2.121.199	1,67
EUR	281.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	256.890	0,20	EUR	453.000	American International Group Inc. 1.88% 21/06/2027	454.831	0,36
EUR	764.000	BP Capital Markets plc Perp FRN	767.412	0,59	USD	245.000	Anheuser-Busch Companies LLC 4.70% 01/02/2036	239.858	0,19
EUR	515.000	British American Tobacco plc Perp FRN	470.066	0,37	EUR	317.000	Ardagh Metal Packaging 2.00% 01/09/2028	292.949	0,23
EUR	779.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	705.633	0,55	EUR	571.000	AT&T Inc. 1.80% 14/09/2039	525.603	0,41
EUR	170.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	153.989	0,12	EUR	200.000	AT&T Inc. 1.80% 14/09/2039	184.099	0,14
EUR	252.000	Cadent Finance plc 0.75% 11/03/2032	223.819	0,18	EUR	537.000	AT&T Inc. 3.15% 04/09/2036	591.012	0,46
GBP	551.061	Delamare Finance plc 5.55% 19/02/2029	716.451	0,56	EUR	634.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	578.752	0,45
EUR	400.000	Diageo Finance plc 0.50% 19/06/2024	398.805	0,31	EUR	160.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	146.057	0,11
EUR	430.000	Diageo Finance plc 1.00% 22/04/2025	431.611	0,34	EUR	1.390.000	Bank of America Corp. FRN 31/03/2029	1.538.768	1,22
EUR	432.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	411.939	0,32	EUR	739.000	Berkshire Hathaway Finance 1.50% 18/03/2030	736.544	0,58
EUR	380.000	Glaxosmithkline Capital plc 0.00% 23/09/2023	378.643	0,30	EUR	140.000	Citigroup Inc. 1.25% 10/04/2029	135.406	0,11
EUR	735.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	779.455	0,61	EUR	278.000	Eli Lilly & Company 1.38% 14/09/2061	216.949	0,17
EUR	1.048.000	Imperial Brands Finance plc 3.38% 26/02/2026	1.101.651	0,86	EUR	185.000	Exxon Mobil Corp. 0.52% 26/06/2028	176.506	0,14
EUR	294.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	296.763	0,23	EUR	251.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	249.539	0,20
EUR	328.000	Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	302.505	0,24	EUR	458.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	460.922	0,36
EUR	1.520.000	Motability Operations Group plc 1.63% 09/06/2023	1.548.627	1,21	EUR	343.000	Fiserv Inc. 1.63% 01/07/2030	332.230	0,26
EUR	550.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	490.212	0,38					
EUR	368.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	327.996	0,26					
EUR	956.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	868.642	0,69					
		Total de Reino Unido	17.080.321	13,37					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				SUPRANACIONAL (continuación)					
EUR	585.000	General Motors Financial Company Inc. 0.60% 20/05/2027	536.134	0,42	EUR	1.100.000	European Investment Bank 0.00% 15/11/2027	1.055.470	0,83
EUR	529.000	Goldman Sachs Group Inc. 1.00% 18/03/2033	469.247	0,37	EUR	1.390.000	IBRD 0.00% 15/01/2027	1.334.300	1,04
EUR	510.000	Honeywell International Inc. 0.00% 10/03/2024	503.814	0,39	Total de supranacional				
EUR	427.000	Iqvia Inc. 1.75% 15/03/2026	417.339	0,33	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
EUR	706.000	JPMorgan Chase & Company FRN 17/02/2033	625.018	0,49	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				
EUR	865.000	JPMorgan Chase & Company FRN 23/03/2030	871.192	0,68	118.675.157 92,94				
EUR	605.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	619.074	0,48	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
EUR	1.439.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	1.526.369	1,19	Bonos				
EUR	208.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	226.551	0,18	DINAMARCA				
EUR	707.000	Prologis Euro Finance LLC 1.00% 08/02/2029	670.679	0,52	USD	509.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	416.710	0,33
EUR	281.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	254.267	0,20	Total de Dinamarca				
EUR	484.000	Verizon Communications Inc. 1.13% 19/09/2035	437.922	0,34	416.710 0,33				
EUR	210.000	Verizon Communications Inc. 1.13% 19/09/2035	190.008	0,15	FRANCIA				
USD	1.071.000	Verizon Communications Inc. 2.10% 22/03/2028	900.470	0,71	USD	930.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.60% 04/10/2026	773.307	0,61
Total de Estados Unidos			17.229.308	13,51	USD	1.600.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	1.367.686	1,07
Total de bonos			109.695.608	85,91	USD	293.000	Credit Agricole SA Perp FRN	239.288	0,19
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				Total de Francia					
ALEMANIA				ITALIA					
EUR	280.000	Germany (Govt of) 0.00% 09/10/2026	275.794	0,22	USD	500.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	436.159	0,34
EUR	3.960.000	Germany (Govt of) 0.00% 16/04/2027	3.885.987	3,04	Total de Italia				
EUR	1.440.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.05% 30/05/2024	1.434.647	1,12	436.159 0,34				
Total de Alemania			5.596.428	4,38	PAÍSES BAJOS				
SUPRANACIONAL				ITALIA					
EUR	1.000.000	European Bank for Reconstruction & Development 0.00% 10/01/2024	993.351	0,78	USD	1.150.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	1.060.611	0,83
				Total de Países Bajos					
				1.060.611 0,83					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				
Bonos (continuación)				
NORUEGA				
USD	2.250.000	DNB Bank ASA FRN 30/09/2025	1.912.832	1,51
		Total de Noruega	1.912.832	1,51
Total de bonos		6.206.593	4,88	
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		6.206.593	4,88	
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				
Bonos				
PORTUGAL				
EUR	600.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2099**	66.000	0,05
		Total de Portugal	66.000	0,05
REINO UNIDO				
EUR	350.000	Lehman Brothers UK Capital Funding III LP Perp 3.88%**	0	0,00
		Total de Reino Unido	0	0,00
Total de bonos		66.000	0,05	
Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario		66.000	0,05	
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				
Fondos				
IRLANDA				
	52	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	5.156	0,00
		Total de Irlanda	5.156	0,00
Total de fondos		5.156	0,00	
Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		5.156	0,00	
Valor total de las inversiones		124.952.906	97,87	
(Coste total: 131.356.073 EUR)				

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

** Título a su valor razonable.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
BÉLGICA				FRANCIA (continuación)					
EUR	3.100.000	Belfius Bank SA Perp FRN	3.115.501	0,70	EUR	433.000	Chrome Bidco SASU 3.50%		
EUR	351.000	House of Finance NV 4.38% 15/07/2026	344.000	0,08	EUR	1.208.000	Chrome Holding SASU 5.00% 31/05/2029	415.375	0,09
EUR	1.100.000	Solvay SA Perp FRN	1.035.070	0,24	EUR	51.000	CMA CGM SA 7.50% 15/01/2026	55.234	0,01
EUR	300.000	Solvay SA Perp FRN	305.703	0,07	EUR	1.937.000	CMA CGM SA 7.50% 15/01/2026	2.097.819	0,48
		Total de Bélgica	4.800.274	1,09	EUR	3.106.000	Constellium SE 3.13% 15/07/2029	2.861.057	0,65
CANADÁ				FRANCIA (continuación)					
EUR	1.189.000	Primo Water Holdings Inc. 3.88% 31/10/2028	1.110.387	0,25	EUR	1.115.000	Crown European Holdings SA 2.63% 30/09/2024	1.129.731	0,26
		Total de Canadá	1.110.387	0,25	EUR	587.000	Crown European Holdings SA 2.88% 01/02/2026	596.253	0,14
ISLAS CAIMÁN				FRANCIA (continuación)					
EUR	1.350.000	UPCB Finance VII 3.63% 15/06/2029	1.327.777	0,30	EUR	650.000	Crown European Holdings SA 3.38% 15/05/2025	667.842	0,15
		Total de Islas Caimán	1.327.777	0,30	EUR	2.200.000	Electricite de France SA Perp FRN	1.976.277	0,46
FINLANDIA				FRANCIA (continuación)					
EUR	531.000	Nokia Oyj 2.00% 11/03/2026	529.393	0,12	EUR	1.600.000	Electricite de France SA Perp FRN	1.492.257	0,34
EUR	594.000	Teollisuuden Voima Oyj 1.38% 23/06/2028	545.248	0,12	EUR	400.000	Electricite de France SA Perp FRN	360.513	0,08
EUR	1.592.000	Teollisuuden Voima Oyj 2.63% 31/03/2027	1.583.041	0,36	EUR	2.900.000	Electricite de France SA Perp FRN	2.973.550	0,69
		Total de Finlandia	2.657.682	0,60	EUR	1.800.000	Electricite de France SA Perp FRN	1.873.564	0,44
FRANCIA				FRANCIA (continuación)					
EUR	600.000	Accor SA Perp FRN	604.097	0,14	GBP	1.200.000	Electricite de France SA Perp FRN	1.408.071	0,32
EUR	1.165.000	Altice France SA 3.38% 15/01/2028	1.059.366	0,24	EUR	1.216.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	1.112.165	0,25
EUR	542.000	Altice France SA 4.00% 15/07/2029	489.110	0,11	EUR	1.100.000	Elis SA 1.00% 03/04/2025	1.065.946	0,24
EUR	561.000	Altice France SA 4.13% 15/01/2029	510.407	0,12	EUR	846.000	Emeria SASU 3.38% 31/03/2028	798.326	0,18
EUR	1.364.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	1.241.006	0,28	EUR	4.284.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2027	3.833.586	0,89
EUR	1.181.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	1.211.266	0,28	EUR	100.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	86.586	0,02
EUR	1.542.000	CAB Selas 3.38% 01/02/2028	1.469.996	0,34	EUR	1.785.000	Faurecia SE 2.75% 15/02/2027	1.635.823	0,37
EUR	600.000	Casino Guichard Perrachon SA 4.05% 05/08/2026	511.663	0,12	EUR	1.059.000	Faurecia SE 3.75% 15/06/2028	997.914	0,23
EUR	1.115.000	Casino Guichard Perrachon SA 5.25% 15/04/2027	953.736	0,22	EUR	2.000.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	2.048.833	0,47
EUR	990.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	904.919	0,21	EUR	3.160.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	3.203.834	0,73
EUR	2.600.000	Casino Guichard-Perrachon SA 4.50% 07/03/2024	2.434.999	0,56	EUR	982.000	Iliad Holding SASU 5.63% 15/10/2028	982.239	0,22
					EUR	500.000	Iliad SA 0.75% 11/02/2024	484.607	0,11
					EUR	500.000	Iliad SA 1.50% 14/10/2024	487.349	0,11
					EUR	681.000	Iqera Group SAS 6.50% 30/09/2024	685.388	0,16
					EUR	571.000	La Financiere Atalian SASU 4.00% 15/05/2024	525.306	0,12
					EUR	1.030.000	La Financiere Atalian SASU 5.13% 15/05/2025	937.482	0,21
					EUR	578.000	Laboratoire Eimer Selas 5.00% 01/02/2029	540.332	0,12
					EUR	1.379.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	1.360.471	0,31

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)			
FRANCIA (continuación)				ALEMANIA (continuación)			
EUR	628.000 Loxam SAS 3.75% 15/07/2026	622.158	0,14	EUR	2.600.000 Deutsche Lufthansa AG 3.75% 11/02/2028	2.508.523	0,57
EUR	605.000 Loxam SAS 5.75% 15/07/2027	591.965	0,14	EUR	1.190.000 Douglas GmbH 6.00% 08/04/2026	1.135.614	0,26
EUR	400.000 Orano SA 3.38% 23/04/2026	411.607	0,09	EUR	855.000 Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	849.594	0,19
EUR	100.000 Orano SA 4.88% 23/09/2024	108.486	0,02	EUR	804.000 Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	783.914	0,18
EUR	754.000 Paprec Holding SA 3.50% 01/07/2028	720.224	0,16	EUR	902.000 Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	879.466	0,20
EUR	1.393.000 Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	1.405.201	0,32	EUR	2.015.000 HT Troplast AG 9.25% 15/07/2025	2.018.400	0,46
EUR	1.438.000 Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	1.486.993	0,33	EUR	548.360 IHO Verwaltungs GmbH 3.75% 15/09/2026	533.260	0,12
EUR	1.219.000 Picard Groupe SAS 3.88% 01/07/2026	1.186.641	0,27	EUR	530.000 Ineos Styrolution Group GmbH 2.25% 16/01/2027	482.898	0,11
EUR	500.000 Renault SA 1.25% 24/06/2025	466.233	0,11	EUR	500.000 Infineon Technologies AG Perp FRN	501.657	0,11
EUR	500.000 Renault SA 2.00% 28/09/2026	460.438	0,11	EUR	600.000 Infineon Technologies AG Perp FRN	602.068	0,14
EUR	1.300.000 Renault SA 2.38% 25/05/2026	1.227.981	0,28	EUR	1.500.000 Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	1.280.658	0,29
EUR	500.000 Renault SA 2.50% 02/06/2027	461.634	0,11	EUR	990.000 Nidda Healthcare Holding GmbH 3.50% 30/09/2024	952.109	0,22
EUR	700.000 Renault SA 2.50% 01/04/2028	626.267	0,14	EUR	2.694.000 Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	2.569.777	0,59
EUR	850.000 Rexel SA 2.13% 15/06/2028	814.581	0,19	EUR	2.556.000 PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	2.464.656	0,57
EUR	961.000 Rexel SA 2.13% 15/12/2028	909.955	0,21	EUR	1.566.000 Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	1.552.869	0,35
EUR	1.979.000 Solvay Finance SA Perp FRN	2.065.788	0,47	EUR	434.000 Progroup AG 3.00% 31/03/2026	417.378	0,10
EUR	1.100.000 Spie SA 2.63% 18/06/2026	1.095.333	0,25	EUR	900.000 Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	905.359	0,21
EUR	3.000.000 Valeo 1.00% 03/08/2028	2.624.046	0,60	EUR	2.100.000 Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	2.112.504	0,48
EUR	500.000 Valeo SA 1.50% 18/06/2025	488.784	0,11	EUR	1.314.000 Schaeffler AG 2.88% 26/03/2027	1.296.471	0,30
EUR	600.000 Valeo SA 1.63% 18/03/2026	582.657	0,13	EUR	800.000 Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	785.056	0,18
EUR	300.000 Valeo SA 3.25% 22/01/2024	310.016	0,07	EUR	700.000 Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	686.924	0,16
EUR	1.100.000 Veolia Environnement SA Perp FRN	1.072.802	0,25	EUR	1.575.000 Schenck Process Holding GmbH 5.38% 15/06/2023	1.562.560	0,36
EUR	1.500.000 Verallia SA 1.63% 14/05/2028	1.401.731	0,32	EUR	1.536.000 Techem Verwaltungsgesellschaft 674 2.00% 15/07/2025	1.480.265	0,34
EUR	1.700.000 Verallia SA 1.88% 10/11/2031	1.503.137	0,34	EUR	1.247.582 Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	1.251.908	0,29
	Total de Francia	73.855.171	16,89	EUR	1.002.000 thyssenkrupp AG 2.50% 25/02/2025	999.608	0,23
				EUR	1.568.000 Thyssenkrupp AG 2.88% 22/02/2024	1.565.465	0,36
				EUR	1.340.000 TK Elevator Midco GmbH 4.38% 15/07/2027	1.326.297	0,30
ALEMANIA							
EUR	1.100.000 Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	1.045.861	0,24				
EUR	550.000 Adler Real Estate AG 2.13% 06/02/2024	505.184	0,12				
EUR	1.701.000 Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	1.654.343	0,37				
EUR	263.000 Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	260.389	0,06				
EUR	598.000 Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	592.064	0,14				
EUR	500.000 Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	492.282	0,11				
EUR	2.800.000 Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	2.609.461	0,60				
EUR	2.200.000 Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	2.123.128	0,49				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)						
ALEMANIA (continuación)				ITALIA (continuación)						
EUR	62.000	TK Elevator Midco GmbH 4.38% 15/07/2027	61.366	0,01	EUR	2.624.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	2.504.973	0,57	
EUR	100.000	ZF Finance GmbH 2.75% 25/05/2027	93.227	0,02	EUR	939.000	Nexi SpA 2.13% 30/04/2029	855.838	0,20	
EUR	900.000	ZF Finance GmbH 3.00% 21/09/2025	885.847	0,20	EUR	1.000.000	Telecom Italia SpA 2.38% 12/10/2027	914.340	0,21	
EUR	1.100.000	ZF Finance GmbH 3.75% 21/09/2028	1.047.503	0,24	EUR	1.802.000	Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	1.772.143	0,41	
		Total de Alemania	44.875.913	10,27	EUR	275.000	Telecom Italia SpA 2.88% 28/01/2026	265.430	0,06	
					EUR	1.443.000	Telecom Italia SpA 3.63% 25/05/2026	1.441.913	0,33	
IRLANDA					EUR	1.064.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	1.092.839	0,25	
EUR	3.436.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	3.393.479	0,78	EUR	600.000	Telecom Italia SpA 5.25% 17/03/2025	588.343	0,13	
GBP	826.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III 4.88% 15/07/2028	924.668	0,21	GBP	1.050.000	Telecom Italia SpA 5.88% 19/05/2023	1.274.220	0,29	
		Total de Irlanda	4.318.147	0,99	EUR	950.000	Unipol Gruppo SpA 3.25% 23/09/2030	974.900	0,22	
ISLA DE MAN					Total de Italia				27.640.439	6,32
EUR	1.157.000	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	1.163.364	0,27						
EUR	484.000	Playtech plc 4.25% 07/03/2026	486.469	0,11						
		Total de Isla de Man	1.649.833	0,38						
ITALIA					JAPÓN					
EUR	1.664.000	Atlantia SpA 1.63% 03/02/2025	1.643.189	0,38	EUR	716.000	Softbank Group Corp. 2.88% 06/01/2027	640.152	0,15	
EUR	1.922.000	Atlantia SpA 1.88% 13/07/2027	1.837.245	0,41	EUR	1.046.000	Softbank Group Corp. 3.13% 19/09/2025	984.262	0,22	
EUR	2.456.000	Atlantia SpA 1.88% 12/02/2028	2.327.670	0,53	EUR	630.000	Softbank Group Corp. 4.00% 20/04/2023	632.201	0,14	
EUR	609.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	554.454	0,13	EUR	607.000	Softbank Group Corp. 4.00% 19/09/2029	531.257	0,12	
EUR	1.423.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2.63% 28/04/2025	1.344.059	0,31	EUR	1.148.000	Softbank Group Corp. 5.00% 15/04/2028	1.092.418	0,25	
EUR	826.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3.63% 24/09/2024	800.215	0,18	Total de Japón				3.880.290	0,88
EUR	1.607.000	Fis Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	1.530.755	0,35						
EUR	522.000	Gamma Bidco SpA 6.25% 15/07/2025	528.215	0,12						
EUR	1.584.000	IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3.75% 15/01/2028	1.487.949	0,34						
EUR	388.000	Infrastrutture Wireless Italiane SpA 1.88% 08/07/2026	383.030	0,09						
EUR	771.000	International Design Group SPA 6.50% 15/11/2025	778.963	0,18						
EUR	378.000	Leonardo SpA 1.50% 07/06/2024	379.144	0,09						
EUR	607.000	Leonardo SpA 2.38% 08/01/2026	614.313	0,14						
EUR	540.000	Leonardo SpA 4.88% 24/03/2025	586.085	0,13						
EUR	1.191.000	Marcolin SpA 6.13% 15/11/2026	1.160.214	0,27						
					JERSEY - ISLAS DEL CANAL					
					EUR	1.667.000	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	1.640.510	0,38	
					EUR	3.012.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	3.033.328	0,69	
					EUR	1.149.000	Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	1.125.407	0,26	
					Total de Jersey - Islas del Canal				5.799.245	1,33
					LUXEMBURGO					
					EUR	1.900.000	Adler Group SA 1.88% 14/01/2026	1.591.158	0,36	
					EUR	200.000	Adler Group SA 2.75% 13/11/2026	167.981	0,04	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
LUXEMBURGO (continuación)				LUXEMBURGO (continuación)					
EUR	1.900.000	Adler Group SA 3.25% 05/08/2025	1.679.349	0,38	EUR	579.000	Picard Bondco SA 5.38% 01/07/2027	550.011	0,13
EUR	910.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	869.822	0,20	EUR	1.562.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	1.535.378	0,35
EUR	1.393.000	Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	1.231.535	0,28	EUR	458.000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/01/2033	527.983	0,12
EUR	1.710.000	Altice Finco SA 4.75% 15/01/2028	1.503.654	0,35	EUR	1.100.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	1.077.508	0,25
EUR	100.000	Altice France Holding SA 4.00% 15/02/2028	86.147	0,02			Total de Luxemburgo	34.945.137	8,00
EUR	3.229.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	3.339.228	0,77	PAÍSES BAJOS				
EUR	1.335.261	ARD Finance SA 5.00% 30/06/2027	1.216.884	0,28	EUR	1.300.000	Abertis Finance BV Perp FRN	1.197.478	0,27
GBP	564.000	B&m European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	654.570	0,15	EUR	1.937.000	Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	1.792.011	0,41
GBP	980.000	B&m European Value Retail SA 4.00% 15/11/2028	1.090.481	0,25	EUR	1.317.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	1.328.526	0,30
EUR	1.091.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	1.006.919	0,23	EUR	562.000	Diebold Nixdorf Dutch Holding BV 9.00% 15/07/2025	581.652	0,13
EUR	604.000	Cirsa Finance International Sarl 4.50% 15/03/2027	573.176	0,13	EUR	200.000	Dufry One BV 2.50% 15/10/2024	195.104	0,04
EUR	657.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	645.116	0,15	EUR	572.000	Dufry One BV 3.38% 15/04/2028	531.601	0,12
EUR	1.790.900	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	1.802.399	0,41	EUR	120.000	Goodyear Europe BV 2.75% 15/08/2028	108.683	0,02
EUR	543.000	CPI Property Group SA Perp FRN	506.234	0,12	EUR	1.991.000	Intertrust Group BV 3.38% 15/11/2025	1.992.307	0,45
EUR	971.105	CPI Property Group SA Perp FRN	953.049	0,22	EUR	1.207.000	Lkq European Holdings BV 4.13% 01/04/2028	1.252.127	0,29
EUR	639.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 6.75% 01/11/2025	637.751	0,15	EUR	1.548.000	Nobel Bidco BV 3.13% 15/06/2028	1.382.699	0,31
GBP	1.057.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	1.245.155	0,28	EUR	370.800	Oci NV 3.63% 15/10/2025	377.260	0,09
EUR	1.384.000	Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	1.418.622	0,32	EUR	300.000	Phoenix Pib Dutch Finance BV 2.38% 05/08/2025	294.434	0,07
EUR	612.000	Holcim Finance Luxembourg SA Perp FRN	614.252	0,14	EUR	624.000	Ppf Telecom Group BV 2.13% 31/01/2025	610.061	0,14
EUR	479.000	HSE Finance Sarl 5.63% 15/10/2026	454.962	0,10	EUR	600.000	PPF Telecom Group BV 3.13% 27/03/2026	593.438	0,14
EUR	3.775.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	3.474.952	0,80	EUR	459.000	PPF Telecom Group BV 3.25% 29/09/2027	449.848	0,10
EUR	900.000	Intralot Capital Lux 5.25% 15/09/2024	756.000	0,17	EUR	612.000	PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	621.725	0,14
EUR	1.173.792	Lhmc Finco 2 Sarl 7.25% 02/10/2025	1.148.199	0,26	EUR	722.000	Q-Park Holding I BV 1.50% 01/03/2025	680.059	0,16
EUR	1.914.000	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	1.917.007	0,44	EUR	212.000	Q-Park Holding I BV 2.00% 01/03/2027	194.138	0,04
EUR	684.000	Matterhorn Telecom SA 4.00% 15/11/2027	669.655	0,15	EUR	837.000	Repsol International Finance BV FRN 25/03/2075	872.471	0,20
					EUR	2.565.000	Repsol International Finance BV Perp FRN	2.435.812	0,57

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
PAÍSES BAJOS (continuación)				PANAMÁ					
EUR	462.000	Repsol International Finance BV Perp FRN	466.650	0,11	EUR	2.468.000	Carnival Corp. 7.63% 01/03/2026	2.531.798	0,58
EUR	1.352.000	Repsol International Finance BV Perp FRN	1.365.606	0,31	Total de Panamá				
EUR	1.557.000	Repsol International Finance BV Perp FRN	1.567.569	0,36	2.531.798 0,58				
EUR	472.000	Saipem Finance International BV 3.13% 31/03/2028	404.530	0,09	PORTUGAL				
EUR	603.000	Saipem Finance International BV 3.38% 15/07/2026	543.912	0,13	EUR	700.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 14/03/2082	632.500	0,14
EUR	1.008.697	Summer Bidco BV 9.00% 15/11/2025	1.007.030	0,23	EUR	700.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 20/07/2080	670.208	0,15
EUR	857.253	Summer Bidco BV 9.00% 15/11/2025	855.837	0,20	EUR	100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 30/04/2079	104.051	0,02
EUR	1.100.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	1.018.694	0,23	Total de Portugal				
EUR	1.300.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	1.203.911	0,28	1.406.759 0,31				
EUR	3.200.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	3.237.977	0,74	RUMANÍA				
EUR	3.700.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	3.838.906	0,89	EUR	1.100.000	RCS & RDS SA 2.50% 05/02/2025	1.057.762	0,24
EUR	1.100.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	1.169.892	0,27	EUR	400.000	RCS & RDS SA 3.25% 05/02/2028	368.136	0,08
EUR	1.763.000	Tennet Holding BV Perp FRN	1.770.100	0,41	Total de Rumanía				
EUR	495.000	Tennet Holding BV Perp FRN	506.551	0,12	1.425.898 0,32				
EUR	525.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.88% 31/03/2027	463.358	0,11	ESPAÑA				
EUR	1.518.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.75% 09/05/2027	1.438.689	0,33	EUR	1.100.000	Cellnex Finance Company 2.00% 15/02/2033	939.338	0,21
EUR	1.434.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.38% 09/05/2030	1.335.075	0,31	EUR	1.100.000	Cellnex Finance Company SA 1.00% 15/09/2027	998.541	0,23
EUR	515.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	520.096	0,12	EUR	1.400.000	Cellnex Finance Company SA 1.25% 15/01/2029	1.225.972	0,28
EUR	1.287.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	1.205.358	0,28	EUR	1.100.000	Cellnex Finance Company SA 1.50% 08/06/2028	1.002.755	0,23
EUR	966.000	United Group BV 4.63% 15/08/2028	905.359	0,21	EUR	700.000	Cellnex Finance Company SA 2.25% 12/04/2026	694.799	0,16
EUR	641.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	641.210	0,15	EUR	500.000	Cellnex Telecom SA 1.00% 20/04/2027	459.836	0,11
EUR	691.000	United Group BV 5.25% 01/02/2030	647.539	0,15	EUR	500.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	453.908	0,10
EUR	1.075.000	VZ Secured Financing BV Bond 3.50% 15/01/2032	991.281	0,23	EUR	600.000	Cellnex Telecom SA 2.88% 18/04/2025	620.034	0,14
EUR	917.000	Vz Vendor Financing II BV 2.88% 15/01/2029	830.200	0,19	EUR	2.105.000	Grifols Escrow Issuer SA 3.88% 15/10/2028	2.006.811	0,45
EUR	600.000	ZF Europe Finance BV 3.00% 23/10/2029	537.338	0,12	EUR	1.733.000	Grifols SA 2.25% 15/11/2027	1.659.114	0,37
Total de Países Bajos				45.964.102 10,56	Total de España				15.816.102 3,60

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
SUECIA				REINO UNIDO (continuación)					
EUR	1.540.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	1.305.594	0,30	EUR	1.367.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	1.346.500	0,31
EUR	720.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	605.096	0,14	USD	1.951.285	Enquest plc 7.00% 15/10/2023	1.726.808	0,39
EUR	850.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	803.399	0,18	EUR	1.803.000	Ineos Finance plc 2.88% 01/05/2026	1.722.937	0,39
EUR	1.520.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	1.385.742	0,32	EUR	474.000	Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	466.071	0,11
EUR	1.514.000	Intrum AB 3.00% 15/09/2027	1.395.679	0,32	EUR	396.000	Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	389.376	0,09
EUR	1.733.000	Intrum AB 3.50% 15/07/2026	1.666.280	0,38	EUR	98.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	92.846	0,02
EUR	478.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	482.556	0,11	EUR	2.215.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	2.098.501	0,47
EUR	2.033.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	1.913.859	0,44	GBP	1.458.000	Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	1.746.907	0,39
EUR	80.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	75.312	0,02	EUR	1.583.000	International Game Technology plc 2.38% 15/04/2028	1.480.638	0,34
EUR	586.000	Verisure Holding AB 3.88% 15/07/2026	573.973	0,13	EUR	1.306.000	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	1.336.888	0,31
EUR	2.069.000	Verisure Midholding AB 5.25% 15/02/2029	1.915.226	0,44	EUR	2.025.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	2.044.030	0,47
EUR	138.000	Verisure Midholding AB 5.25% 15/02/2029	127.743	0,03	GBP	2.284.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	2.695.228	0,62
EUR	322.000	Volvo Car AB 2.13% 02/04/2024	326.193	0,07	EUR	320.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.20% 15/01/2024	310.060	0,07
EUR	706.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	708.817	0,16	GBP	987.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 3.88% 01/03/2023	1.159.666	0,27
EUR	699.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	701.789	0,16	EUR	102.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 4.50% 15/07/2028	92.516	0,02
	Total de Suecia	13.987.258	3,20	EUR	602.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	614.168	0,14	
REINO UNIDO				EUR	1.880.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	1.935.486	0,44	
GBP	868.000	Arqiva Broadcast Finance plc 6.75% 30/09/2023	1.030.565	0,24	GBP	578.000	Jerrold Finco plc 4.88% 15/01/2026	660.760	0,15
EUR	1.791.000	BCP V Modular Services Finance II plc 4.75% 30/11/2028	1.718.463	0,39	GBP	1.502.000	Jerrold Finco plc 5.25% 15/01/2027	1.716.874	0,39
GBP	2.037.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	1.966.045	0,45	GBP	1.241.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	1.441.396	0,33
EUR	997.000	BP Capital Markets plc Perp FRN	1.001.451	0,23	GBP	600.000	Marks & Spencer plc 6.00% 12/06/2025	742.491	0,17
EUR	686.000	BP Capital Markets plc Perp FRN	678.034	0,15	EUR	896.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	901.775	0,21
GBP	510.000	Centrica plc FRN 10/04/2075	612.895	0,14	GBP	1.429.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	1.693.273	0,39
GBP	911.000	Constellation Automotive Financing plc 4.88% 15/07/2027	988.282	0,23	GBP	2.315.000	Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	2.701.861	0,62
GBP	1.026.000	Co-Operative Bank Finance FRN 06/04/2027	1.214.113	0,28	EUR	523.000	Rolls-Royce plc 4.63% 16/02/2026	550.472	0,13
GBP	935.000	Co-Operative Group Holdings FRN 08/07/2026	1.177.319	0,27					
GBP	621.000	Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	738.094	0,17					
GBP	2.270.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	2.571.686	0,58					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
REINO UNIDO (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
GBP	514.000	Rolls-Royce plc 5.75% 15/10/2027	635.423	0,14	EUR	565.000	Ford Motor Credit Company LLC 1.36% 07/02/2025	545.068	0,12
GBP	1.377.000	Santander UK plc Perp 10.06%	2.865.728	0,65	EUR	1.054.000	Ford Motor Credit Company LLC 1.74% 19/07/2024	1.037.716	0,24
EUR	2.065.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	1.974.740	0,44	EUR	1.599.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.33% 25/11/2025	1.572.843	0,36
EUR	808.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	811.770	0,19	EUR	271.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	266.256	0,06
GBP	739.000	Travis Perkins plc 3.75% 17/02/2026	868.703	0,20	EUR	291.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	285.906	0,07
EUR	829.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	799.265	0,18	EUR	291.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	285.906	0,07
EUR	1.703.000	Victoria plc 3.75% 15/03/2028	1.576.410	0,36	GBP	1.323.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	1.519.416	0,35
GBP	603.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.25% 15/01/2030	656.286	0,15	EUR	2.513.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	2.547.202	0,57
GBP	1.466.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.00% 15/04/2027	1.759.197	0,40	EUR	1.830.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	1.860.599	0,43
GBP	409.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	476.306	0,11	GBP	952.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	1.128.979	0,26
EUR	1.860.000	Vmed O2 UK Financing 3.25% 31/01/2031	1.719.664	0,39	EUR	2.761.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/01/2028	2.628.334	0,60
EUR	876.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	852.562	0,19	EUR	139.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/03/2029	127.758	0,03
EUR	1.646.000	Vodafone Group plc FRN 03/01/2079	1.662.503	0,38	EUR	2.532.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/03/2029	2.327.216	0,54
EUR	1.909.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	1.953.177	0,45	EUR	1.236.000	Iqvia Inc. 2.88% 15/06/2028	1.195.305	0,27
GBP	335.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	401.932	0,09	EUR	586.000	MPT Operating Partnership 3.33% 24/03/2025	606.530	0,13
USD	1.727.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	1.602.211	0,37	GBP	748.000	MPT Operating Partnership 3.69% 05/06/2028	861.567	0,20
USD	1.024.000	Vodafone Group plc FRN 04/04/2079	1.020.268	0,23	EUR	2.841.000	Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	3.040.511	0,69
USD	56.000	Vodafone Group plc FRN 04/04/2079	55.796	0,01	EUR	360.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	381.857	0,09
GBP	2.815.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	3.067.232	0,70	EUR	666.000	Netflix Inc. 4.63% 15/05/2029	753.752	0,17
		Total de Reino Unido	70.123.648	16,00	USD	430.000	Occidental Petroleum Corp. 3.20% 15/08/2026	380.841	0,09
					USD	590.000	Occidental Petroleum Corp. 5.88% 01/09/2025	563.872	0,13
					USD	310.000	Occidental Petroleum Corp. 6.38% 01/09/2028	314.486	0,07
					USD	718.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	741.296	0,17
					USD	550.000	Occidental Petroleum Corp. 8.00% 15/07/2025	555.351	0,13
					USD	345.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	368.160	0,08
					USD	850.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	984.479	0,22
					EUR	1.184.000	Olympus Water USA 3.88% 01/10/2028	1.090.513	0,25
					EUR	460.000	Olympus Water USA 5.38% 01/10/2029	404.054	0,09
					EUR	1.444.000	Scientific Games International Inc. 5.50% 15/02/2026	1.485.515	0,34

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				REINO UNIDO (continuación)					
EUR	1.330.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	1.325.782	0,30	GBP	584.000	Bracken Midco1 plc 6.75% 01/11/2027	667.437	0,15
		Total de Estados Unidos	36.727.717	8,37	GBP	3.281.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	3.761.472	0,85
		Total de bonos	394.843.577	90,24	GBP	297.000	Pinewood Finance Company Limited 3.63% 15/11/2027	329.919	0,08
		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	394.843.577	90,24	GBP	1.089.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	1.224.411	0,28
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				Total de Reino Unido					
Bonos				13.640.147					
ESTADOS UNIDOS				3,11					
USD	445.000	Occidental Petroleum Corp. 6.95% 01/07/2024	430.442	0,10	Total de bonos				
USD	478.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	537.006	0,12	14.663.147				
		Total de Estados Unidos	967.448	0,22	Renta variable				
		Total de bonos	967.448	0,22	REINO UNIDO				
		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente	967.448	0,22	434	NV Profit Share Limited**	0	0,00	
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				Total de Reino Unido					
Bonos				0					
PORTUGAL				0,00					
EUR	1.000.000	Banco Espirito Santo SA 2.63% 31/12/2049**	110.000	0,03	Total de renta variable				
EUR	6.900.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2099**	759.000	0,17	0				
EUR	1.400.000	Banco Espirito Santo SA 4.75% 15/01/2023**	154.000	0,04	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				
		Total de Portugal	1.023.000	0,24	14.663.147				
		Total de bonos	1.023.000	0,24	3,35				
		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente	1.023.000	0,24	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				
REINO UNIDO				Fondos					
EUR	1.244.000	BCP V Modular Services Finance II plc 6.75% 30/11/2029	1.134.897	0,26	IRLANDA				
GBP	3.162.000	Bellis Acquisition Company 3.25% 16/02/2026	3.466.358	0,79	1.751.211	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	2.072.288	0,47	
		Total de Reino Unido	4.601.255	1,05	197.655	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	19.414.920	4,44	
		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente	4.601.255	1,05	1.009.757	Insight Liquidity Funds plc	1.194.892	0,27	
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				Total de Irlanda					
Bonos				22.682.100					
PORTUGAL				5,18					
REINO UNIDO				Total de fondos					
22.682.100				5,18					
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios					
22.682.100				5,18					
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				Valor total de las inversiones					
22.682.100				433.156.272					
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				98,99					
22.682.100				(Coste total: 449.402.373 EUR)					

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

** Título a su valor razonable.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
BÉLGICA				FRANCIA (continuación)					
EUR	300.000	House of Finance NV 4.38% 15/07/2026	294.017	0,27	EUR	569.000	La Financiere Atalian SASU 4.00% 15/05/2024	523.466	0,48
Total de Bélgica			294.017	0,27	EUR	381.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	375.881	0,35
DINAMARCA				EUR	177.178	Loxam SAS 6.00% 15/04/2025	178.327	0,16	
EUR	150.000	Dkt Finance Aps 7.00% 17/06/2023	150.967	0,14	EUR	100.000	Orano SA 3.13% 20/03/2023	101.712	0,09
Total de Dinamarca			150.967	0,14	EUR	820.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	827.182	0,76
FINLANDIA				EUR	813.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	840.699	0,77	
EUR	540.000	Teollisuuden Voima Oyj 2.13% 04/02/2025	542.304	0,50	EUR	113.000	Picard Groupe SAS 3.88% 01/07/2026	110.000	0,10
Total de Finlandia			542.304	0,50	EUR	313.000	Picard Groupe SAS 3.88% 01/07/2026	304.691	0,28
FRANCIA				EUR	405.000	Quatrim SASU 5.88% 15/01/2024	405.976	0,37	
EUR	316.000	Altice France SA 2.13% 15/02/2025	301.457	0,28	EUR	300.000	Spie SA 3.13% 22/03/2024	308.284	0,29
EUR	1.356.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	1.307.303	1,20	EUR	700.000	Valeo SA 3.25% 22/01/2024	723.370	0,67
EUR	610.000	Banjay Entertainment SASU 3.50% 01/03/2025	610.302	0,56	Total de Francia			15.545.509	14,32
EUR	400.000	Casino Guichard Perrachon SA 1.87% 13/06/2022	400.588	0,37	ALEMANIA				
EUR	289.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	264.163	0,24	EUR	400.000	Adler Real Estate AG 1.50% 17/04/2022	396.349	0,37
EUR	300.000	Casino Guichard-Perrachon SA 4.50% 07/03/2024	280.961	0,26	EUR	1.100.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	1.045.861	0,97
EUR	505.000	CMA CGM SA 7.50% 15/01/2026	546.927	0,51	EUR	250.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	243.143	0,22
EUR	147.000	Crown European Holdings SA 0.75% 15/02/2023	146.315	0,14	EUR	200.000	Demire Deutsche Mittelstand Real Estate AG 1.88% 15/10/2024	195.270	0,18
EUR	100.000	Crown European Holdings SA 2.25% 01/02/2023	100.707	0,09	EUR	300.000	Deutsche Lufthansa AG 1.63% 16/11/2023	298.234	0,28
EUR	100.000	Crown European Holdings SA 3.38% 15/05/2025	102.745	0,09	EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 2.00% 14/07/2024	196.964	0,18
EUR	850.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	777.418	0,72	EUR	400.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	393.825	0,36
EUR	500.000	Elis SA 1.88% 15/02/2023	504.170	0,46	EUR	300.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	279.585	0,26
EUR	271.000	Faurecia SE 2.63% 15/06/2025	264.440	0,24	EUR	300.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	289.517	0,27
EUR	1.291.000	Faurecia SE 2.63% 15/06/2025	1.259.752	1,17	EUR	726.000	Gruenenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	721.409	0,67
EUR	250.000	Faurecia SE 2.75% 15/02/2027	229.107	0,21	EUR	860.000	HT Troplast AG 9.25% 15/07/2025	861.451	0,80
EUR	1.428.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	1.462.867	1,34	EUR	1.000.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.63% 15/05/2025	990.559	0,91
EUR	1.006.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	1.019.955	0,94	EUR	706.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	680.769	0,63
EUR	200.000	Iliad SA 0.75% 11/02/2024	193.843	0,18	EUR	1.180.000	Peach Property Finance GmbH 3.50% 15/02/2023	1.173.634	1,07
EUR	799.000	Iqera Group SAS 6.50% 30/09/2024	804.148	0,75	EUR	100.000	Progroup AG 3.00% 31/03/2026	96.170	0,09
EUR	280.000	Kapla Holding SAS 3.38% 15/12/2026	268.753	0,25					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ALEMANIA (continuación)				ITALIA (continuación)					
EUR	100.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	100.595	0,09	EUR	300.000	International Design Group SPA 6.50% 15/11/2025	303.098	0,28
EUR	979.000	Schenck Process Holding Gmbh 5.38% 15/06/2023	971.267	0,90	EUR	1.144.000	Lkq Italia Bondco 3.88% 01/04/2024	1.183.901	1,10
EUR	496.000	SGL Carbon SE 4.63% 30/09/2024	490.833	0,45	EUR	262.000	Marcolin SpA 6.13% 15/11/2026	255.228	0,24
EUR	1.230.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 2.00% 15/07/2025	1.185.369	1,09	EUR	428.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	408.586	0,38
EUR	764.000	Tele Columbus AG 3.88% 02/05/2025	711.922	0,66	EUR	1.228.000	Nexi SpA 1.75% 31/10/2024	1.234.187	1,14
EUR	75.000	Thyssenkrupp AG 1.88% 06/03/2023	74.734	0,07	EUR	1.081.000	Rossini Sarl 6.75% 30/10/2025	1.110.244	1,03
EUR	1.009.000	Thyssenkrupp AG 2.88% 22/02/2024	1.007.369	0,93	EUR	277.000	Telecom Italia SpA 2.50% 19/07/2023	280.361	0,26
EUR	500.000	TUI Cruises GmbH 6.50% 15/05/2026	474.979	0,44	EUR	100.000	Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	98.343	0,09
EUR	100.000	ZF Finance GmbH 3.00% 21/09/2025	98.427	0,09	EUR	500.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	513.552	0,47
		Total de Alemania	12.978.235	11,98			Total de Italia	7.842.207	7,26
IRLANDA				JAPÓN					
EUR	1.283.000	Eircom Finance Dac 1.75% 01/11/2024	1.269.590	1,18	EUR	500.000	Softbank Group Corp. 2.13% 06/07/2024	473.785	0,44
EUR	544.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	537.268	0,50	EUR	125.000	Softbank Group Corp. 4.00% 30/07/2022	124.805	0,12
		Total de Irlanda	1.806.858	1,68	EUR	130.000	Softbank Group Corp. 4.00% 20/04/2023	130.454	0,12
ISLA DE MAN				JERSEY - ISLAS DEL CANAL					
EUR	1.476.000	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	1.484.118	1,37	EUR	1.147.000	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	1.128.774	1,04
EUR	210.000	Playtech plc 4.25% 07/03/2026	211.071	0,19	EUR	664.000	Avis Budget Finance plc 4.13% 15/11/2024	668.687	0,62
		Total de Isla de Man	1.695.189	1,56	EUR	370.000	Avis Budget Finance plc 4.50% 15/05/2025	375.743	0,35
ITALIA				LUXEMBURGO					
GBP	150.000	Aeroporti di Roma SpA 5.44% 20/02/2023	182.109	0,17	EUR	750.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	716.886	0,66
EUR	575.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.63% 12/06/2023	577.489	0,53	GBP	1.095.000	B&m European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	1.270.842	1,18
EUR	400.000	Autostrade per l'Italia SpA 5.88% 09/06/2024	437.412	0,40	EUR	100.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	98.191	0,09
GBP	150.000	Autostrade per l'Italia SpA 6.25% 09/06/2022	178.854	0,17	EUR	614.799	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	618.747	0,57
EUR	419.000	Fis Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	399.120	0,37	EUR	214.000	Gamma Bondco Sarl 8.13% 15/11/2026	210.021	0,19
EUR	686.000	Gamma Bidco SpA 5.13% 15/07/2025	679.723	0,63					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
LUXEMBURGO (continuación)				PAÍSES BAJOS (continuación)					
EUR	590.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 6.75% 01/11/2025	588.846	0,54	EUR	246.000	Q-Park Holding I BV 1.50% 01/03/2025	231.710	0,21
GBP	143.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	168.455	0,16	EUR	500.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	504.947	0,47
EUR	350.000	Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	358.756	0,33	EUR	650.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	608.766	0,56
EUR	493.000	HSE Finance Sarl 5.63% 15/10/2026	468.260	0,43	EUR	440.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	440.144	0,41
EUR	130.000	Intralot Capital Lux 5.25% 15/09/2024	109.200	0,10			Total de Países Bajos	5.354.475	4,94
EUR	100.000	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	100.157	0,09					
EUR	800.000	Matterhorn Telecom SA 2.63% 15/09/2024	803.253	0,74					
EUR	375.000	PLT VII Finance sarl 4.63% 05/01/2026	371.701	0,34					
EUR	100.000	PLT VII Finance sarl 4.63% 05/01/2026	99.120	0,09					
EUR	322.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	316.512	0,29					
		Total de Luxemburgo	6.298.947	5,80					
MÉXICO				PANAMÁ					
EUR	385.000	Petroleos Mexicanos 2.50% 24/11/2022	385.409	0,36	EUR	200.000	Carnival Corp. 7.63% 01/03/2026	205.170	0,19
EUR	247.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 21/02/2024	247.969	0,23	EUR	212.000	Carnival Corp. 10.13% 01/02/2026	237.356	0,22
		Total de México	633.378	0,59			Total de Panamá	442.526	0,41
PAÍSES BAJOS				RUMANÍA					
EUR	610.000	Constellium SE 4.25% 15/02/2026	611.618	0,56	EUR	600.000	RCS & RDS SA 2.50% 05/02/2025	576.961	0,53
EUR	475.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	479.158	0,44			Total de Rumanía	576.961	0,53
EUR	366.000	Diebold Nixdorf Dutch Holding BV 9.00% 15/07/2025	378.799	0,35					
EUR	150.000	Intertrust Group BV 3.38% 15/11/2025	150.098	0,14					
EUR	327.273	Kongsberg Actuation Systems 5.00% 15/07/2025	325.582	0,30					
EUR	685.000	OI European Group BV 3.13% 15/11/2024	683.827	0,63					
EUR	475.000	Ppf Telecom Group BV 2.13% 31/01/2025	464.389	0,43					
EUR	468.000	PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	475.437	0,44					
PAÍSES BAJOS				ESPAÑA					
EUR	610.000	Constellium SE 4.25% 15/02/2026	611.618	0,56	EUR	200.000	Cellnex Finance Company SA 2.25% 12/04/2026	198.514	0,18
EUR	475.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	479.158	0,44	EUR	300.000	Cellnex Telecom SA 2.38% 16/01/2024	306.955	0,28
EUR	366.000	Diebold Nixdorf Dutch Holding BV 9.00% 15/07/2025	378.799	0,35	EUR	1.745.000	Gestamp Automocion SA 3.25% 30/04/2026	1.704.016	1,57
EUR	150.000	Intertrust Group BV 3.38% 15/11/2025	150.098	0,14	EUR	150.000	Grifols SA 1.63% 15/02/2025	145.883	0,13
EUR	327.273	Kongsberg Actuation Systems 5.00% 15/07/2025	325.582	0,30	EUR	1.920.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	1.913.328	1,77
EUR	685.000	OI European Group BV 3.13% 15/11/2024	683.827	0,63	EUR	500.000	Grupo Antolin-Irausa SA 3.38% 30/04/2026	439.281	0,41
EUR	475.000	Ppf Telecom Group BV 2.13% 31/01/2025	464.389	0,43	EUR	300.000	International Consolidated Airlines Group SA 2.75% 25/03/2025	286.561	0,26
EUR	468.000	PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	475.437	0,44			Total de España	4.994.538	4,60
PAÍSES BAJOS				SUECIA					
EUR	610.000	Constellium SE 4.25% 15/02/2026	611.618	0,56	EUR	400.000	Intrum AB 3.13% 15/07/2024	398.070	0,37
EUR	475.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	479.158	0,44	EUR	377.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	380.594	0,35
EUR	366.000	Diebold Nixdorf Dutch Holding BV 9.00% 15/07/2025	378.799	0,35	EUR	1.482.000	Verisure Holding AB 3.50% 15/05/2023	1.483.066	1,38
EUR	150.000	Intertrust Group BV 3.38% 15/11/2025	150.098	0,14			Total de Suecia	2.261.730	2,10
EUR	327.273	Kongsberg Actuation Systems 5.00% 15/07/2025	325.582	0,30					
EUR	685.000	OI European Group BV 3.13% 15/11/2024	683.827	0,63					
EUR	475.000	Ppf Telecom Group BV 2.13% 31/01/2025	464.389	0,43					
EUR	468.000	PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	475.437	0,44					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
REINO UNIDO				REINO UNIDO (continuación)					
GBP	300.000	Anglian Water Osprey Financing plc 5.00% 30/04/2023	363.027	0,34	GBP	736.300	Ladbroke Group Finance plc 5.13% 16/09/2022	879.703	0,81
GBP	879.000	Arqiva Broadcast Finance plc 6.75% 30/09/2023	1.043.625	0,96	GBP	235.000	Ladbroke Group Finance plc 5.13% 08/09/2023	283.656	0,26
GBP	406.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	391.858	0,36	GBP	200.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	232.296	0,21
GBP	245.000	Co-Operative Bank Finance FRN 06/04/2027	289.920	0,27	GBP	841.000	Marks & Spencer plc 4.25% 08/12/2023	1.004.060	0,93
GBP	124.000	Co-Operative Group Holdings FRN 08/07/2026	156.136	0,14	EUR	594.000	OTE plc 2.38% 18/07/2022	597.460	0,55
GBP	1.400.000	Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	1.663.982	1,55	EUR	304.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	305.959	0,28
EUR	289.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	284.666	0,26	GBP	400.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	473.975	0,44
EUR	565.000	EG Global Finance plc 3.63% 07/02/2024	553.348	0,51	GBP	271.000	Premier Foods Finance plc 3.50% 15/10/2026	299.426	0,28
USD	473.720	Enquest plc 7.00% 15/10/2023	419.222	0,39	GBP	369.000	Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	430.664	0,40
GBP	580.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	695.102	0,64	EUR	732.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	700.005	0,66
GBP	350.000	Heathrow Finance plc 5.25% 01/03/2024	408.510	0,38	EUR	400.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	401.866	0,37
GBP	366.000	Iceland Bondco plc 4.63% 15/03/2025	389.718	0,36	GBP	1.393.000	Travis Perkins 4.50% 07/09/2023	1.674.862	1,55
EUR	800.000	Ineos Finance plc 2.88% 01/05/2026	764.477	0,71	GBP	100.000	Travis Perkins plc 3.75% 17/02/2026	117.551	0,11
EUR	100.000	Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	98.327	0,09	EUR	975.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	940.029	0,87
EUR	482.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	456.649	0,42	GBP	651.000	William Hill plc 4.88% 07/09/2023	776.249	0,72
EUR	394.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	373.277	0,34	GBP	128.000	WM Morrison Supermarkets plc 4.63% 08/12/2023	154.523	0,14
GBP	357.000	Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	427.741	0,40	GBP	662.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	721.317	0,67
EUR	1.083.000	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	1.108.614	1,03	Total de Reino Unido			23.139.459	21,41
EUR	151.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	152.419	0,14	ESTADOS UNIDOS				
GBP	900.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	1.062.043	0,98	EUR	830.000	Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	841.827	0,78
GBP	934.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 3.88% 01/03/2023	1.097.394	1,02	EUR	290.000	Ball Corp. 0.88% 15/03/2024	288.187	0,27
EUR	140.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	142.830	0,13	EUR	515.000	Ball Corp. 4.38% 15/12/2023	544.618	0,50
EUR	177.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	182.224	0,17	EUR	404.000	Coty Inc. 4.00% 15/04/2023	404.670	0,37
GBP	543.000	Jerrold Finco plc 4.88% 15/01/2026	620.749	0,57	EUR	200.000	Ford Motor Credit Company LLC 1.51% 17/02/2023	200.644	0,19
					EUR	200.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.33% 25/11/2025	196.728	0,18
					GBP	391.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	449.049	0,41
					EUR	544.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	551.404	0,51

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*				
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)							
Bonos (continuación)				Bonos - convertibles (continuación)							
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESPAÑA							
EUR	123.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	125.057	0,12	EUR	500.000	International Consolidated Airlines Group SA 0.63% 17/11/2022	492.750	0,45		
GBP	470.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	557.374	0,51	Total de España			492.750	0,45		
EUR	464.000	Iqvia Inc. 1.75% 15/03/2026	453.502	0,42	Total de bonos - convertibles			835.405	0,77		
EUR	700.000	Iqvia Inc. 2.88% 15/09/2025	704.524	0,65	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				99.184.828	91,60	
GBP	977.000	MPT Operating Partnership 2.55% 05/12/2023	1.144.782	1,06	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente						
USD	260.000	Occidental Petroleum Corp. 5.88% 01/09/2025	248.486	0,23	Bonos						
USD	160.000	Occidental Petroleum Corp. 8.00% 15/07/2025	161.557	0,15	ESTADOS UNIDOS						
USD	75.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	80.035	0,07	USD	260.000	Occidental Petroleum Corp. 6.95% 01/07/2024	251.494	0,23		
EUR	300.000	Scientific Games International Inc. 3.38% 15/02/2026	305.084	0,28	Total de Estados Unidos			251.494	0,23		
EUR	131.000	Scientific Games International Inc. 5.50% 15/02/2026	134.766	0,12	Total de bonos				251.494	0,23	
EUR	2.029.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	2.021.898	1,87	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				251.494	0,23	
EUR	1.000.000	ZF North America Capital 2.75% 27/04/2023	1.019.084	0,94	Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario						
Total de Estados Unidos			10.433.276	9,63	Bonos						
Total de bonos			98.121.040	90,62	REINO UNIDO						
Valores respaldados por activos e hipotecas				Valores respaldados por activos e hipotecas							
FRANCIA				FRANCIA							
EUR	228.571	Iqera Group SAS FRN 30/09/2024	228.383	0,21	GBP	520.000	Bellis Acquisition Company 3.25% 16/02/2026	570.053	0,53		
Total de Francia			228.383	0,21	GBP	1.775.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	2.034.932	1,89		
Total de valores respaldados por activos e hipotecas				228.383	0,21	GBP	178.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	200.133	0,18	
Bonos - convertibles				Bonos - convertibles							
FRANCIA				FRANCIA							
EUR	10.988	Elis SA 0.00% 06/10/2023	342.655	0,32	GBP	755.000	Talktalk Telecom Group plc 3.88% 20/02/2025	779.546	0,72		
Total de Francia			342.655	0,32	Total de Reino Unido			3.584.664	3,32		
Total de bonos				98.121.040	90,62	Total de bonos				3.584.664	3,32
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				98.121.040	90,62	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				3.584.664	3,32

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
19.434	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	1.908.927	1,76
	Total de Irlanda	1.908.927	1,76
	Total de fondos	1.908.927	1,76
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	1.908.927	1,76
	Valor total de las inversiones	104.929.913	96,91

(Coste total: 107.038.786 EUR)

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*				
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)							
Bonos				Bonos (continuación)							
AUSTRIA				FRANCIA (continuación)							
EUR	400.000	Erste Group Bank AG 0.13% 17/05/2028	365.238	0,09	EUR	1.500.000	Air Liquide Finance SA 0.38% 27/05/2031	1.381.499	0,35		
EUR	100.000	Erste Group Bank AG 0.13% 17/05/2028	91.310	0,02	EUR	3.250.000	AXA SA FRN 07/10/2041	2.921.148	0,74		
EUR	2.000.000	Telekom Finanzmanagement GmbH 1.50% 07/12/2026	2.028.745	0,51	GBP	2.900.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.88% 26/10/2028	3.248.980	0,82		
EUR	600.000	Telekom Finanzmanagement GmbH 3.50% 04/07/2023	624.755	0,16	EUR	2.600.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.88% 18/06/2029	2.540.542	0,64		
Total de Austria			3.110.048	0,78	EUR	2.200.000	BNP Paribas 1.00% 17/04/2024	2.211.619	0,56		
BÉLGICA				EUR				2.200.000	BNP Paribas SA FRN 14/10/2027	2.076.086	0,52
EUR	400.000	Belfius Bank SA 0.38% 08/06/2027	375.519	0,09	EUR	3.600.000	BPCE SA 0.63% 26/09/2023	3.619.339	0,91		
EUR	700.000	Bpost SA 1.25% 11/07/2026	704.228	0,18	EUR	2.900.000	BPCE SA FRN 02/02/2034	2.765.297	0,70		
EUR	1.200.000	KBC Group NV FRN 16/06/2027	1.148.124	0,29	EUR	2.400.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/11/2026	2.310.880	0,58		
EUR	1.600.000	KBC Group NV 0.88% 27/06/2023	1.617.020	0,41	EUR	1.500.000	Caisse des Depots et Consignations 0.01% 15/09/2025	1.470.173	0,37		
EUR	900.000	Vgp NV 1.63% 17/01/2027	837.636	0,21	EUR	1.500.000	Caisse des Depots et Consignations 0.01% 01/06/2026	1.455.724	0,37		
Total de Bélgica			4.682.527	1,18	EUR	2.000.000	Carrefour SA 2.63% 15/12/2027	2.075.605	0,52		
DINAMARCA				EUR				1.500.000	CNP Assurances FRN 27/07/2050	1.413.614	0,36
EUR	1.200.000	Nykredit Realkredit A/S 0.75% 20/01/2027	1.145.426	0,29	USD	1.600.000	CNP Assurances Perp FRN	1.320.636	0,33		
EUR	600.000	Nykredit Realkredit A/S 0.88% 17/01/2024	600.228	0,15	EUR	9.100.000	Credit Agricole SA 0.13% 09/12/2027	8.367.286	2,10		
EUR	550.000	Nykredit Realkredit AS 0.38% 17/01/2028	502.697	0,13	EUR	1.200.000	Credit Agricole SA FRN 21/09/2029	1.102.728	0,28		
EUR	1.200.000	Nykredit Realkredit AS FRN 28/07/2031	1.137.273	0,29	USD	500.000	Credit Agricole SA Perp FRN	474.936	0,12		
GBP	900.000	Orsted A/S 2.13% 17/05/2027	1.053.273	0,27	EUR	2.600.000	Credit Mutuel Arkea SA 0.38% 03/10/2028	2.404.050	0,61		
GBP	900.000	Orsted A/S 2.50% 16/05/2033	1.045.484	0,26	EUR	1.000.000	Credit Mutuel Arkea SA FRN 11/06/2029	969.150	0,24		
EUR	1.300.000	Orsted AS FRN 09/12/3019	1.245.602	0,31	EUR	4.300.000	Danone SA 1.00% 26/03/2025	4.318.818	1,09		
EUR	700.000	Orsted AS FRN 24/11/3017	705.957	0,18	EUR	700.000	Electricite de France SA 1.00% 29/11/2033	634.812	0,16		
Total de Dinamarca			7.435.940	1,88	EUR	300.000	Electricite de France SA 1.00% 29/11/2033	272.062	0,07		
FINLANDIA				EUR				1.100.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	952.449	0,24
EUR	1.400.000	Elenia Finance Oyj 0.38% 06/02/2027	1.307.327	0,33	EUR	675.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	691.481	0,17		
EUR	900.000	OP Corporate Bank plc 0.38% 26/02/2024	895.795	0,23	EUR	800.000	Ile-de-France Mobilites 0.40% 28/05/2031	751.730	0,19		
EUR	500.000	OP Corporate Bank plc 0.60% 18/01/2027	478.180	0,12	EUR	3.400.000	La Banque Postale SA 0.75% 23/06/2031	3.003.731	0,76		
Total de Finlandia			2.681.302	0,68	EUR	700.000	La Banque Postale SA FRN 02/08/2032	629.807	0,16		
FRANCIA				EUR				400.000	La Banque Postale SA Perp FRN	387.092	0,10
EUR	3.000.000	Action Logement SE 0.50% 30/10/2034	2.690.263	0,68	EUR	800.000	La Poste SA 1.38% 21/04/2032	784.266	0,20		
				EUR				4.800.000	Orange SA 0.13% 16/09/2029	4.385.495	1,10
				EUR				1.200.000	Orange SA Perp FRN	1.284.289	0,32

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
FRANCIA (continuación)				ALEMANIA (continuación)					
EUR	700.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	706.130	0,18	GBP	1.500.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 1.88% 13/02/2026	1.764.076	0,44
EUR	800.000	Regie Autonome des Transports Parisiens 0.88% 25/05/2027	798.776	0,20	EUR	2.300.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	2.316.325	0,58
EUR	1.100.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 0.75% 12/01/2034	999.140	0,25	EUR	1.700.000	Deutsche Bank AG FRN 23/02/2028	1.674.793	0,42
EUR	700.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 1.88% 23/10/2037	696.746	0,18	EUR	425.000	Deutsche Kreditbank AG 0.01% 07/11/2029	391.215	0,10
EUR	2.800.000	Sanofi 1.50% 01/04/2030	2.854.930	0,72	EUR	600.000	Deutsche Kreditbank AG 0.88% 02/10/2028	594.340	0,15
EUR	1.500.000	Schneider Electric SE 1.84% 13/10/2025	1.545.343	0,39	EUR	1.700.000	E.ON SE 0.35% 28/02/2030	1.557.774	0,39
EUR	300.000	SNCF Reseau 2.25% 20/12/2047	334.679	0,08	EUR	915.000	E.ON SE 0.60% 01/10/2032	818.690	0,21
EUR	1.600.000	SNCF SA 0.63% 17/04/2030	1.538.176	0,39	EUR	1.985.000	E.ON SE 0.60% 01/10/2032	1.776.064	0,45
EUR	1.100.000	Societe du Grand Paris 1.63% 08/04/2042	1.114.144	0,28	EUR	300.000	E.ON SE 0.88% 08/01/2025	299.562	0,08
EUR	900.000	Societe Generale SA FRN 02/12/2027	853.672	0,22	EUR	2.000.000	E.ON SE 1.63% 29/03/2031	2.002.920	0,49
EUR	2.500.000	Societe Generale SA FRN 02/12/2027	2.371.312	0,60	EUR	3.800.000	Eurogrid GmbH 1.11% 15/05/2032	3.558.945	0,89
EUR	1.500.000	Unedic Asseo 0.25% 25/11/2029	1.415.203	0,36	EUR	1.200.000	Eurogrid GmbH 1.63% 03/11/2023	1.220.326	0,31
EUR	950.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.00% 14/03/2025	942.566	0,24	EUR	300.000	Hamburger Hochbahn AG 0.13% 24/02/2031	270.697	0,07
EUR	1.000.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE Perp FRN	966.573	0,24	EUR	600.000	Hamburger Hochbahn AG 0.13% 24/02/2031	541.395	0,14
		Total de Francia	82.052.977	20,69	EUR	1.000.000	Landesbank Baden- Wuerttemberg 0.38% 21/02/2031	879.197	0,22
					EUR	250.000	Mercedes-Benz Group AG 0.75% 10/09/2030	234.624	0,06
					EUR	750.000	Mercedes-Benz Group AG 0.75% 10/09/2030	703.873	0,18
					EUR	3.800.000	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG FRN 26/05/2041	3.397.776	0,85
ALEMANIA					EUR	1.000.000	NRW Bank 0.10% 09/07/2035	851.518	0,21
EUR	1.100.000	Allianz SE FRN 08/07/2050	1.063.257	0,27	EUR	1.900.000	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 05/07/2025	1.930.734	0,49
EUR	1.000.000	Allianz SE FRN 08/07/2050	966.597	0,24	EUR	1.900.000	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 05/07/2025	1.930.734	0,49
EUR	1.500.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	1.262.002	0,32	EUR	500.000	Vantage Towers AG 0.38% 31/03/2027	468.593	0,12
EUR	900.000	Bayerische Landesbode 0.25% 21/03/2036	780.705	0,20	EUR	300.000	Vantage Towers AG 0.38% 31/03/2027	281.156	0,07
EUR	1.100.000	Bayerische Landesbodenkreditanstalt 0.63% 22/11/2027	1.076.900	0,27	EUR	900.000	Vantage Towers AG 0.75% 31/03/2030	807.574	0,20
EUR	2.200.000	Commerzbank AG FRN 24/03/2026	2.153.675	0,54	EUR	100.000	Vantage Towers AG 0.75% 31/03/2030	89.730	0,02
EUR	200.000	Commerzbank AG 1.25% 23/10/2023	201.625	0,05	EUR	400.000	Vier Gas Transport GmbH 0.13% 10/09/2029	352.405	0,09
EUR	1.500.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 0.35% 29/09/2031	1.378.112	0,35					
EUR	600.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 0.63% 08/12/2050	454.583	0,11					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ALEMANIA (continuación)				ITALIA (continuación)					
EUR	1.600.000	Vonovia SE 1.38% 28/01/2026	1.590.534	0,40	EUR	200.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale Perp FRN	191.466	0,05
EUR	2.000.000	Vonovia SE 1.88% 28/06/2028	1.986.428	0,51					
		Total de Alemania	43.629.454	10,98			Total de Italia	14.400.781	3,64
IRLANDA				LUXEMBURGO					
EUR	900.000	AIB Group plc FRN 17/11/2027	840.858	0,21	EUR	2.750.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	2.729.727	0,69
EUR	1.500.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	1.482.260	0,37	EUR	400.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 12/02/2036	353.089	0,09
EUR	1.000.000	Bank of Ireland Group FRN 10/05/2027	930.932	0,23	EUR	850.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	700.471	0,18
EUR	800.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	742.950	0,19	EUR	600.000	CPI Property Group SA 1.75% 14/01/2030	522.623	0,13
EUR	600.000	ESB Finance DAC 1.00% 19/07/2034	553.724	0,14	EUR	900.000	CPI Property Group SA 2.75% 12/05/2026	902.363	0,23
EUR	150.000	ESB Finance DAC 1.13% 11/06/2030	145.672	0,04	EUR	2.800.000	Holcim Finance Luxembourg SA 0.50% 23/04/2031	2.427.772	0,61
EUR	1.250.000	Kerry Group Financial Services 0.88% 01/12/2031	1.139.825	0,29	EUR	1.259.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	1.153.971	0,29
EUR	800.000	Lunar Funding V for Swisscom AG 1.13% 12/10/2026	797.530	0,20	EUR	141.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	129.237	0,03
		Total de Irlanda	6.633.751	1,67	EUR	500.000	Prologis International Funding II SA 1.63% 17/06/2032	472.371	0,12
ITALIA				PAÍSES BAJOS					
EUR	700.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	641.903	0,16	EUR	1.300.000	ABN Amro Bank NV 0.88% 22/04/2025	1.305.915	0,33
EUR	700.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	641.903	0,16	EUR	1.100.000	Achmea BV 1.50% 26/05/2027	1.109.333	0,28
EUR	1.100.000	Assicurazioni Generali SpA 1.71% 30/06/2032	971.838	0,24	EUR	900.000	Allianz Finance II BV 0.00% 22/11/2026	861.317	0,22
EUR	2.425.000	Assicurazioni Generali SpA 2.12% 01/10/2030	2.328.014	0,59	EUR	2.100.000	Allianz Finance II BV 1.50% 15/01/2030	2.097.217	0,53
EUR	500.000	Banco BPM SpA 0.88% 15/07/2026	469.431	0,12	EUR	800.000	Cooperatieve Rabobank UA 0.25% 30/10/2026	768.387	0,19
EUR	1.100.000	ERG SpA 1.88% 11/04/2025	1.108.562	0,28	GBP	1.000.000	Cooperatieve Rabobank UA 4.63% 23/05/2029	1.284.621	0,32
EUR	1.200.000	Ferrovie dello Stato 1.50% 27/06/2025	1.218.915	0,31	EUR	600.000	Cooperatieve Rabobank UA Perp FRN	543.602	0,14
EUR	1.200.000	Ferrovie dello Stato Italiane SpA 1.13% 09/07/2026	1.185.899	0,30	EUR	200.000	Cooperatieve Rabobank UA Perp FRN	201.850	0,05
EUR	2.200.000	Intesa Sanpaolo SpA 0.75% 04/12/2024	2.188.076	0,55	EUR	1.000.000	Cooperatieve Rabobank UA Perp FRN	1.009.252	0,25
EUR	1.600.000	Snam SpA 0.00% 07/12/2028	1.425.879	0,36					
EUR	200.000	Snam SpA 0.75% 17/06/2030	183.168	0,05					
EUR	1.600.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.38% 23/06/2029	1.462.795	0,37					
EUR	400.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale Perp FRN	382.932	0,10					
		Total de Luxemburgo	10.288.558	2,59					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
PAÍSES BAJOS (continuación)				PAÍSES BAJOS (continuación)					
EUR	200.000	De Volksbank NV 0.38% 03/03/2028	182.021	0,05	EUR	2.200.000	Swisscom Finance BV 0.38% 14/11/2028	2.082.727	0,52
EUR	3.700.000	De Volksbank NV FRN 22/10/2030	3.647.307	0,92	EUR	600.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	520.407	0,13
EUR	2.300.000	Digital Dutch Finco BV 0.63% 15/07/2025	2.225.725	0,56	EUR	100.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	86.735	0,02
EUR	1.450.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	1.337.107	0,34	EUR	800.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	753.027	0,19
EUR	1.870.000	Digital Intrepid Holding BV 0.63% 15/07/2031	1.555.006	0,39	EUR	500.000	Tennet Holding BV 0.50% 30/11/2040	385.933	0,10
EUR	1.000.000	EDP Finance BV 1.88% 21/09/2029	1.004.379	0,25	EUR	1.393.000	TenneT Holding BV 0.88% 16/06/2035	1.231.450	0,31
EUR	300.000	EnBW International Finance BV 1.88% 31/10/2033	289.000	0,07	EUR	1.969.000	Tennet Holding BV Perp FRN	2.014.946	0,51
EUR	2.000.000	Enel Finance International NV 1.50% 21/07/2025	2.029.340	0,50	EUR	3.500.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	3.306.430	0,83
EUR	1.500.000	Enexis Holding NV 0.38% 14/04/2033	1.314.413	0,33	EUR	7.500.000	Volkswagen International Finance NV 0.88% 22/09/2028	7.032.133	1,76
EUR	1.029.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	936.724	0,24			Total de Países Bajos	54.915.248	13,81
EUR	221.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	201.182	0,05			NORUEGA		
EUR	1.000.000	GSK Consumer Healthcare Capital 1.75% 29/03/2030	1.009.261	0,25	EUR	200.000	Avinor AS 0.75% 01/10/2030	184.298	0,05
EUR	1.100.000	Iberdrola International BV Perp FRN	1.001.825	0,25	EUR	1.050.000	Avinor AS 0.75% 01/10/2030	967.566	0,24
EUR	500.000	Iberdrola International BV Perp FRN	504.754	0,13	EUR	1.850.000	Avinor AS 1.00% 29/04/2025	1.849.527	0,46
EUR	300.000	Iberdrola International BV Perp FRN	305.825	0,08	EUR	200.000	Avinor AS 1.25% 09/02/2027	198.751	0,05
EUR	500.000	Iberdrola International BV Perp FRN	516.570	0,13	EUR	840.000	Dnb Bank ASA FRN 18/01/2028	799.871	0,20
GBP	2.000.000	ING Groep NV FRN 07/12/2028	2.122.492	0,53			Total de Noruega	4.000.013	1,00
EUR	1.600.000	ING Groep NV 2.50% 15/11/2030	1.689.508	0,43			ESPAÑA		
EUR	100.000	NE Property BV 3.38% 14/07/2027	99.358	0,03	EUR	1.600.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.75% 04/06/2025	1.592.396	0,40
EUR	600.000	NE Property BV 3.38% 14/07/2027	596.145	0,15	EUR	1.000.000	Banco de Sabadell SA FRN 11/03/2027	973.203	0,25
EUR	100.000	NederFinMaat 0.13% 03/04/2027	95.977	0,02	EUR	1.300.000	Banco Santander SA 0.30% 04/10/2026	1.243.546	0,31
EUR	900.000	Royal Schiphol Group NV 1.50% 05/11/2030	894.632	0,23	EUR	1.100.000	Banco Santander SA 1.13% 23/06/2027	1.071.938	0,27
EUR	300.000	Royal Schiphol Group NV 2.00% 06/04/2029	310.987	0,08	EUR	4.200.000	Caixabank SA FRN 21/01/2028	3.992.068	1,01
EUR	1.000.000	Stedin Holding NV 0.00% 16/11/2026	942.351	0,24	EUR	300.000	Caixabank SA FRN 18/06/2031	283.171	0,07
EUR	3.400.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	3.157.060	0,79	EUR	1.000.000	CaixaBank SA FRN 26/05/2028	940.177	0,24
EUR	364.000	Stedin Holding NV Perp FRN	351.017	0,09	EUR	2.300.000	Iberdrola Finanzas SA 1.38% 11/03/2032	2.288.992	0,57
					EUR	300.000	Red Electrica Financiaciones Sau 0.38% 24/07/2028	287.210	0,07
					EUR	1.300.000	Telefonica Emisiones SA 1.07% 05/02/2024	1.315.895	0,33
					GBP	400.000	Telefonica Emisiones SA 5.45% 08/10/2029	550.090	0,14
							Total de España	14.538.686	3,66

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
SUECIA				REINO UNIDO (continuación)					
EUR	1.500.000	Essity AB 1.13% 27/03/2024	1.512.485	0,38	EUR	200.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	181.724	0,05
EUR	800.000	Svenska Handelsbanken AB 0.01% 02/12/2027	738.919	0,19	GBP	200.000	Nationwide Building Society Perp FRN	239.613	0,06
EUR	100.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	100.399	0,03	GBP	500.000	Nationwide Building Society Perp FRN	602.628	0,15
EUR	500.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	501.995	0,13	EUR	5.000.000	Natwest Group plc FRN 26/02/2030	4.612.954	1,15
Total de Suecia			2.853.798	0,73	GBP	354.000	Natwest Group plc FRN 09/11/2028	393.836	0,10
SUIZA				EUR 200.000 NGG Finance plc FRN 05/09/2082				187.159	0,05
EUR	1.000.000	Credit Suisse AG 0.45% 19/05/2025	975.565	0,25	GBP	200.000	Orbit Capital plc 2.00% 24/11/2038	207.064	0,05
Total de Suiza			975.565	0,25	GBP	500.000	Paragon Treasury plc 2.00% 07/05/2036	532.041	0,13
REINO UNIDO				GBP 900.000 Pearson Funding plc 3.75% 04/06/2030				1.083.262	0,27
GBP	600.000	Aster Treasury plc 1.41% 27/01/2036	593.436	0,15	GBP	450.000	Platform HG Financing plc 1.93% 15/09/2041	459.582	0,12
EUR	2.100.000	AstraZeneca plc 0.38% 03/06/2029	1.952.505	0,49	GBP	400.000	RCB Bonds plc 3.50% 08/12/2031	456.062	0,11
GBP	100.000	Blend Funding plc 2.92% 05/04/2054	117.550	0,03	EUR	1.100.000	Rentokil Initial plc 0.50% 14/10/2028	996.195	0,25
GBP	200.000	Blend Funding plc 3.46% 21/09/2049	256.049	0,06	GBP	1.000.000	RI Finance FRN 30/11/2043	1.242.610	0,31
GBP	200.000	BUPA Finance plc 1.75% 14/06/2027	227.234	0,06	GBP	625.000	RI Finance Bonds No 4 plc FRN 07/10/2049	742.397	0,19
GBP	800.000	BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	1.015.493	0,25	GBP	500.000	Severn Trent Utilities Finance plc 2.00% 02/06/2040	505.588	0,13
EUR	875.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	792.592	0,20	GBP	230.000	Severn Trent Utilities Finance plc 2.63% 22/02/2033	266.634	0,07
EUR	125.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	113.227	0,03	GBP	1.100.000	Stonewater Funding plc 1.63% 10/09/2036	1.122.886	0,28
EUR	100.000	Cadent Finance plc 0.75% 11/03/2032	88.817	0,02	EUR	1.790.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	1.701.420	0,43
GBP	300.000	Cardiff University 3.00% 07/12/2055	379.303	0,09	GBP	500.000	Thames Water Utilities Finance plc 1.88% 24/01/2024	587.122	0,15
GBP	630.000	Ds Smith plc 2.88% 26/07/2029	730.449	0,18	GBP	1.000.000	Thames Water Utilities Finance plc 2.38% 22/04/2040	1.035.180	0,26
GBP	400.000	DWR Cymru Financing UK plc 2.38% 31/03/2034	435.599	0,11	GBP	240.000	United Utilities Wat 0.88% 28/10/2029	253.556	0,06
GBP	100.000	Guinness Partnership Limited 2.00% 22/04/2055	99.010	0,02	GBP	200.000	University College London 1.63% 04/06/2061	191.348	0,05
USD	1.500.000	HSBC Holdings plc FRN 22/11/2023	1.352.577	0,34	GBP	300.000	University of Southampton 2.25% 11/04/2057	320.017	0,08
GBP	600.000	Legal & General Group plc FRN 27/10/2045	757.205	0,19	EUR	500.000	Vodafone Group plc 0.90% 24/11/2026	497.165	0,13
EUR	3.800.000	Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	3.504.629	0,88	USD	1.000.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	927.742	0,23
EUR	1.500.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.19% 20/01/2025	1.467.508	0,37					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Bonos (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)			
REINO UNIDO (continuación)				FRANCIA			
GBP	200.000 Wellcome Trust Limited 1.50% 14/07/2071	180.033	0,05	EUR	400.000 Agence France Locale 0.20% 20/03/2029	378.025	0,10
EUR	8.935.000 WellCome Trust Limited 1.13% 21/01/2027	9.018.765	2,27	EUR	1.000.000 Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/02/2028	947.061	0,24
	Total de Reino Unido	42.427.766	10,65	EUR	1.200.000 Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/11/2030	1.090.776	0,27
ESTADOS UNIDOS				GBP	1.200.000 Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.13% 15/12/2025	1.334.622	0,34
USD	225.000 Astrazeneca Finance LLC 2.25% 28/05/2031	188.573	0,05	USD	300.000 Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 2.13% 26/01/2032	256.697	0,06
EUR	1.000.000 Becton Dickinson and Company 1.40% 24/05/2023	1.012.030	0,25	EUR	300.000 Caisse Francaise de Financement Local 0.01% 07/05/2025	292.596	0,07
USD	1.100.000 Becton Dickinson and Company 2.82% 20/05/2030	941.705	0,24	EUR	1.100.000 Caisse Francaise de Financement Local 0.50% 19/02/2027	1.074.123	0,27
EUR	1.000.000 Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	1.024.019	0,26	EUR	2.100.000 City of Paris France 1.38% 20/11/2034	2.105.591	0,52
EUR	1.075.000 Prologis Euro Finance LLC 0.38% 06/02/2028	997.574	0,26	EUR	150.000 France (Govt of) OAT 1.75% 25/06/2039	164.103	0,04
USD	2.600.000 Roche Holdings Inc. 2.38% 28/01/2027	2.276.402	0,58	EUR	1.200.000 Region of Ile de France 0.00% 20/04/2028	1.136.292	0,29
	Total de Estados Unidos	6.440.303	1,64	EUR	700.000 Region of Ile de France 0.50% 14/06/2025	698.964	0,18
Total de bonos		301.066.717	75,83	EUR	400.000 Region of Ile de France 0.61% 02/07/2040	343.662	0,09
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				EUR	700.000 SNCF SA 1.00% 19/01/2061	502.631	0,13
AUSTRIA				EUR	600.000 Societe du Grand Paris EPIC 0.00% 25/11/2030	546.762	0,14
EUR	700.000 Oesterreichische Kontrollbank AG 0.00% 08/10/2026	669.050	0,17	EUR	100.000 Societe du Grand Paris EPIC 1.70% 25/05/2050	101.873	0,03
	Total de Austria	669.050	0,17	EUR	2.500.000 Unedic Asseo 0.00% 25/11/2028	2.352.922	0,59
BÉLGICA				EUR	1.700.000 Unedic Asseo 0.00% 19/11/2030	1.549.168	0,39
EUR	275.000 Belgium (Govt of) 1.25% 22/04/2033	283.355	0,07	EUR	1.200.000 Unedic Asseo 0.10% 25/11/2026	1.159.037	0,29
EUR	1.500.000 Communaute Francaise de Belgique 0.63% 11/06/2035	1.352.072	0,34	Total de Francia		16.034.905	4,04
EUR	1.400.000 Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap 0.38% 15/04/2030	1.336.872	0,34	ALEMANIA			
EUR	1.800.000 Region Wallonne Belgium 1.05% 22/06/2040	1.627.870	0,41	EUR	1.650.000 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.00% 15/08/2030	1.593.405	0,40
	Total de Bélgica	4.600.169	1,16	EUR	725.000 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.00% 15/08/2050	612.000	0,15
FINLANDIA				EUR	100.000 Free and Hanseatic City of Hamburg 0.30% 16/09/2050	77.869	0,02
EUR	1.700.000 Kuntarahoitus Oyj 0.05% 10/09/2035	1.446.390	0,35	EUR	3.200.000 Landwirtschaftliche Rentenbank 0.00% 22/09/2027	3.059.968	0,77
	Total de Finlandia	1.446.390	0,35	EUR	500.000 State of Hesse 0.01% 18/06/2031	454.494	0,11

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)						
ALEMANIA (continuación)				PAÍSES BAJOS (continuación)						
EUR	1.475.000	State of North Rhine-Westphalia Germany 0.60% 04/06/2041	1.290.611	0,33	EUR	650.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 1.50% 15/06/2039	669.057	0,17	
EUR	600.000	State of North Rhine-Westphalia Germany 0.95% 13/03/2028	601.294	0,15	EUR	235.000	Netherlands (Govt of) 0.50% 15/01/2040	221.920	0,06	
Total de Alemania				1,93	Total de Países Bajos				2.395.679	0,61
HUNGRÍA					POLONIA					
EUR	250.000	MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt 1.38% 24/06/2025	249.265	0,06	EUR	500.000	Poland (Govt of) 1.13% 07/08/2026	499.769	0,13	
Total de Hungría				0,06	Total de Polonia				499.769	0,13
IRLANDA					ESPAÑA					
EUR	25.000	Ireland (Govt of) 1.35% 18/03/2031	26.111	0,01	EUR	1.500.000	Autonomous Community of Andalusia 0.50% 30/04/2031	1.374.804	0,35	
GBP	325.000	NIE Finance plc 6.38% 02/06/2026	444.890	0,11	EUR	1.400.000	Autonomous Community of Madrid 0.42% 30/04/2030	1.310.491	0,33	
Total de Irlanda				0,12	EUR	700.000	Autonomous Community of Madrid 1.57% 30/04/2029	720.219	0,18	
ITALIA					EUR	200.000	Basque (Govt) 0.25% 30/04/2031	181.894	0,05	
EUR	1.900.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 0.75% 21/11/2022	1.913.372	0,48	EUR	3.200.000	Community of Madrid 1.72% 30/04/2032	3.265.794	0,82	
EUR	800.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 1.00% 11/02/2030	750.876	0,19	EUR	1.500.000	Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2025	1.478.445	0,37	
EUR	1.200.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 1.50% 20/04/2023	1.221.258	0,31	EUR	200.000	Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2025	197.126	0,05	
EUR	700.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 2.00% 20/04/2027	723.233	0,18	EUR	700.000	Instituto de Credito Oficial 0.25% 30/04/2024	700.415	0,18	
EUR	2.200.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 2.13% 21/03/2026	2.287.083	0,58	EUR	3.100.000	Instituto de Credito Oficial 0.75% 31/10/2023	3.130.521	0,79	
EUR	315.000	Italy (Govt of) 1.50% 30/04/2045	268.677	0,07	EUR	25.000	Spain (Govt of) 1.00% 30/07/2042	21.655	0,01	
Total de Italia				1,81	EUR	400.000	Xunta de Galicia 0.08% 30/07/2027	380.326	0,10	
LUXEMBURGO					Total de España				12.761.690	3,23
EUR	775.000	Luxembourg (Govt of) 0.00% 14/09/2032	691.846	0,17	SUPRANACIONAL					
Total de Luxemburgo				0,17	EUR	2.200.000	African Development Bank 0.25% 21/11/2024	2.179.365	0,55	
PAÍSES BAJOS					USD	350.000	African Development Bank 0.75% 03/04/2023	310.851	0,08	
EUR	1.000.000	Bank Nederlandse Gemeenten NV 0.05% 13/07/2024	989.577	0,25	CAD	300.000	Asian Development Bank 1.50% 04/05/2028	200.206	0,05	
EUR	600.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 0.13% 03/09/2035	515.125	0,13	CAD	800.000	Asian Development Bank 1.63% 28/01/2025	559.238	0,14	
					EUR	1.450.000	Council of Europe 0.38% 27/03/2025	1.438.851	0,36	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					
SUPRANACIONAL (continuación)				REINO UNIDO (continuación)					
EUR	1.800.000	Council of Europe Development Bank 0.00% 10/04/2026	1.746.872	0,44	USD	1.800.000	International Finance Facility for Immunisation Company 1.00% 21/04/2026	1.516.178	0,38
EUR	4.000.000	Council of Europe Development Bank 0.00% 09/04/2027	3.835.845	0,96	GBP	5.000	United Kingdom Gilt 0.88% 31/07/2033	5.421	0,00
EUR	300.000	Eurofima 0.50% 23/04/2041	252.279	0,06			Total de Reino Unido	5.335.405	1,34
EUR	3.000.000	European Investment Bank 0.00% 15/05/2028	2.850.743	0,72			Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda	84.430.037	21,27
GBP	975.000	European Investment Bank 0.88% 15/05/2026	1.113.435	0,28			Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	385.496.754	97,10
EUR	3.750.000	European Union 0.00% 02/06/2028	3.563.455	0,90			Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		
EUR	250.000	European Union 0.00% 04/07/2035	213.280	0,05			Bonos		
EUR	700.000	European Union 0.00% 04/07/2035	597.183	0,15			FRANCIA		
EUR	1.650.000	European Union 0.10% 04/10/2040	1.330.400	0,34	USD	700.000	Credit Agricole 2.81% 11/01/2041	520.654	0,13
EUR	2.800.000	European Union 0.30% 04/11/2050	2.142.673	0,54	USD	1.055.000	Credit Agricole SA Perp FRN	861.598	0,22
EUR	399.000	IBRD 0.20% 21/01/2061	272.678	0,07			Total de Francia	1.382.252	0,35
GBP	250.000	Inter-American Development Bank 0.50% 15/09/2026	279.619	0,07			PAÍSES BAJOS		
EUR	500.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.01% 24/04/2028	472.060	0,12	USD	550.000	Cooperatieve Rabobank UA 1.00% 24/09/2026	455.449	0,11
EUR	100.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.70% 22/10/2046	87.826	0,02			Total de Países Bajos	455.449	0,11
EUR	300.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.70% 22/10/2046	263.477	0,07			Total de bonos	1.837.701	0,46
USD	210.000	International Bank for Reconstruction & Development 1.13% 13/09/2028	172.850	0,04			Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente	1.837.701	0,46
SEK	3.000.000	Nordic Investment Bank 0.10% 13/10/2025	273.257	0,07			Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario		
		Total de supranacional	24.156.443	6,08			Bonos		
		SUECIA					FRANCIA		
SEK	3.000.000	Sweden (Govt of) 0.13% 09/09/2030	264.285	0,07	USD	1.000.000	BPCE SA FRN 14/01/2037	841.058	0,21
		Total de Suecia	264.285	0,07			Total de Francia	841.058	0,21
		REINO UNIDO					Total de bonos	841.058	0,21
USD	4.375.000	International Finance Facility for Immunisation Company 0.38% 06/11/2023	3.813.806	0,96			Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	841.058	0,21

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
42.799	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	4.204.024	1,06
	Total de Irlanda	4.204.024	1,06
	Total de fondos	4.204.024	1,06
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	4.204.024	1,06
	Valor total de las inversiones	392.379.537	98,83

(Coste total: 417.737.065 EUR)

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
AUSTRALIA				FRANCIA (continuación)					
EUR	823.000	APT Pipelines Limited 1.25% 15/03/2033	723.651	0,39	EUR	431.000	Casino Guichard Perrachon SA 5.25% 15/04/2027	368.664	0,20
EUR	935.000	APT Pipelines Limited 2.00% 15/07/2030	915.030	0,49	EUR	484.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	442.405	0,24
EUR	418.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	368.420	0,20	EUR	480.000	Chrome Holding SASU 5.00% 31/05/2029	447.504	0,24
GBP	840.000	Pacific National Finance Pty Limited 5.00% 19/09/2023	1.025.325	0,55	EUR	1.112.000	Constellium SE 3.13% 15/07/2029	1.024.307	0,54
		Total de Australia	3.032.426	1,63	EUR	800.000	Credit Agricole SA FRN 21/09/2029	735.152	0,39
BÉLGICA				FRANCIA (continuación)					
EUR	619.000	Anheuser-Busch InBev SA 3.70% 02/04/2040	746.294	0,40	EUR	1.600.000	Credit Agricole SA 1.13% 24/02/2029	1.567.472	0,84
EUR	400.000	Kbc Group NV Perp FRN	394.692	0,21	EUR	600.000	Electricite de France SA Perp FRN	538.985	0,29
EUR	800.000	Vgp NV 1.63% 17/01/2027	744.566	0,40	EUR	600.000	Electricite de France SA Perp FRN	540.769	0,29
		Total de Bélgica	1.885.552	1,01	EUR	431.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	394.197	0,21
CANADÁ				FRANCIA (continuación)					
EUR	299.000	Primo Water Holdings Inc. 3.88% 31/10/2028	279.231	0,15	EUR	552.000	Emeria SASU 3.38% 31/03/2028	520.894	0,28
		Total de Canadá	279.231	0,15	EUR	357.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2027	319.466	0,17
ISLAS CAIMÁN				FRANCIA (continuación)					
USD	1.089.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	914.686	0,49	EUR	687.000	Faurecia SE 2.75% 15/02/2027	629.586	0,34
USD	800.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	706.242	0,38	EUR	677.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	693.530	0,37
GBP	3.235.000	Southern Water Services Limited 2.38% 28/05/2028	3.742.123	2,00	EUR	300.000	Holding d'infrastructures de Transport SASU 1.48% 18/01/2031	283.882	0,15
USD	534.000	Tencent Holdings Limited 3.24% 03/06/2050	375.677	0,20	EUR	1.061.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	1.075.718	0,59
EUR	460.000	UPCB Finance VII 3.63% 15/06/2029	452.428	0,24	EUR	200.000	Iliad SA 0.75% 11/02/2024	193.843	0,10
		Total de Islas Caimán	6.191.156	3,31	EUR	200.000	Iliad SA 1.50% 14/10/2024	194.940	0,10
FRANCIA				FRANCIA (continuación)					
EUR	152.000	Altice France SA 3.38% 15/01/2028	138.218	0,07	EUR	377.000	Iqera Group SAS 4.25% 30/09/2024	372.834	0,20
EUR	171.000	Altice France SA 4.00% 15/07/2029	154.313	0,08	EUR	202.000	Laboratoire Eimer Selas 5.00% 01/02/2029	188.836	0,10
EUR	707.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	643.249	0,34	EUR	270.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	272.365	0,15
EUR	1.000.000	BNP Paribas SA FRN 11/07/2030	925.865	0,50	EUR	383.000	Picard Groupe SAS 3.88% 01/07/2026	372.833	0,20
EUR	1.000.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	866.906	0,46	EUR	314.000	Rexel SA 2.13% 15/12/2028	297.322	0,16
					EUR	1.700.000	Sanef SA 1.88% 16/03/2026	1.708.332	0,92
					EUR	200.000	Valeo 1.00% 03/08/2028	174.936	0,09
					EUR	500.000	Verallia SA 1.63% 14/05/2028	467.244	0,25
					EUR	600.000	Verallia SA 1.88% 10/11/2031	530.519	0,28
							Total de Francia	17.085.086	9,14
				ALEMANIA					
				EUR	800.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	760.626	0,41	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ALEMANIA (continuación)				ALEMANIA (continuación)					
EUR	700.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	657.719	0,36	EUR	700.000	Vonovia SE 1.88% 28/06/2028	695.250	0,37
EUR	1.400.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	1.177.869	0,63	Total de Alemania				
EUR	1.200.000	Bayer AG 1.13% 06/01/2030	1.124.927	0,61	15.987.410 8,59				
EUR	477.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	463.917	0,25	INDIA				
EUR	131.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	129.700	0,07	USD	1.328.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	1.151.050	0,62
EUR	1.000.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	1.024.833	0,55	USD	2.100.000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	1.730.870	0,93
EUR	500.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	468.020	0,25	Total de India				
EUR	200.000	Deutsche Bank AG Perp FRN	204.764	0,11	2.881.920 1,55				
EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	196.913	0,11	IRLANDA				
EUR	800.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	745.561	0,39	EUR	1.000.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	978.029	0,52
EUR	300.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	289.517	0,16	EUR	450.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	444.678	0,24
EUR	300.000	Deutsche Lufthansa AG 3.75% 11/02/2028	289.445	0,16	EUR	378.000	AIB Group plc Perp FRN	392.135	0,21
EUR	500.000	Eurogrid GmbH 0.74% 21/04/2033	437.100	0,23	EUR	720.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	668.655	0,36
EUR	100.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	99.368	0,05	EUR	969.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	957.009	0,51
EUR	247.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	240.829	0,13	GBP	135.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III 4.88% 15/07/2028	151.126	0,08
EUR	648.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	631.811	0,34	Total de Irlanda				
EUR	1.100.000	Hamburg Commercial Bank AG 0.38% 09/03/2026	1.064.311	0,57	3.591.632 1,92				
EUR	800.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	683.017	0,37	ITALIA				
EUR	933.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	889.978	0,48	EUR	880.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 26/09/2029	832.065	0,44
EUR	1.070.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	1.031.760	0,56	EUR	201.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	195.684	0,10
EUR	705.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	699.088	0,37	EUR	565.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	531.216	0,28
EUR	800.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	804.764	0,44	EUR	385.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	350.517	0,19
EUR	310.000	Schaeffler AG 2.88% 26/03/2027	305.865	0,16	EUR	371.000	Eni SpA Perp FRN	355.275	0,19
EUR	100.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	98.132	0,05	EUR	387.000	Fis Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	368.639	0,20
EUR	216.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 2.00% 15/07/2025	208.162	0,11	EUR	586.000	IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3.75% 15/01/2028	550.466	0,30
EUR	316.511	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	317.609	0,17	EUR	287.000	International Design Group SPA 6.50% 15/11/2025	289.964	0,16
EUR	300.000	Vonovia SE 1.50% 14/06/2041	246.555	0,13	EUR	304.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	290.210	0,16
					EUR	700.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale Perp FRN	670.131	0,36
					Total de Italia				
					4.434.167 2,38				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
JERSEY - ISLAS DEL CANAL				LUXEMBURGO (continuación)					
EUR	155.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	156.098	0,08	EUR	1.086.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.38% 15/10/2040	968.717	0,51
USD	1.683.497	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.16% 31/03/2034	1.398.239	0,75	USD	1.143.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	1.089.905	0,58
USD	776.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	628.066	0,34	EUR	1.406.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	1.288.708	0,69
EUR	631.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	573.489	0,31	EUR	185.000	Picard Bondco SA 5.38% 01/07/2027	175.738	0,09
EUR	245.000	Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	239.969	0,13	EUR	467.000	Sani/lkos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	459.041	0,25
Total de Jersey - Islas del Canal			2.995.861	1,61	Total de Luxemburgo			14.284.547	7,67
LUXEMBURGO				MÉXICO					
EUR	400.000	Adler Group SA 3.25% 05/08/2025	353.547	0,19	EUR	836.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 16/04/2026	798.809	0,43
EUR	568.000	Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	502.162	0,27	EUR	214.000	Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	198.784	0,11
EUR	225.000	Altice Financing SA 4.25% 15/08/2029	201.454	0,11	Total de México			997.593	0,54
EUR	128.000	Altice France Holding SA 4.00% 15/02/2028	110.268	0,06	PAÍSES BAJOS				
EUR	1.220.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	1.261.648	0,67	EUR	611.000	Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	565.265	0,30
EUR	2.200.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	2.009.394	1,09	EUR	525.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	529.595	0,28
GBP	300.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	341.357	0,18	EUR	209.000	Diebold Nixdorf Dutch Holding BV 9.00% 15/07/2025	216.308	0,12
GBP	383.000	B&m European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	444.504	0,24	EUR	545.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	479.436	0,26
EUR	298.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 12/02/2036	263.051	0,14	GBP	1.508.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	2.223.154	1,19
EUR	670.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	552.136	0,30	EUR	700.000	EDP Finance BV 1.88% 21/09/2029	703.065	0,38
EUR	662.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	610.980	0,34	EUR	700.000	ING Groep NV FRN 29/09/2028	649.748	0,35
EUR	366.000	Cirsa Finance International Sarl 4.50% 15/03/2027	347.322	0,19	EUR	800.000	ING Groep NV FRN 16/02/2031	786.716	0,42
EUR	577.436	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	581.143	0,31	EUR	450.000	Lkq European Holdings BV 4.13% 01/04/2028	466.824	0,25
EUR	311.000	Gamma Bondco Sarl 8.13% 15/11/2026	305.217	0,16	USD	667.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	538.773	0,29
EUR	338.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 6.75% 01/11/2025	337.339	0,18	EUR	416.000	Nobel Bidco BV 3.13% 15/06/2028	371.578	0,19
GBP	496.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	584.293	0,31	EUR	410.400	Oci NV 3.63% 15/10/2025	417.550	0,22
EUR	1.430.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	1.316.340	0,71	EUR	449.000	PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	456.135	0,24
EUR	180.000	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	180.283	0,10	EUR	171.000	Repsol International Finance BV FRN 25/03/2075	178.247	0,10
					EUR	750.000	Sagax Euro MTN BV 0.75% 26/01/2028	659.081	0,35

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
REINO UNIDO (continuación)				REINO UNIDO (continuación)					
EUR	301.000	International Game Technology plc 2.38% 15/04/2028	281.536	0,15	EUR	643.000	Vmed O2 UK Financing 3.25% 31/01/2031	594.486	0,32
EUR	450.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	454.229	0,24	GBP	272.000	Vmed O2 UK Financing 4.00% 31/01/2029	295.189	0,16
GBP	315.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	371.715	0,20	EUR	432.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	441.997	0,24
EUR	286.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 4.50% 15/07/2028	259.407	0,14	USD	650.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	603.033	0,32
EUR	500.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	514.757	0,28	GBP	1.248.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	1.359.824	0,73
GBP	445.000	Legal & General Group plc FRN 14/11/2048	562.372	0,30			Total de Reino Unido	29.973.152	16,07
GBP	560.000	Lloyds TSB Bank plc 7.63% 22/04/2025	747.833	0,40	ESTADOS UNIDOS				
GBP	175.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	203.259	0,11	USD	424.000	AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	400.117	0,21
GBP	403.738	Mitchells & Butlers Finance plc 6.01% 15/12/2028	502.923	0,27	USD	300.000	AbbVie Inc. 4.88% 14/11/2048	307.521	0,16
EUR	600.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	545.173	0,29	USD	209.000	Amgen Inc. 4.20% 22/02/2052	195.006	0,10
EUR	602.000	NatWest Group plc FRN 14/09/2032	552.871	0,30	EUR	660.000	Ardagh Metal Packaging 2.00% 01/09/2028	609.926	0,33
GBP	239.000	Natwest Group plc Perp FRN	280.005	0,15	EUR	190.000	Ardagh Metal Packaging 3.00% 01/09/2029	169.892	0,09
EUR	2.337.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	2.186.952	1,17	EUR	540.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	492.944	0,26
EUR	375.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	377.417	0,20	EUR	2.213.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	2.020.157	1,08
GBP	397.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	470.420	0,25	EUR	521.000	Bank of America Corp. FRN 24/05/2032	484.554	0,26
GBP	747.000	Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	871.831	0,47	EUR	300.000	Bank of America Corp. FRN 31/03/2029	332.108	0,18
GBP	165.000	Santander UK plc Perp 10.06%	343.388	0,18	EUR	1.219.000	Berkshire Hathaway Finance 1.50% 18/03/2030	1.214.948	0,65
EUR	481.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	459.976	0,25	USD	243.000	Boeing Company 5.93% 01/05/2060	254.034	0,14
GBP	390.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	439.273	0,24	EUR	706.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	662.670	0,36
GBP	387.671	Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	541.254	0,29	EUR	480.000	Eli Lilly & Company 1.38% 14/09/2061	374.588	0,20
GBP	620.000	Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	708.763	0,38	EUR	367.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.00% 03/12/2028	350.060	0,19
EUR	1.405.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	1.335.473	0,72	EUR	320.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	318.138	0,17
GBP	659.000	Travis Perkins plc 3.75% 17/02/2026	774.661	0,41	EUR	228.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	226.673	0,12
EUR	489.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	471.461	0,25	GBP	319.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	366.360	0,20
GBP	221.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.25% 15/01/2030	240.529	0,13	EUR	462.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	469.725	0,25
GBP	400.000	Virgin Money UK plc FRN 24/04/2026	472.067	0,25	EUR	804.000	General Motors Financial Company Inc. 0.60% 20/05/2027	736.840	0,39

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	176.000	Goodman USA Finance Three 3.70% 15/03/2028	158.320	0,08	USD	404.000	T-Mobile USA Inc. 2.63% 15/02/2029	332.363	0,18
EUR	700.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/01/2028	666.365	0,36	Total de Estados Unidos				
EUR	395.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/03/2029	363.053	0,19	25.623.506 13,72				
EUR	478.000	Iqvia Inc. 2.88% 15/06/2028	462.262	0,25	ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)				
USD	1.060.000	JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	869.187	0,47	USD	893.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	871.242	0,47
USD	1.627.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	1.340.827	0,72	Total de Islas Vírgenes (Británicas)				
EUR	351.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	359.165	0,19	871.242 0,47				
GBP	1.960.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	2.435.912	1,31	Total de bonos				
USD	1.064.000	Lowe's Cos Inc. 3.75% 01/04/2032	967.131	0,52	157.938.642 84,68				
EUR	1.728.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	1.832.914	0,99	Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
EUR	1.000.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	1.089.189	0,58	REPÚBLICA DOMINICANA				
USD	180.000	Occidental Petroleum Corp. 3.20% 15/08/2026	159.422	0,09	USD	333.000	Dominican Republic (Govt of) 5.88% 30/01/2060	257.167	0,14
USD	250.000	Occidental Petroleum Corp. 5.88% 01/09/2025	238.929	0,13	Total de República Dominicana				
USD	220.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	227.138	0,12	257.167 0,14				
USD	230.000	Occidental Petroleum Corp. 8.00% 15/07/2025	232.238	0,12	EGIPTO				
USD	145.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	154.734	0,08	EUR	450.000	Egypt (Govt of) 5.63% 16/04/2030	380.108	0,20
USD	265.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	306.926	0,16	Total de Egipto				
EUR	706.000	Olympus Water USA 3.88% 01/10/2028	650.256	0,35	380.108 0,20				
EUR	202.000	Olympus Water USA 5.38% 01/10/2029	177.432	0,10	ITALIA				
EUR	655.000	Prologis Euro Finance LLC 1.00% 08/02/2029	621.350	0,33	EUR	926.000	Italy (Govt of) BPT 2.45% 01/09/2050	923.648	0,50
EUR	454.000	Scientific Games International Inc. 5.50% 15/02/2026	467.053	0,25	Total de Italia				
EUR	214.000	Silgan Holdings Inc. 2.25% 01/06/2028	195.319	0,10	923.648 0,50				
EUR	530.000	Southern Company FRN 15/09/2081	473.155	0,25	COSTA DE MARFIL				
EUR	190.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	189.397	0,10	EUR	250.000	Ivory Coast (Govt of) 5.25% 22/03/2030	231.602	0,12
EUR	218.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	197.260	0,11	EUR	290.000	Ivory Coast (Govt of) 5.88% 17/10/2031	269.252	0,14
GBP	350.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	469.948	0,25	Total de Costa de Marfil				
				500.854 0,26					
				SENEGAL					
				EUR	390.000	Senegal (Govt of) 4.75% 13/03/2028	379.962	0,20	
				Total de Senegal					
				379.962 0,20					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)						
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Bonos (continuación)						
REINO UNIDO				ITALIA						
GBP	6.800.000	United Kingdom Gilt 0.38% 22/10/2026	7.663.486	4,12	USD	400.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	348.927	0,19	
Total de Reino Unido			7.663.486	4,12	Total de Italia			348.927	0,19	
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				10.105.225	5,42	PAÍSES BAJOS				
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				168.043.867	90,10	USD	467.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	430.700	0,23
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente						Total de Países Bajos				
Bonos						430.700				
AUSTRALIA						ESTADOS UNIDOS				
USD	1.270.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	1.179.182	0,62	USD	1.229.000	Magallanes Inc. 4.28% 15/03/2032	1.110.519	0,60	
Total de Australia			1.179.182	0,62	USD	1.196.000	Magallanes Inc. 5.14% 15/03/2052	1.102.626	0,59	
BERMUDAS						USD	250.000	Occidental Petroleum Corp. 6.95% 01/07/2024	241.821	0,13
USD	833.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	765.631	0,41	USD	164.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	184.245	0,10	
Total de Bermudas			765.631	0,41	Total de Estados Unidos			2.639.211	1,42	
CANADÁ						Total de bonos				
USD	507.000	Rogers Communications 3.80% 15/03/2032	452.266	0,24	8.031.685					
Total de Canadá			452.266	0,24	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente					
DINAMARCA						8.031.685				
USD	1.819.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	1.489.185	0,80	Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario					
Total de Dinamarca			1.489.185	0,80	Bonos					
FRANCIA						PORTUGAL				
USD	850.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	726.583	0,39	EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2099**	11.000	0,01	
Total de Francia			726.583	0,39	Total de Portugal			11.000	0,01	
REINO UNIDO						REINO UNIDO				
EUR	451.000	BCP V Modular Services Finance II plc 6.75% 30/11/2029			EUR	451.000	BCP V Modular Services Finance II plc 6.75% 30/11/2029	411.446	0,22	
GBP	812.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025			GBP	812.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	930.910	0,50	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)			
Bonos (continuación)			
REINO UNIDO (continuación)			
GBP	375.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	421.629 0,23
		Total de Reino Unido	1.763.985 0,95
Total de bonos		1.774.985	0,96
Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario		1.774.985	0,96

Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios

Fondos

IRLANDA

81	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	7.986	0,00
Total de Irlanda		7.986	0,00
Total de fondos		7.986	0,00
Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		7.986	0,00
Valor total de las inversiones		177.858.523	95,36
(Coste total: 186.378.157 EUR)			

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

** Título a su valor razonable.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
BERMUDAS				ISLAS CAIMÁN (continuación)					
USD	200.000	China Oil & Gas Group Limited 5.50% 25/01/2023	201.675	0,50	USD	200.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	195.820	0,48
USD	400.000	Geopark Limited 5.50% 17/01/2027	379.500	0,93	USD	367.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp. 1.63% 24/09/2025	342.759	0,84
USD	200.000	Ooredoo International Finance Limited 2.63% 08/04/2031	187.585	0,46	USD	200.000	Vale Overseas Limited 3.75% 08/07/2030	193.055	0,47
Total de Bermudas			768.760	1,89	Total de Islas Caimán			4.547.036	11,11
BRASIL				COLOMBIA					
USD	500.000	Light Servicos de Eletricidade SA 4.38% 18/06/2026	466.874	1,13	USD	650.000	Ecopetrol SA 6.88% 29/04/2030	684.814	1,67
Total de Brasil			466.874	1,13	Total de Colombia			684.814	1,67
CANADÁ				GUATEMALA					
USD	716.000	MEGlobal Canada ULCDL 5.00% 18/05/2025	740.223	1,80	USD	460.000	CT Trust 5.13% 03/02/2032	460.115	1,12
Total de Canadá			740.223	1,80	Total de Guatemala			460.115	1,12
ISLAS CAIMÁN				HONG KONG					
USD	200.000	AAC Technologies Holdings Inc. 3.00% 27/11/2024	189.749	0,46	USD	800.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	838.925	2,05
USD	200.000	Cifi Holdings Group Company Limited 6.00% 16/07/2025	169.557	0,41	USD	330.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	285.949	0,70
USD	200.000	CK Hutchison International 17 II Limited 3.25% 29/09/2027	199.759	0,49	Total de Hong Kong			1.124.874	2,75
USD	600.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	589.350	1,44	INDIA				
USD	212.000	ENN Energy Holdings Limited 2.63% 17/09/2030	190.402	0,46	USD	200.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	182.249	0,44
USD	400.000	Goodman HK Finance 3.00% 22/07/2030	382.581	0,93	USD	220.000	Adani Green Energy Limited 4.38% 08/09/2024	216.362	0,53
USD	200.000	Longfor Group Holdings Limited 3.95% 16/09/2029	179.260	0,44	USD	400.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	390.321	0,95
USD	400.000	Meituan 3.05% 28/10/2030	323.326	0,79	USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.20% 04/08/2027	197.349	0,48
USD	400.000	Melco Resorts Finance Limited 5.75% 21/07/2028	353.085	0,86	USD	200.000	Bharti Airtel Limited 4.38% 10/06/2025	202.821	0,49
USD	200.000	QNB Finance Limited 2.75% 12/02/2027	195.080	0,48	USD	200.000	Indian Railway Finance Corp. Limited 3.57% 21/01/2032	189.716	0,46
USD	200.000	QNB Finance Limited 2.75% 12/02/2027	195.080	0,48	USD	200.000	JSW Steel Limited 5.95% 18/04/2024	205.064	0,50
USD	300.000	SA Global Sukuk Limited 2.69% 17/06/2031	285.332	0,70	USD	250.000	Reliance Industries Limited 3.67% 30/11/2027	249.405	0,61
USD	400.000	Saudi Electricity Company 2.41% 17/09/2030	379.283	0,93	USD	475.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	435.985	1,06
USD	200.000	Tencent Holdings Limited 2.88% 22/04/2031	183.558	0,45	Total de India			2.269.272	5,52

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)							
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)							
INDONESIA				MAURICIO							
USD	295.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT 4.75% 13/05/2025	306.189	0,75	USD	289.110	Azure Power Energy Limited 3.58% 19/08/2026	275.865	0,67		
USD	400.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 6.76% 15/11/2048	446.555	1,09	USD	200.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	201.770	0,49		
USD	208.000	Saka Energi Indonesia Pt 4.45% 05/05/2024	204.727	0,50	USD	400.000	HTA Group Limited/Mauritius 7.00% 18/12/2025	395.500	0,96		
USD	600.000	Sri Rejeki Isman TBK PT 7.25% 16/01/2025	73.003	0,18	USD	300.000	Network I2i Limited Perp FRN	299.400	0,73		
Total de Indonesia			1.030.474	2,52	Total de Mauricio			1.172.535	2,85		
IRLANDA				MÉXICO							
USD	200.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding Dac 3.05% 23/01/2025	59.670	0,15	USD	400.000	America Movil SAB de CV 5.38% 04/04/2032	399.652	0,97		
USD	400.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	118.300	0,29	USD	500.000	BBVA Bancomer SA FRN 13/09/2034	491.700	1,20		
Total de Irlanda			177.970	0,44	USD	400.000	Braskem Idesa SAPI 6.99% 20/02/2032	392.750	0,96		
ISLA DE MAN				MARRUECOS							
USD	200.000	AngloGold Ashanti Holdings plc 3.75% 01/10/2030	187.108	0,46	USD	400.000	Cemex SAB de CV 5.20% 17/09/2030	398.248	0,97		
USD	400.000	Gohl Capital Limited 4.25% 24/01/2027	379.352	0,92	USD	400.000	Cemex SAB de CV 7.38% 05/06/2027	428.150	1,05		
Total de Isla de Man			566.460	1,38	USD	237.000	Gruma SAB de CV 4.88% 01/12/2024	247.102	0,60		
JERSEY - ISLAS DEL CANAL				PAÍSES BAJOS							
USD	200.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	180.108	0,44	USD	368.600	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	351.306	0,86		
USD	272.183	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.94% 30/09/2040	247.205	0,60	USD	230.000	Metinvest BV 8.50% 23/04/2026	102.748	0,25		
USD	440.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 3.25% 30/09/2040	399.651	0,97	USD	500.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	449.375	1,10		
Total de Jersey - Islas del Canal			826.964	2,01	USD	400.000	Petrobras Global Finance BV 6.75% 03/06/2050	392.250	0,96		
LUXEMBURGO				MARRUECOS							
USD	550.000	Hidroviias Int Finance Sar 4.95% 08/02/2031	464.406	1,13	USD	240.000	OCP SA 3.75% 23/06/2031	218.746	0,53		
USD	250.000	Mhp Lux SA 0.00% 03/04/2026	121.500	0,30	USD	557.000	OCP SA 6.88% 25/04/2044	570.283	1,39		
USD	500.000	MHP SE 0.00% 10/05/2024	238.870	0,58	Total de Marruecos			789.029	1,92		
USD	544.500	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	577.695	1,41	PAÍSES BAJOS						
USD	400.000	Rumo Luxembourg Sarl 5.25% 10/01/2028	400.799	0,98	USD	500.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	449.375	1,10		
Total de Luxemburgo			1.803.270	4,40	USD	400.000	Petrobras Global Finance BV 6.75% 03/06/2050	392.250	0,96		
				USD				500.000	Syngenta Finance NV 5.18% 24/04/2028	515.738	1,26
				USD				392.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 3.15% 01/10/2026	356.113	0,86

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)						
PAÍSES BAJOS (continuación)				ARABIA SAUDÍ (continuación)						
USD	250.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 4.75% 09/05/2027	240.456	0,59	USD	200.000	Saudi Arabian Oil Company 3.50% 16/04/2029	201.850	0,49	
Total de Países Bajos			2.407.986	5,88	Total de Arabia Saudí			1.154.925	2,81	
PERÚ				SINGAPUR						
USD	500.000	Auna SA 6.50% 20/11/2025	487.548	1,19	USD	200.000	BOC Aviation Limited 2.63% 17/09/2030	180.497	0,44	
USD	431.100	Hunt Oil Company of Peru LLC Sucursal del Peru 6.38% 01/06/2028	431.822	1,05	USD	600.000	DBS Group Holdings Limited FRN 11/12/2028	612.484	1,49	
USD	200.000	Volcan Compania Minera SA 4.38% 11/02/2026	192.000	0,47	USD	200.000	SingTel Group Treasury Pte Limited 2.38% 28/08/2029	191.082	0,47	
Total de Perú			1.111.370	2,71	USD	450.000	United Overseas Bank LT FRN 16/03/2031	418.415	1,02	
FILIPINAS			SUDÁFRICA			Total de Singapur			1.402.478	3,42
USD	250.000	Globe Telecom Inc. 2.50% 23/07/2030	217.863	0,53	USD	200.000	Eskom Holdings 6.75% 06/08/2023	197.617	0,48	
USD	200.000	International Container Terminal Services Inc. 4.75% 17/06/2030	200.595	0,49	USD	250.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	242.688	0,59	
USD	357.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	341.714	0,83	USD	244.000	Transnet SOC Limited 4.00% 26/07/2022	240.267	0,59	
USD	200.000	Pldt Inc. 2.50% 23/01/2031	183.010	0,45	Total de Sudáfrica			680.572	1,66	
USD	430.000	Smc Global Power Holdings Corp. Perp FRN	396.191	0,97	TAILANDIA					
Total de Filipinas			1.339.373	3,27	USD	700.000	Bangkok Bank plc FRN 25/09/2034	654.941	1,60	
CATAR				TURQUÍA						
USD	410.000	Qatar Petroleum 2.25% 12/07/2031	378.758	0,92	USD	200.000	Akbank TAS 6.80% 06/02/2026	195.214	0,48	
Total de Catar			378.758	0,92	USD	380.000	KOC Holding AS 6.50% 11/03/2025	382.542	0,93	
REPÚBLICA DE COREA (SUR)				TURQUÍA						
USD	200.000	Kookmin Bank 4.50% 01/02/2029	208.819	0,51	USD	250.000	Turk Telekomunikasyon AS 6.88% 28/02/2025	248.048	0,61	
USD	380.000	Sk Hynix Inc. 1.50% 19/01/2026	352.326	0,86	USD	230.000	Turkcell İletişim Hizmetleri AS 5.75% 15/10/2025	220.741	0,54	
Total de República de Corea (Sur)			561.145	1,37	USD	200.000	Türkiye Garanti Bankası AS 5.88% 16/03/2023	202.600	0,49	
ARABIA SAUDÍ				Total de Turquía				1.249.145	3,05	
USD	400.000	Saudi Arabian Oil Company 2.25% 24/11/2030	366.250	0,89						
USD	200.000	Saudi Arabian Oil Company 2.25% 24/11/2030	183.125	0,45						
USD	400.000	Saudi Arabian Oil Company 3.50% 16/04/2029	403.700	0,98						

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					
EMIRATOS ÁRABES UNIDOS				REPÚBLICA DOMINICANA					
USD	700.000	DP World Limited 6.85% 02/07/2037	844.522	2,06	USD	380.000	Dominican Republic (Govt of) 6.85% 27/01/2045	378.721	0,92
Total de Emiratos Árabes Unidos			844.522	2,06	Total de República Dominicana			378.721	0,92
REINO UNIDO				SUDÁFRICA					
USD	400.000	Endeavour Mining plc 5.00% 14/10/2026	370.074	0,90	USD	400.000	South Africa (Govt of) 4.85% 30/09/2029	392.279	0,96
USD	300.000	Gazprom PJSC Via Gaz Finance plc 3.25% 25/02/2030	126.375	0,31	Total de Sudáfrica			392.279	0,96
USD	450.000	Nak Naftogaz Ukraine Via Kondor Finance plc 7.63% 08/11/2026	138.572	0,34	TURQUÍA				
USD	200.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	167.010	0,41	USD	200.000	Turkey (Govt of) 5.75% 22/03/2024	198.357	0,48
Total de Reino Unido			802.031	1,96	Total de Turquía			198.357	0,48
ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)				Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					
USD	460.000	Central American Bottling Corp. 5.25% 27/04/2029	458.275	1,12				969.357	2,36
USD	400.000	Contemporary Ruiding Development Limited 2.63% 17/09/2030	354.729	0,86	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			38.789.186	94,61
USD	400.000	Elect Global Investments Limited Perp FRN	387.267	0,95	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
USD	450.000	FPC Resources Limited 4.38% 11/09/2027	452.076	1,10	Bonos				
USD	400.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	434.216	1,06	BERMUDAS				
USD	511.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	491.389	1,20	USD	500.000	Tengizchevroil Finance Company International 2.63% 15/08/2025	445.288	1,09
USD	728.000	Jgsh Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	711.484	1,74	Total de Bermudas			445.288	1,09
USD	400.000	Studio City Finance Limited 5.00% 15/01/2029	306.988	0,75	LUXEMBURGO				
USD	200.000	Studio City Finance Limited 6.00% 15/07/2025	184.136	0,45	USD	500.000	Altice Financing SA 5.00% 15/01/2028	451.237	1,10
USD	467.000	Tsmc Global Limited 0.75% 28/09/2025	431.596	1,05	Total de Luxemburgo			451.237	1,10
Total de Islas Vírgenes (Británicas)			4.212.156	10,28	Total de bonos			896.525	2,19
Total de bonos			37.819.829	92,25	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente			896.525	2,19

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
13.687	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	13.687	0,03
	Total de Irlanda	13.687	0,03
	Total de fondos	13.687	0,03
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	13.687	0,03
	Valor total de las inversiones	39.699.398	96,83
	(Coste total: 43.534.673 USD)		

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						
Bonos				Bonos (continuación)						
BERMUDAS				ISLA DE MAN						
USD	200.000	Ooredoo International Finance Limited 2.63% 08/04/2031	187.585	0,53	USD	200.000	AngloGold Ashanti Holdings plc 3.75% 01/10/2030	187.108	0,53	
Total de Bermudas			187.585	0,53	Total de Isla de Man			187.108	0,53	
CANADÁ				JERSEY - ISLAS DEL CANAL						
USD	316.000	MEGlobal Canada ULCDL 5.00% 18/05/2025	326.690	0,93	USD	253.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	227.836	0,65	
Total de Canadá			326.690	0,93	USD	272.183	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.94% 30/09/2040	247.205	0,70	
Total de Jersey - Islas del Canal						475.041	1,35			
ISLAS CAIMÁN				KAZAJISTÁN						
USD	200.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	196.450	0,56	USD	200.000	KazMunayGas National Company JSC 4.75% 19/04/2027	192.604	0,55	
USD	200.000	SA Global Sukuk Limited 2.69% 17/06/2031	190.222	0,54	USD	600.000	KazMunayGas National Company JSC 5.38% 24/04/2030	578.265	1,65	
Total de Islas Caimán			386.672	1,10	Total de Kazajistán			770.869	2,20	
HONG KONG				LUXEMBURGO						
USD	400.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	419.463	1,19	USD	180.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	190.974	0,54	
USD	210.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	181.967	0,52	Total de Luxemburgo			190.974	0,54	
Total de Hong Kong			601.430	1,71						
INDIA				MALASIA						
USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	195.160	0,55	USD	200.000	Petronas Capital Limited 3.50% 21/04/2030	203.985	0,58	
Total de India			195.160	0,55	Total de Malasia			203.985	0,58	
INDONESIA				MÉXICO						
USD	450.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.45% 15/05/2030	470.899	1,34	USD	450.000	Comision Federal de Electricidad 3.88% 26/07/2033	396.332	1,13	
USD	450.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 6.76% 15/11/2048	502.375	1,43	USD	300.000	Petroleos Mexicanos 5.95% 28/01/2031	277.148	0,79	
USD	200.000	Pelabuhan Indonesia II 5.38% 05/05/2045	216.465	0,62	USD	200.000	Petroleos Mexicanos 6.38% 23/01/2045	159.833	0,45	
Total de Indonesia			1.189.739	3,39	USD	1.500.000	Petroleos Mexicanos 6.70% 16/02/2032	1.425.937	4,06	
						USD	200.000	Petroleos Mexicanos 7.69% 23/01/2050	176.325	0,50
						Total de México			2.435.575	6,93
IRLANDA				PAÍSES BAJOS						
USD	200.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	59.150	0,17	USD	250.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	224.688	0,64	
Total de Irlanda			59.150	0,17						

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
PAÍSES BAJOS (continuación)				ISLAS VÍRGENES					
USD	400.000	Syngenta Finance NV 5.18% 24/04/2028	412.591	1,17	USD	250.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	271.385	0,77
USD	250.000	Syngenta Finance NV 5.68% 24/04/2048	273.125	0,78	USD	689.000	Jgsh Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	673.368	1,91
Total de Países Bajos			910.404	2,59	USD	200.000	State Grid Overseas Investment BVI Limited 1.63% 05/08/2030	174.644	0,50
FILIPINAS				Total de Islas Vírgenes (Británicas)					
USD	250.000	Smc Global Power Holdings Corp. Perp FRN	230.344	0,65	1.119.397 3,18				
Total de Filipinas			230.344	0,65	Total de bonos				
CATAR				Valores respaldados por activos e hipotecas					
USD	356.000	Qatar Petroleum 2.25% 12/07/2031	328.873	0,93	LUXEMBURGO				
Total de Catar			328.873	0,93	USD	180.000	Millicom International Cellular SA 5.13% 15/01/2028	179.604	0,51
SUDÁFRICA				Total de Luxemburgo					
USD	200.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	194.150	0,55	179.604 0,51				
USD	200.000	Eskom Holdings SOC Limited 8.45% 10/08/2028	197.300	0,56	Total de valores respaldados por activos e hipotecas				
Total de Sudáfrica			391.450	1,11	179.604 0,51				
EMIRATOS ÁRABES UNIDOS				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					
USD	200.000	Abu Dhabi Ports Company Pjsc 2.50% 06/05/2031	185.411	0,53	ANGOLA				
USD	700.000	DP World Limited 6.85% 02/07/2037	844.522	2,40	USD	400.000	Angola (Govt of) 8.00% 26/11/2029	401.060	1,14
Total de Emiratos Árabes Unidos			1.029.933	2,93	USD	200.000	Angola (Govt of) 9.38% 08/05/2048	197.336	0,56
REINO UNIDO				Total de Angola					
USD	204.000	Gazprom PJSC Via Gaz Finance plc 3.25% 25/02/2030	85.935	0,24	598.396 1,70				
USD	230.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	192.062	0,55	ARGENTINA				
Total de Reino Unido			277.997	0,79	USD	1.850.000	Argentina (Govt of) FRN 09/07/2035	565.638	1,62
ESTADOS UNIDOS				Total de Argentina					
USD	378.000	Petroleos Mexicanos 6.63% 15/06/2035	339.774	0,97	USD	90.000	Argentina (Govt of) 1.13% 09/07/2046	28.288	0,08
Total de Estados Unidos			339.774	0,97	593.926 1,70				
				BARÉIN					
				USD	300.000	Bahrain (Govt of) 5.63% 18/05/2034	285.950	0,81	
				USD	333.000	CBB International Sukuk Programme Company 3.88% 18/05/2029	324.719	0,92	
				Total de Baréin					
				610.669 1,73					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					
BIELORRUSIA				REPÚBLICA DOMINICANA (continuación)					
USD	200.000	Belarus (Govt of) 6.20% 28/02/2030	33.065	0,09	USD	314.000	Dominican Republic (Govt of) 7.45% 30/04/2044	332.177	0,94
Total de Bielorrusia			33.065	0,09	Total de República Dominicana			1.037.490	2,94
BRASIL				ECUADOR					
USD	850.000	Brazil (Govt of) 3.88% 12/06/2030	785.855	2,24	USD	192.950	Ecuador (Govt of) 0.50% 31/07/2040	110.946	0,32
USD	200.000	Brazil (Govt of) 5.00% 27/01/2045	178.778	0,51	USD	485.835	Ecuador (Govt of) 1.00% 31/07/2035	319.354	0,90
Total de Brasil			964.633	2,75	USD	230.000	Ecuador (Govt of) 5.00% 31/07/2030	192.412	0,55
Total de Ecuador					Total de Ecuador			622.712	1,77
CHILE				EGIPTO					
USD	200.000	Chile (Govt of) 3.50% 25/01/2050	183.780	0,52	EUR	180.000	Egypt (Govt of) 5.63% 16/04/2030	169.171	0,48
Total de Chile			183.780	0,52	EUR	200.000	Egypt (Govt of) 6.38% 11/04/2031	191.172	0,54
CHINA				USD	250.000	Egypt (Govt of) 7.30% 30/09/2033	219.041	0,62	
USD	200.000	China (Govt of) 1.95% 03/12/2024	197.361	0,56	USD	250.000	Egypt (Govt of) 7.63% 29/05/2032	226.257	0,64
Total de China			197.361	0,56	USD	300.000	Egypt (Govt of) 7.90% 21/02/2048	244.305	0,69
Total de Egipto					Total de Egipto			1.049.946	2,97
COLOMBIA				EL SALVADOR					
USD	1.000.000	Colombia (Govt of) 3.00% 30/01/2030	861.709	2,46	USD	200.000	El Salvador (Govt of) 6.38% 18/01/2027	99.359	0,28
USD	350.000	Colombia (Govt of) 3.13% 15/04/2031	297.055	0,84	Total de El Salvador			99.359	0,28
USD	223.000	Colombia (Govt of) 3.25% 22/04/2032	187.341	0,53	GHANA				
Total de Colombia			1.346.105	3,83	USD	364.000	Ghana (Govt of) 8.88% 07/05/2042	255.056	0,73
Total de Ghana					Total de Ghana			255.056	0,73
CROACIA				GUATEMALA					
USD	200.000	Croatia (Govt of) 6.00% 26/01/2024	211.305	0,60	USD	250.000	Guatemala (Govt of) 6.13% 01/06/2050	261.651	0,74
Total de Croacia			211.305	0,60	Total de Guatemala			261.651	0,74
REPÚBLICA DOMINICANA				INDIA					
USD	200.000	Dominican Republic (Govt of) 4.88% 23/09/2032	182.146	0,52	USD	400.000	Export-Import Bank of India 3.25% 15/01/2030	377.942	1,07
USD	191.000	Dominican Republic (Govt of) 5.50% 22/02/2029	190.267	0,54	Total de India			377.942	1,07
USD	222.000	Dominican Republic (Govt of) 5.88% 30/01/2060	190.758	0,54					
USD	151.000	Dominican Republic (Govt of) 6.40% 05/06/2049	142.142	0,40					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					
INDONESIA				PANAMÁ (continuación)					
USD	400.000	Indonesia (Govt of) 3.70% 30/10/2049	386.194	1,10	USD	200.000	Panama (Govt of) 4.50% 19/01/2063	192.746	0,55
USD	200.000	Indonesia (Govt of) 4.30% 31/03/2052	209.756	0,60	Total de Panamá				
USD	350.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 18/07/2047	376.196	1,07	661.323 1,88				
IDR	5.360.000.000	Indonesia (Govt of) 6.38% 15/04/2032	368.325	1,05	PARAGUAY				
USD	200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 2.30% 23/06/2025	198.393	0,56	USD	340.000	Paraguay (Govt of) 5.60% 13/03/2048	349.956	0,99
Total de Indonesia					USD	200.000	Paraguay (Govt of) 6.10% 11/08/2044	223.285	0,63
1.538.864 4,38					Total de Paraguay				
					573.241 1,62				
COSTA DE MARFIL					PERÚ				
EUR	477.000	Ivory Coast (Govt of) 5.88% 17/10/2031	492.763	1,41	USD	132.000	Peru (Govt of) 3.00% 15/01/2034	124.092	0,35
Total de Costa de Marfil					Total de Perú				
492.763 1,41					124.092 0,35				
MÉXICO					FILIPINAS				
USD	650.000	Mexico (Govt of) 3.25% 16/04/2030	627.371	1,79	USD	339.000	Philippine (Govt of) 3.20% 06/07/2046	304.833	0,87
USD	300.000	Mexico (Govt of) 4.60% 10/02/2048	287.018	0,82	Total de Filipinas				
MXN	85.000	Mexico (Govt of) 8.50% 31/05/2029	429.507	1,22	304.833 0,87				
Total de México					CATAR				
1.343.896 3,83					USD	450.000	Qatar (Govt of) 3.75% 16/04/2030	476.232	1,35
					USD	500.000	Qatar (Govt of) 4.00% 14/03/2029	534.777	1,53
					USD	200.000	Qatar (Govt of) 4.82% 14/03/2049	238.122	0,68
					USD	200.000	Qatar (Govt of) 5.10% 23/04/2048	246.250	0,70
					Total de Catar				
					1.495.381 4,26				
OMÁN					RUMANÍA				
USD	200.000	Oman (Govt of) 6.25% 25/01/2031	212.442	0,60	USD	300.000	Romania (Govt of) 4.00% 14/02/2051	261.031	0,74
Total de Omán					USD	252.000	Romanian (Govt of) 3.00% 27/02/2027	245.557	0,70
212.442 0,60					Total de Rumanía				
					506.588 1,44				
PAKISTÁN					FEDERACIÓN RUSA				
USD	200.000	Pakistan (Govt of) 6.88% 05/12/2027	157.514	0,45	USD	200.000	Russia (Govt of) 5.10% 28/03/2035	39.375	0,11
Total de Pakistán					USD	200.000	Russia (Govt of) 5.10% 28/03/2035	39.375	0,11
157.514 0,45					Total de Federación Rusa				
					78.750 0,22				
PANAMÁ									
USD	200.000	Panama (Govt of) 2.25% 29/09/2032	177.430	0,50					
USD	302.000	Panama (Govt of) 3.30% 19/01/2033	291.147	0,83					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Bonos					
ARABIA SAUDÍ				VENEZUELA					
USD	500.000	Saudi (Govt of) 3.45% 02/02/2061	444.423	1,26	USD	1.999.683	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026	144.977	0,41
USD	500.000	Saudi (Govt of) 3.75% 21/01/2055	482.061	1,37	Total de Venezuela				
USD	285.000	Saudi (Govt) 4.50% 26/10/2046	300.844	0,86	Total de bonos				
Total de Arabia Saudí				1.227.328	3,49	Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			
SUDÁFRICA				VENEZUELA					
USD	500.000	South Africa (Govt of) 5.75% 30/09/2049	438.457	1,25	USD	2.004.400	Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024	170.374	0,48
Total de Sudáfrica				438.457	1,25	Total de Venezuela			
SRI LANKA				Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					
USD	200.000	Sri Lanka (Govt of) 7.55% 28/03/2030	96.187	0,27	170.374				
Total de Sri Lanka				96.187	0,27	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente			
TURQUÍA				315.351					
USD	250.000	Turkey (Govt of) 4.25% 14/04/2026	225.876	0,64	Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				
USD	430.000	Turkey (Govt of) 5.13% 17/02/2028	379.235	1,08	Bonos				
USD	625.000	Turkey (Govt of) 6.00% 25/03/2027	582.991	1,67	LUXEMBURGO				
USD	250.000	Turkey (Govt of) 6.88% 17/03/2036	223.604	0,64	USD	210.000	Hidroviias International Finance Sarl 4.95% 08/02/2031	177.319	0,50
Total de Turquía				1.411.706	4,03	Total de Luxemburgo			
UCRANIA				177.319					
USD	518.000	Ukraine (Govt of) 6.88% 21/05/2029	219.618	0,62	Total de bonos				
USD	560.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2026	242.931	0,69	177.319				
Total de Ucrania				462.549	1,31	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				19.569.310	55,64	177.319			
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				31.587.064	89,81				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
1.558.132	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	1.558.132	4,43
	Total de Irlanda	1.558.132	4,43
	Total de fondos	1.558.132	4,43
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	1.558.132	4,43
	Valor total de las inversiones	33.637.866	95,63
	(Coste total: 38.341.562 USD)		

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
BERMUDAS				INDIA (continuación)					
USD	1.000.000	China Oil & Gas Group Limited 5.50% 25/01/2023	1.008.375	1,11	USD	600.000	JSW Steel Limited 5.95% 18/04/2024	615.190	0,67
Total de Bermudas			1.008.375	1,11	USD	700.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	642.505	0,71
BRASIL				Total de India					
USD	208.000	Cemig Geracao e Transmissao SA 9.25% 05/12/2024	226.330	0,25	2.745.875 3,01				
USD	1.200.000	Light Servicos de Eletricidade SA 4.38% 18/06/2026	1.120.500	1,23	INDONESIA				
Total de Brasil			1.346.830	1,48	USD	3.000.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 4.75% 15/05/2025	3.077.249	3,38
CANADÁ				USD 464.000 Saka Energi Indonesia Pt 4.45% 05/05/2024				456.699	0,50
USD	1.650.000	MEGlobal Canada ULCDL 5.00% 18/05/2025	1.705.819	1,87	USD	1.200.000	Sri Rejeki Isman TBK PT 7.25% 16/01/2025	146.005	0,16
Total de Canadá			1.705.819	1,87	Total de Indonesia				
ISLAS CAIMÁN				3.679.953 4,04					
USD	600.000	Cifi Holdings Group Company Limited 6.00% 16/07/2025	508.671	0,55	IRLANDA				
USD	1.500.000	DP World Salaam Perp FRN 5.88% 03/05/2027	1.553.966	1,71	USD	800.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding Dac 3.05% 23/01/2025	238.680	0,26
USD	820.000	Energuate Trust 5.88% 17/06/2026	805.445	0,88	USD	400.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	118.300	0,13
USD	1.300.000	Sa Global Sukuk Limited 1.60% 10/08/2026	1.225.188	1,34	Total de Irlanda			356.980	0,39
USD	500.000	Vale Overseas Limited 6.25% 10/08/2026	549.163	0,60	JERSEY - ISLAS DEL CANAL				
Total de Islas Caimán			4.642.433	5,08	USD	1.669.858	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 1.75% 30/09/2027	1.609.497	1,77
COLOMBIA				Total de Jersey - Islas del Canal					
USD	500.000	Ecopetrol SA 5.88% 18/09/2023	511.813	0,56	1.609.497 1,77				
Total de Colombia			511.813	0,56	KAZAJISTÁN				
HONG KONG				USD 1.000.000 KazMunayGas National Company JSC 4.75% 24/04/2025				976.116	1,07
USD	1.800.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	1.887.582	2,07	Total de Kazajistán			976.116	1,07
Total de Hong Kong			1.887.582	2,07	LUXEMBURGO				
INDIA				USD 500.000 Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA 5.15% 11/02/2026				211.875	0,23
USD	1.000.000	Adani Green Energy Limited 4.38% 08/09/2024	983.461	1,08	USD	1.145.000	Millicom International Cellular SA 4.50% 27/04/2031	1.070.667	1,18
USD	500.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 5.38% 10/04/2024	504.719	0,55	USD	360.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	381.947	0,42
Total de India			1.488.180	1,61	USD	1.000.000	Rumo Luxembourg Sarl 5.25% 10/01/2028	1.001.998	1,10
Total de India				Total de Luxemburgo					
2.745.875 3,01				2.666.487 2,93					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)						
MAURICIO				ARABIA SAUDÍ						
USD	400.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	403.541	0,44	USD	350.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	349.301	0,38	
USD	1.000.000	HTA Group Limited/Mauritius 7.00% 18/12/2025	988.750	1,09	USD	450.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	449.101	0,49	
Total de Mauricio			1.392.291	1,53	Total de Arabia Saudí			798.402	0,87	
MÉXICO				SUDÁFRICA						
USD	500.000	Cemex SAB de CV 5.20% 17/09/2030	497.810	0,55	USD	1.400.000	Eskom Holdings 6.75% 06/08/2023	1.383.317	1,51	
USD	1.000.000	Cemex SAB de CV 7.38% 05/06/2027	1.070.375	1,17	USD	500.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	485.375	0,53	
USD	1.200.000	Petroleos Mexicanos 4.25% 15/01/2025	1.184.827	1,30	Total de Sudáfrica			1.868.692	2,04	
USD	1.100.000	Petroleos Mexicanos 6.49% 23/01/2027	1.117.562	1,23	TURQUÍA					
USD	800.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 16/10/2025	837.720	0,92	USD	950.000	Turk Telekomunikasyon AS 6.88% 28/02/2025	942.582	1,03	
USD	2.600.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 04/08/2026	2.724.994	2,99	Total de Turquía			942.582	1,03	
Total de México			7.433.288	8,16	REINO UNIDO					
PAÍSES BAJOS				ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)						
USD	911.800	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	869.021	0,96	USD	1.000.000	Central American Bottling Corp. 5.25% 27/04/2029	996.250	1,09	
USD	500.000	Metinvest BV 8.50% 23/04/2026	223.366	0,25	USD	400.000	Elect Global Investments Limited Perp FRN	387.267	0,43	
USD	1.000.000	Syngenta Finance NV 4.44% 24/04/2023	1.011.589	1,11	USD	1.700.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	1.738.769	1,91	
USD	900.000	Syngenta Finance NV 5.18% 24/04/2028	928.329	1,02	USD	500.000	State Grid Overseas Investment BVI Limited 1.00% 05/08/2025	467.532	0,51	
Total de Países Bajos			3.032.305	3,34	USD	1.500.000	Studio City Finance Limited 6.00% 15/07/2025	1.381.018	1,52	
PERÚ				Total de Islas Vírgenes (Británicas)						
USD	1.000.000	Auna SA 6.50% 20/11/2025	975.095	1,07	USD	1.133.000	Tsmc Global Limited 0.75% 28/09/2025	1.047.104	1,15	
USD	479.000	Hunt Oil Company of Peru LLC Sucursal del Peru 6.38% 01/06/2028	479.802	0,53	Total de Islas Vírgenes (Británicas)			6.017.940	6,61	
Total de Perú			1.454.897	1,60	Total de bonos				48.908.520	53,67
FILIPINAS										
USD	893.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	854.764	0,94						
USD	670.000	Smc Global Power Holdings Corp. Perp FRN	617.321	0,68						
Total de Filipinas			1.472.085	1,62						

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)							
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)							
ANGOLA				EL SALVADOR							
USD	500.000	Angola (Govt of) 8.25% 09/05/2028	511.194	0,56	USD	300.000	El Salvador (Govt of) 5.88% 30/01/2025	168.750	0,19		
USD	1.050.000	Angola (Govt of) 9.50% 12/11/2025	1.154.077	1,27	Total de El Salvador			168.750	0,19		
Total de Angola				1.665.271	1,83						
BIELORRUSIA				GHANA							
USD	1.202.000	Belarus (Govt of) 6.88% 28/02/2023	205.513	0,23	USD	1.200.000	Ghana (Govt of) 6.38% 11/02/2027	904.638	0,99		
Total de Bielorrusia				205.513	0,23	Total de Ghana			904.638	0,99	
BRASIL				GUATEMALA							
USD	2.000.000	Brazil (Govt of) 2.88% 06/06/2025	1.966.042	2,16	USD	745.000	Guatemala (Govt of) 5.75% 06/06/2022	749.437	0,82		
USD	1.400.000	Brazil (Govt of) 4.25% 07/01/2025	1.445.438	1,59	Total de Guatemala			749.437	0,82		
Total de Brasil				3.411.480	3,75	INDONESIA					
COLOMBIA				OMÁN							
USD	1.300.000	Colombia (Govt of) 4.00% 26/02/2024	1.303.933	1,43	USD	1.000.000	Oman (Govt of) 4.40% 01/06/2024	1.012.912	1,11		
Total de Colombia				1.303.933	1,43	USD	1.700.000	Oman (Govt of) 4.75% 15/06/2026	1.709.851	1,88	
COSTA RICA				PAKISTÁN							
USD	300.000	Costa Rica (Govt of) 4.38% 30/04/2025	304.778	0,33	USD	500.000	Pakistan (Govt of) 6.00% 08/04/2026	384.788	0,42		
Total de Costa Rica				304.778	0,33	USD	700.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 30/09/2025	573.283	0,63	
REPÚBLICA DOMINICANA				PANAMÁ							
USD	1.700.000	Dominican Republic (Govt of) 5.50% 27/01/2025	1.765.808	1,94	USD	1.350.000	Panama (Govt of) 3.75% 16/03/2025	1.377.179	1,51		
USD	1.000.000	Dominican Republic (Govt of) 6.85% 29/01/2026	1.066.863	1,17	Total de Panamá			1.377.179	1,51		
Total de República Dominicana				2.832.671	3,11	CATAR					
EGIPTO				PAKISTÁN							
USD	700.000	Egypt (Govt of) 3.88% 16/02/2026	630.043	0,69	USD	500.000	Pakistan (Govt of) 6.00% 08/04/2026	384.788	0,42		
USD	1.750.000	Egypt (Govt of) 5.25% 06/10/2025	1.696.428	1,86	USD	700.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 30/09/2025	573.283	0,63		
USD	600.000	Egypt (Govt of) 5.75% 29/05/2024	598.493	0,66	Total de Pakistán			958.071	1,05		
USD	1.300.000	Egypt (Govt of) 5.88% 11/06/2025	1.285.137	1,41	PANAMÁ						
Total de Egipto				4.210.101	4,62	USD	1.350.000	Panama (Govt of) 3.75% 16/03/2025	1.377.179	1,51	
				Total de Panamá				1.377.179	1,51		
				CATAR							
				USD				2.700.000	Qatar (Govt of) 3.25% 02/06/2026	2.751.796	3,03
				Total de Catar				2.751.796	3,03		

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente							
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Bonos							
RUMANÍA				BERMUDAS							
USD	646.000	Romanian (Govt of) 3.00% 27/02/2027	629.484	0,69	USD	1.000.000	Tengizchevroil Finance Company International 2.63% 15/08/2025	890.575	0,98		
Total de Rumanía			629.484	0,69	Total de Bermudas			890.575	0,98		
FEDERACIÓN RUSA				VENEZUELA							
USD	400.000	Russia (Govt of) 4.75% 27/05/2026	104.056	0,11	USD	3.288.783	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 16/05/2024	238.437	0,26		
Total de Federación Rusa			104.056	0,11	USD	491.751	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026	35.652	0,04		
SUDÁFRICA				Total de Venezuela				274.089	0,30		
USD	350.000	South Africa (Govt of) 4.85% 30/09/2029	343.244	0,38	Total de bonos			1.164.664	1,28		
USD	600.000	South Africa (Govt of) 4.88% 14/04/2026	612.343	0,67	Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda						
Total de Sudáfrica			955.587	1,05	VENEZUELA						
TURQUÍA				USD 1.245.400 Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024				105.859	0,12		
USD	1.200.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama Anonim Sirketi 7.25% 24/02/2027	1.205.595	1,32	Total de Venezuela			105.859	0,12		
USD	900.000	Turkey (Govt of) 4.75% 26/01/2026	832.447	0,91	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				105.859	0,12	
USD	1.100.000	Turkey (Govt of) 4.88% 09/10/2026	996.857	1,09	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				1.270.523	1,40	
USD	1.673.000	Turkey (Govt of) 5.60% 14/11/2024	1.629.759	1,79	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios						
USD	1.100.000	Turkey (Govt of) 5.75% 22/03/2024	1.090.962	1,20	Fondos						
USD	1.700.000	Turkey (Govt of) 7.38% 05/02/2025	1.724.774	1,89	IRLANDA						
Total de Turquía			7.480.394	8,20	3.521.464	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	3.521.464	3,87			
UCRANIA				Total de Irlanda				3.521.464	3,87		
USD	2.534.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2026	1.099.261	1,21	Total de fondos			3.521.464	3,87		
Total de Ucrania			1.099.261	1,21	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				3.521.464	3,87	
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				34.094.115	37,42	Valor total de las inversiones				87.794.622	96,36
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				83.002.635	91,09	(Coste total: 96.749.454 USD)					

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						
Bonos				Bonos (continuación)						
CANADÁ				PAÍSES BAJOS (continuación)						
USD	437.000	Bombardier Inc. 7.88% 15/04/2027	428.634	0,24	USD	738.000	Ziggo BV 4.88% 15/01/2030	697.636	0,40	
USD	316.000	Nova Chemicals Corp. 4.25% 15/05/2029	292.150	0,17	Total de Países Bajos					
Total de Canadá				720.784	0,41	PANAMÁ				
FRANCIA				POLONIA						
USD	504.000	Altice France SA 5.13% 15/07/2029	450.815	0,26	USD	649.000	Canpack SA 3.88% 15/11/2029	571.792	0,32	
USD	311.000	Altice France SA 5.50% 15/01/2028	288.243	0,16	Total de Polonia					
USD	581.000	Altice France SA 8.13% 01/02/2027	599.519	0,34	ESPAÑA					
Total de Francia				1.338.577	0,76	USD	147.000	Grifols Escrow Issuer SA 4.75% 15/10/2028	139.419	0,08
ALEMANIA				SUPRANACIONAL						
USD	384.000	Iho Verwaltungs GmbH 6.38% 15/05/2029	380.032	0,22	USD	368.000	Ardagh Packaging Finance plc 5.25% 15/08/2027	340.556	0,19	
USD	261.000	IHO Verwaltungs GmbH 4.75% 15/09/2026	260.266	0,15	Total de supranacional					
Total de Alemania				640.298	0,37	340.556				
LIBERIA				ESTADOS UNIDOS						
USD	453.000	Royal Caribbean Cruises Limited 3.70% 15/03/2028	404.189	0,23	USD	122.000	Allegheny Technologies Inc. 4.88% 01/10/2029	115.637	0,07	
USD	147.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.25% 15/11/2022	149.098	0,08	USD	506.000	Allegheny Technologies Inc. 5.13% 01/10/2031	479.163	0,27	
USD	402.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.50% 01/04/2028	383.876	0,22	USD	191.000	American Axle & Manufacturing Inc. 6.50% 01/04/2027	188.535	0,11	
Total de Liberia				937.163	0,53	USD	744.000	Apache Corp. 4.75% 15/04/2043	707.023	0,40
LUXEMBURGO				ESTADOS UNIDOS						
USD	486.000	Herens Holdco Sarl 4.75% 15/05/2028	438.021	0,25	USD	311.000	Apache Corp. 5.10% 01/09/2040	314.592	0,18	
Total de Luxemburgo				438.021	0,25	USD	275.000	Apache Corp. 5.25% 01/02/2042	275.197	0,16
PAÍSES BAJOS				ESTADOS UNIDOS						
USD	375.000	Trivium Packaging Finance BV 5.50% 15/08/2026	374.419	0,21	USD	102.000	Bath & Body Works Inc. 5.25% 01/02/2028	102.765	0,06	
USD	88.000	Trivium Packaging Finance BV 8.50% 15/08/2027	88.233	0,05	USD	169.000	Bath & Body Works Inc. 6.88% 01/11/2035	174.281	0,10	
USD	171.000	Ziggo Bond Finance BV 6.00% 15/01/2027	172.913	0,10	USD	221.000	Bath & Body Works Inc. 7.50% 15/06/2029	239.675	0,14	
PAÍSES BAJOS				ESTADOS UNIDOS						
USD	375.000	Trivium Packaging Finance BV 5.50% 15/08/2026	374.419	0,21	USD	285.000	Centene Corp. 2.63% 01/08/2031	254.006	0,14	
USD	88.000	Trivium Packaging Finance BV 8.50% 15/08/2027	88.233	0,05	USD	278.000	Centene Corp. 3.00% 15/10/2030	256.180	0,15	
USD	171.000	Ziggo Bond Finance BV 6.00% 15/01/2027	172.913	0,10	USD	252.000	DCP Midstream Operating LP 5.13% 15/05/2029	259.718	0,15	
PAÍSES BAJOS				ESTADOS UNIDOS						
USD	375.000	Trivium Packaging Finance BV 5.50% 15/08/2026	374.419	0,21	USD	155.000	DCP Midstream Operating LP 5.60% 01/04/2044	162.944	0,09	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	91.000	Delta Air Lines Inc. 4.38% 19/04/2028	87.474	0,05	USD	996.000	Occidental Petroleum Corp. 4.40% 15/04/2046	949.952	0,55
USD	482.000	Delta Air Lines Inc. 7.38% 15/01/2026	522.265	0,30	USD	296.000	Occidental Petroleum Corp. 4.40% 15/08/2049	280.180	0,16
USD	142.000	Encompass Health Corp. 4.50% 01/02/2028	139.515	0,08	USD	54.000	Occidental Petroleum Corp. 4.63% 15/06/2045	52.515	0,03
USD	349.000	EQM Midstream Partner LP 5.50% 15/07/2028	351.422	0,20	USD	646.000	Occidental Petroleum Corp. 6.13% 01/01/2031	727.834	0,41
USD	159.000	Firstenergy Corp. 5.60% 15/07/2047	166.960	0,09	USD	417.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	479.029	0,27
USD	140.000	FirstEnergy Corp. 7.38% 15/11/2031	173.065	0,10	USD	156.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	179.205	0,10
USD	328.000	Ford Motor Company 3.25% 12/02/2032	293.152	0,17	USD	163.000	Occidental Petroleum Corp. 7.50% 01/05/2031	199.678	0,11
USD	182.000	Ford Motor Company 4.75% 15/01/2043	165.393	0,09	USD	288.000	OneMain Finance Corp. 5.63% 15/03/2023	293.333	0,17
USD	385.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.70% 10/08/2026	357.825	0,20	USD	216.000	OneMain Finance Corp. 6.13% 15/03/2024	221.535	0,13
USD	257.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.90% 16/02/2028	232.806	0,13	USD	189.000	OneMain Finance Corp. 6.88% 15/03/2025	198.941	0,11
USD	402.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.38% 13/11/2025	390.630	0,22	USD	220.000	PG&E Corp. 5.00% 01/07/2028	213.032	0,12
USD	771.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.66% 08/09/2024	764.832	0,43	USD	471.000	Primo Water Holdings Inc. 4.38% 30/04/2029	426.915	0,24
USD	378.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.00% 13/11/2030	356.435	0,20	USD	146.000	Radian Group Inc. 4.88% 15/03/2027	147.296	0,08
USD	622.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.39% 08/01/2026	620.833	0,36	USD	212.000	Radian Group Inc. 6.63% 15/03/2025	223.246	0,13
USD	244.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.95% 28/05/2027	248.557	0,14	USD	138.000	Service Properties Trust 4.35% 01/10/2024	133.239	0,08
USD	455.000	Ford Motor Credit Company LLC 5.11% 03/05/2029	458.788	0,26	USD	174.000	SM Energy Company 6.75% 15/09/2026	179.155	0,10
USD	429.000	HB Fuller Company 4.25% 15/10/2028	402.563	0,23	USD	894.000	Southwestern Energy Company 4.75% 01/02/2032	895.676	0,51
USD	320.000	HCA Inc. 5.63% 01/09/2028	346.200	0,20	USD	124.000	Sprint Capital Corp. 8.75% 15/03/2032	167.123	0,09
USD	336.000	HCA Inc. 5.88% 01/02/2029	369.390	0,21	USD	389.000	Targa Resources Partners LP 5.88% 15/04/2026	401.470	0,23
USD	254.000	Lumen Technologies Inc. 7.50% 01/04/2024	268.427	0,15	USD	57.000	Tenet Healthcare Corp. 4.25% 01/06/2029	54.898	0,03
USD	300.000	Mgic Investment Corp. 5.25% 15/08/2028	296.603	0,17	USD	378.000	T-Mobile USA Inc. 2.63% 15/02/2029	346.005	0,20
USD	476.000	Navient Corp. 6.75% 25/06/2025	489.661	0,28	USD	458.000	T-Mobile USA Inc. 3.50% 15/04/2031	432.238	0,25
USD	222.000	Nustar Logistics LP 5.75% 01/10/2025	227.334	0,13	USD	543.000	T-Mobile USA Inc. 3.50% 15/04/2031	512.307	0,29
USD	151.000	NuStar Logistics LP 5.63% 28/04/2027	148.811	0,08	USD	361.000	T-Mobile USA Inc. 4.75% 01/02/2028	367.958	0,21
USD	578.000	NuStar Logistics LP 6.00% 01/06/2026	586.676	0,33	USD	526.000	Transdigm Inc. 5.50% 15/11/2027	523.594	0,30
USD	245.000	Occidental Petroleum Corp. 4.20% 15/03/2048	229.938	0,13					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				CANADÁ (continuación)					
USD	422.000	Transdigm Inc. 6.38% 15/06/2026	425.401	0,24	USD	425.000	Air Canada 3.88% 15/08/2026	401.625	0,23
USD	351.000	United Airlines Inc. 4.63% 15/04/2029	333.324	0,19	USD	161.000	Bausch Health Cos Inc. 4.88% 01/06/2028	154.359	0,09
USD	147.000	United Rentals North America Inc. 5.50% 15/05/2027	152.242	0,09	USD	265.000	Bausch Health Cos Inc. 5.00% 30/01/2028	219.288	0,12
USD	179.000	Vistra Operations Company LLC 4.38% 01/05/2029	169.226	0,10	USD	395.000	Bausch Health Cos Inc. 5.25% 30/01/2030	310.569	0,18
USD	169.000	Welbilt Inc. 9.50% 15/02/2024	170.658	0,10	USD	440.000	Bausch Health Cos Inc. 5.50% 01/11/2025	438.992	0,25
USD	331.000	Western Midstream Operating LP 4.65% 01/07/2026	339.311	0,19	USD	166.000	Clarios Global LP 6.75% 15/05/2025	172.313	0,10
USD	171.000	Western Midstream Operating LP 5.05% 01/02/2030	171.375	0,10	USD	195.000	GFL Environmental Inc. 3.50% 01/09/2028	183.583	0,10
USD	170.000	Western Midstream Operating LP 5.30% 01/03/2048	168.469	0,10	USD	390.000	GFL Environmental Inc. 3.75% 01/08/2025	383.714	0,22
USD	127.000	Yum! Brands Inc. 4.63% 31/01/2032	123.674	0,07	USD	127.000	GFL Environmental Inc. 4.25% 01/06/2025	126.383	0,07
USD	373.000	Yum! Brands Inc. 5.38% 01/04/2032	373.933	0,21	USD	74.000	GFL Environmental Inc. 4.75% 15/06/2029	70.583	0,04
		Total de Estados Unidos	23.259.238	13,24	USD	265.000	GFL Environmental Inc. 5.13% 15/12/2026	267.442	0,15
		Total de bonos	30.064.110	17,11	USD	658.000	Hudbay Minerals Inc. 4.50% 01/04/2026	641.004	0,36
		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	30.064.110	17,11	USD	213.000	Hudbay Minerals Inc. 6.13% 01/04/2029	219.656	0,12
		Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente			USD	268.000	Nova Chemicals Corp. 5.25% 01/06/2027	266.995	0,15
		Bonos			USD	371.000	Ritchie Bros Auctioneers Inc. 5.38% 15/01/2025	377.420	0,21
		BERMUDAS			USD	278.000	Videotron Limited 3.63% 15/06/2029	257.650	0,15
USD	182.000	Nabors Industries Limited 7.25% 15/01/2026	182.677	0,10			Total de Canadá	5.448.458	3,09
USD	246.000	NCL Corp. Limited 5.88% 15/03/2026	234.008	0,13			ISLAS CAIMÁN		
USD	126.000	NCL Finance Limited 6.13% 15/03/2028	116.865	0,07	USD	601.627	Hawaiian Brand Intellectual Property Limited 5.75% 20/01/2026	602.546	0,34
		Total de Bermudas	533.550	0,30	USD	510.726	Transocean Sentry Limited 5.38% 15/05/2023	499.206	0,28
		CANADÁ					Total de Islas Caimán	1.101.752	0,62
USD	570.000	1011778 BC ULC 3.88% 15/01/2028	540.304	0,31			FRANCIA		
USD	286.000	1011778 BC ULC 4.00% 15/10/2030	258.548	0,15	USD	484.000	Altice France SA 5.50% 15/10/2029	437.657	0,25
USD	164.000	1011778 BC ULC 4.38% 15/01/2028	158.030	0,09	USD	558.000	Constellium SE 3.75% 15/04/2029	501.503	0,28
					USD	578.000	Constellium SE 5.63% 15/06/2028	582.208	0,33

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)							
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)							
FRANCIA (continuación)				PAÍSES BAJOS (continuación)							
USD	530.000	Iliad Holding SASU 6.50% 15/10/2026	531.716	0,30	USD	193.000	Constellium SE 5.88% 15/02/2026	193.691	0,11		
USD	679.000	Iliad Holding SASU 7.00% 15/10/2028	680.966	0,39	Total de Países Bajos			385.369	0,22		
Total de Francia				2.734.050	1,55						
ALEMANIA				PANAMÁ							
USD	363.000	TK Elevator Holdco GmbH 7.63% 15/07/2028	364.528	0,21	USD	649.000	Carnival Corp. 4.00% 01/08/2028	605.193	0,34		
Total de Alemania				364.528	0,21	USD	760.000	Carnival Corp. 5.75% 01/03/2027	724.849	0,42	
				USD				740.000	Carnival Corp. 6.00% 01/05/2029	698.374	0,40
				Total de Panamá				2.028.416	1,16		
IRLANDA				SUPRANACIONAL							
USD	504.000	James Hardie International Finance DAC 5.00% 15/01/2028	498.330	0,28	USD	207.000	Clarios Global LP 6.25% 15/05/2026	213.735	0,12		
Total de Irlanda				498.330	0,28	USD	501.000	Clarios Global LP 8.50% 15/05/2027	519.833	0,30	
				Total de supranacional				733.568	0,42		
LIBERIA				REINO UNIDO							
USD	306.000	Royal Caribbean Cruises Limited 4.25% 01/07/2026	285.154	0,16	USD	215.000	International Game Technology plc 4.13% 15/04/2026	212.447	0,12		
USD	223.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.50% 31/08/2026	215.753	0,12	USD	313.000	International Game Technology plc P.P. 144A 6.50% 15/02/2025	329.479	0,19		
USD	186.000	Royal Caribbean Cruises Limited 9.13% 15/06/2023	194.328	0,11	USD	337.000	Virgin Media Finance plc 5.00% 15/07/2030	319.112	0,18		
USD	102.000	Royal Caribbean Cruises Limited 11.50% 01/06/2025	112.136	0,06	USD	282.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.50% 15/08/2030	263.360	0,15		
Total de Liberia				807.371	0,45	USD	788.000	Vmed O2 UK Financing 4.25% 31/01/2031	719.247	0,41	
				USD				753.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.75% 15/07/2031	712.108	0,40
				Total de Reino Unido				2.555.753	1,45		
LUXEMBURGO				ESTADOS UNIDOS							
USD	516.000	Altice France Holding SA 6.00% 15/02/2028	445.695	0,25	USD	354.000	Acadia Healthcare Company Inc. 5.00% 15/04/2029	349.464	0,20		
USD	372.000	Axalta Coating Systems LLC 4.75% 15/06/2027	357.650	0,20	USD	221.000	Acadia Healthcare Company Inc. 5.50% 01/07/2028	222.315	0,13		
USD	477.000	Camelot Finance SA 4.50% 01/11/2026	466.820	0,27	USD	96.000	AdaptHealth LLC 4.63% 01/08/2029	87.679	0,05		
USD	154.000	Endo Finance Company LLC 6.00% 30/06/2028	87.495	0,05	USD	720.000	AdaptHealth LLC 5.13% 01/03/2030	669.623	0,37		
USD	494.000	Fage International 5.63% 15/08/2026	491.431	0,28	USD	118.000	AG Issuer LLC 6.25% 01/03/2028	118.295	0,07		
USD	440.000	Ion Trading Technologies Sarl 5.75% 15/05/2028	427.845	0,24	USD	488.000	Albertsons Companies Inc. 3.25% 15/03/2026	461.475	0,26		
Total de Luxemburgo				2.276.936	1,29	USD	487.000	Albertsons Companies Inc. 5.88% 15/02/2028	487.924	0,28	
PAÍSES BAJOS											
USD	187.000	Clear Channel International BV 6.63% 01/08/2025	191.678	0,11							

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	141.000	Albertsons Companies Inc. 7.50% 15/03/2026	149.488	0,08	USD	298.000	Beacon Roofing Supply Inc. 4.13% 15/05/2029	275.650	0,16
USD	353.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 4.25% 15/10/2027	340.045	0,19	USD	306.000	Beacon Roofing Supply Inc. 4.50% 15/11/2026	305.560	0,17
USD	268.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 5.88% 01/11/2029	257.950	0,15	USD	202.000	Black Knight Infoserv LLC 3.63% 01/09/2028	191.743	0,11
USD	692.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 6.75% 15/10/2027	685.304	0,39	USD	497.000	Blackstone Mortgage Trust Inc. 3.75% 15/01/2027	465.772	0,26
USD	1.141.121	American Airlines Inc. 5.50% 20/04/2026	1.152.533	0,65	USD	234.000	Boxer Parent Company Inc. 7.13% 02/10/2025	243.413	0,14
USD	606.110	American Airlines Inc. 5.75% 20/04/2029	603.657	0,34	USD	207.000	Boyd Gaming Corp. 4.75% 01/12/2027	205.368	0,12
USD	412.000	American Airlines Inc. 11.75% 15/07/2025	481.010	0,27	USD	275.000	Boyd Gaming Corp. 4.75% 15/06/2031	265.443	0,15
USD	619.000	American Builders & Contractors Supply Company Inc. 4.00% 15/01/2028	595.930	0,34	USD	674.000	BroadStreet Partners Inc. 5.88% 15/04/2029	630.190	0,36
USD	121.000	APX Group Inc. 6.75% 15/02/2027	123.989	0,07	USD	291.000	BVX Technologies Inc. 4.13% 30/06/2028	280.846	0,16
USD	174.000	Aramark Services Inc. 5.00% 01/02/2028	168.889	0,10	USD	199.000	Cablevision Lightpath LLC 3.88% 15/09/2027	186.381	0,11
USD	87.000	Aramark Services Inc. 6.38% 01/05/2025	89.364	0,05	USD	756.000	Caesars Entertainment Inc. 4.63% 15/10/2029	708.750	0,40
USD	148.000	Arches Buyer Inc. 4.25% 01/06/2028	138.148	0,08	USD	604.000	Caesars Entertainment Inc. 6.25% 01/07/2025	624.394	0,34
USD	303.000	Arches Buyer Inc. 6.13% 01/12/2028	280.579	0,16	USD	486.000	Caesars Entertainment Inc. 8.13% 01/07/2027	523.128	0,30
USD	257.000	Archrock Partners LP Archrock Partners Finance Corp. 6.25% 01/04/2028	253.457	0,14	USD	302.000	Caesars Resort Collection LLC 5.75% 01/07/2025	309.173	0,18
USD	739.000	Ardagh Metal Packaging 4.00% 01/09/2029	667.262	0,39	USD	1.182.000	Callon Petroleum Company 6.38% 01/07/2026	1.176.053	0,68
USD	165.000	Asbury Automotive Group Inc. 4.63% 15/11/2029	154.172	0,09	USD	204.000	Catalent Pharma Solutions 3.13% 15/02/2029	186.177	0,11
USD	255.000	Asbury Automotive Group Inc. 5.00% 15/02/2032	237.500	0,13	USD	343.000	CCO Holdings LLC 5.13% 01/05/2027	343.960	0,20
USD	174.000	ASP Unifrax Holdings Inc 5.25% 30/09/2028	162.186	0,09	USD	983.000	Cco Holdings LLC 4.25% 01/02/2031	897.271	0,52
USD	405.000	Assuredpartners Inc. 5.63% 15/01/2029	374.068	0,21	USD	188.000	CCO Holdings LLC 4.50% 01/05/2032	172.138	0,10
USD	539.000	Avantor Funding Inc. 3.88% 01/11/2029	509.400	0,29	USD	862.000	CCO Holdings LLC 4.75% 01/03/2030	830.214	0,47
USD	584.000	Avantor Funding Inc. 4.63% 15/07/2028	576.820	0,32	USD	428.000	CCO Holdings LLC 4.75% 01/02/2032	399.739	0,23
USD	314.000	Axalta Coating Systems LLC 3.38% 15/02/2029	276.383	0,16	USD	733.000	CCO Holdings LLC 5.00% 01/02/2028	726.522	0,41
USD	370.000	Bath & Body Works Inc. 6.63% 01/10/2030	388.963	0,22	USD	488.000	CD&R Smokey Buyer Inc. 6.75% 15/07/2025	505.080	0,28
USD	526.000	Bausch Health Americas Inc. 9.25% 01/04/2026	539.600	0,31	USD	244.000	Cedar Fair LP Canada's Wonderland Company 5.50% 01/05/2025	250.861	0,14

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	272.000	Cedar Fair LP Canada's Wonderland Company Magnum Management Corp. Millennium Op 6.50% 01/10/2028	278.562	0,16	USD	173.000	Clearway Energy Operating LLC 3.75% 15/01/2032	159.946	0,09
USD	527.000	Cengage Learning Inc. 9.50% 15/06/2024	526.094	0,30	USD	319.000	Clearway Energy Operating LLC 4.75% 15/03/2028	321.166	0,18
USD	221.000	Centene Corp. 3.38% 15/02/2030	208.475	0,12	USD	373.000	CNX Midstream Partners LP 4.75% 15/04/2030	350.804	0,20
USD	151.000	ChampionX Corp. 6.38% 01/05/2026	153.922	0,09	USD	317.000	Cnx Resources Corp. 6.00% 15/01/2029	321.755	0,18
USD	193.000	Change Healthcare Holdings LLC 5.75% 01/03/2025	193.121	0,11	USD	437.000	Cnx Resources Corp. 7.25% 14/03/2027	462.786	0,26
USD	159.000	Charles River Laboratories International Inc. 3.75% 15/03/2029	150.732	0,09	USD	198.000	CommScope Technologies LLC P.P. 144A 6.00% 15/06/2025	188.009	0,11
USD	52.000	Charles River Laboratories International Inc. 4.00% 15/03/2031	49.215	0,03	USD	212.000	Comstock Resources Inc. 6.75% 01/03/2029	218.869	0,12
USD	161.000	Charles River Laboratories International Inc. 4.25% 01/05/2028	157.780	0,09	USD	190.000	CrownRock LP 5.00% 01/05/2029	190.616	0,11
USD	537.000	Cheniere Energy Inc. 4.63% 15/10/2028	540.316	0,31	USD	304.000	CSC Holdings LLC 3.38% 15/02/2031	256.500	0,15
USD	775.000	Cheniere Energy Partners LP 3.25% 31/01/2032	705.250	0,39	USD	420.000	CSC Holdings LLC 4.13% 01/12/2030	370.642	0,21
USD	247.000	Cheniere Energy Partners LP 4.00% 01/03/2031	240.047	0,14	USD	319.000	CSC Holdings LLC 4.63% 01/12/2030	266.660	0,15
USD	290.000	Cheniere Energy Partners LP 4.50% 01/10/2029	291.631	0,17	USD	330.000	CSC Holdings LLC 5.00% 15/11/2031	277.339	0,16
USD	123.000	CHS Community Health Systems Inc. 5.63% 15/03/2027	125.578	0,07	USD	207.000	CSC Holdings LLC 5.38% 01/02/2028	201.774	0,11
USD	275.000	CHS Community Health Systems Inc. 6.88% 15/04/2029	270.071	0,15	USD	614.000	CSC Holdings LLC 6.50% 01/02/2029	619.710	0,35
USD	305.000	CHS Community Health Systems Inc. 8.00% 15/03/2026	318.153	0,18	USD	256.000	DCP Midstream Operating LP 5.63% 15/07/2027	269.252	0,15
USD	457.000	Cinemark USA Inc. 5.25% 15/07/2028	427.631	0,24	USD	189.000	Delek Logistics Partners LP 6.75% 15/05/2025	189.701	0,11
USD	314.000	Cinemark USA Inc. 8.75% 01/05/2025	329.308	0,19	USD	324.000	Delta Air Lines Inc. 4.50% 20/10/2025	327.312	0,19
USD	343.000	Clarivate Science Holdings Corp. 3.88% 01/07/2028	327.351	0,19	USD	633.000	DirectTV Holdings LLC 5.88% 15/08/2027	624.915	0,35
USD	604.000	Clarivate Science Holdings Corp. 4.88% 01/07/2029	570.599	0,32	USD	938.000	DISH DBS Corp. 5.13% 01/06/2029	797.089	0,45
USD	386.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc. 7.50% 01/06/2029	386.108	0,22	USD	827.000	DISH DBS Corp. 5.75% 01/12/2028	786.355	0,45
USD	647.000	Clear Channel Worldwide 7.75% 15/04/2028	651.043	0,37	USD	332.000	DISH DBS Corp. 7.75% 01/07/2026	330.143	0,19
USD	638.000	Clear Channel Worldwide Holdings Inc. 5.13% 15/08/2027	632.418	0,36	USD	377.000	DT Midstream Inc. 4.13% 15/06/2029	361.911	0,21
USD	465.000	Clearway Energy Operating LLC 3.75% 15/02/2031	432.683	0,25	USD	668.000	Element Solutions Inc. 3.88% 01/09/2028	624.079	0,35
					USD	236.000	Endeavor Energy Resources LP 5.75% 30/01/2028	243.984	0,14
					USD	304.000	EQM Midstream Partner LP 4.50% 15/01/2029	285.397	0,16

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	742.000	EQM Midstream Partner LP 4.75% 15/01/2031	697.502	0,39	USD	342.000	Illuminate Buyer LLC 9.00% 01/07/2028	346.703	0,20
USD	270.000	EQM Midstream Partner LP 6.00% 01/07/2025	275.184	0,16	USD	286.000	Ingevity Corp. 3.88% 01/11/2028	258.830	0,15
USD	143.000	EQM Midstream Partner LP 6.50% 01/07/2027	149.727	0,09	USD	446.000	Innophos Holdings Inc. 9.38% 15/02/2028	476.244	0,27
USD	202.000	Gartner Inc. 3.63% 15/06/2029	191.245	0,11	USD	171.000	Interface Inc. 5.50% 01/12/2028	166.298	0,09
USD	373.000	Gartner Inc. 3.75% 01/10/2030	351.086	0,20	USD	603.000	Iqvia Inc. 5.00% 15/05/2027	611.147	0,35
USD	345.000	Gartner Inc. 4.50% 01/07/2028	343.887	0,20	USD	614.000	Irb Holding Corp. 6.75% 15/02/2026	626.391	0,36
USD	439.000	Gates Global LLC 6.25% 15/01/2026	441.296	0,25	USD	344.000	Irb Holding Corp. 7.00% 15/06/2025	359.528	0,20
USD	160.000	Goodyear Tire & Rubber Company 5.00% 15/07/2029	149.460	0,08	USD	219.000	Iris Holdings Inc. 8.75% 15/02/2026	219.274	0,12
USD	376.000	Group 1 Automotive Inc. 4.00% 15/08/2028	350.855	0,20	USD	215.000	Iron Mountain Inc. 4.88% 15/09/2027	212.984	0,12
USD	82.000	GTCR AP Finance Inc. 8.00% 15/05/2027	83.160	0,05	USD	237.000	Iron Mountain Inc. 5.00% 15/07/2028	231.653	0,13
USD	538.000	H&E Equipment Services Inc. 3.88% 15/12/2028	504.779	0,29	USD	299.000	Iron Mountain Inc. 5.25% 15/03/2028	296.197	0,17
USD	387.000	HealthEquity Inc. 4.50% 01/10/2029	369.101	0,21	USD	255.000	ITT Holdings LLC 6.50% 01/08/2029	235.948	0,13
USD	486.000	Helios Software Holdings Inc. 4.63% 01/05/2028	448.943	0,25	USD	798.000	Kaiser Aluminum Corp. 4.50% 01/06/2031	721.810	0,42
USD	381.000	Herc Holdings Inc. 5.50% 15/07/2027	386.572	0,22	USD	1.019.000	Kar Auction Services Inc. 5.13% 01/06/2025	1.032.120	0,59
USD	127.000	Hess Midstream Operations LP 4.25% 15/02/2030	120.053	0,07	USD	200.000	Ladder Capital Finance Holdings LLP 4.25% 01/02/2027	191.900	0,11
USD	377.000	Hightower Holding LLC 6.75% 15/04/2029	370.629	0,21	USD	891.000	Ladder Capital Finance Holdings LLP 4.75% 15/06/2029	843.697	0,47
USD	197.000	Hilcorp Energy 6.25% 01/11/2028	200.097	0,11	USD	652.000	Ladder Capital Finance Holdings LLP 5.25% 01/10/2025	651.022	0,37
USD	373.000	Hilcorp Energy I 5.75% 01/02/2029	373.690	0,21	USD	373.000	Lamb Weston Holding Inc. 4.13% 31/01/2030	348.942	0,20
USD	113.000	Hilton Domestic Operating Company Inc. 5.38% 01/05/2025	115.850	0,07	USD	356.000	Lamb Weston Holdings Inc. 4.38% 31/01/2032	332.638	0,19
USD	125.000	Hilton Domestic Operating Company Inc. 5.75% 01/05/2028	129.544	0,07	USD	133.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC 4.25% 01/07/2029	124.945	0,07
USD	372.000	Holly Energy Partners Corp. 5.00% 01/02/2028	353.741	0,20	USD	174.000	Live Nation Entertainment Inc. 3.75% 15/01/2028	164.187	0,09
USD	480.000	HUB International Limited 5.63% 01/12/2029	467.170	0,27	USD	367.000	Live Nation Entertainment Inc. 4.75% 15/10/2027	358.743	0,20
USD	633.000	HUB International Limited 7.00% 01/05/2026	642.302	0,36	USD	474.000	Live Nation Entertainment Inc. 6.50% 15/05/2027	505.735	0,29
USD	423.000	IAA Inc. 5.50% 15/06/2027	425.297	0,24	USD	813.000	LogMeIn Inc. 5.50% 01/09/2027	761.679	0,43
USD	391.000	iHeartCommunications 4.75% 15/01/2028	375.701	0,21	USD	317.000	Madison IAQ LLC 4.13% 30/06/2028	292.956	0,17
USD	212.000	iHeartCommunications Inc. 5.25% 15/08/2027	210.579	0,12	USD	597.000	Madison IAQ LLC 5.88% 30/06/2029	536.180	0,30
USD	689.757	iHeartCommunications Inc. 8.38% 01/05/2027	714.898	0,41					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	404.000	Matador Resources Company 5.88% 15/09/2026	411.828	0,23	USD	323.000	Novelis Corp. 3.88% 15/08/2031	296.390	0,17
USD	115.000	Match Group Holdings II LLC 3.63% 01/10/2031	103.500	0,06	USD	688.000	Novelis Corp. 4.75% 30/01/2030	671.889	0,38
USD	463.000	Match Group Holdings II LLC 4.63% 01/06/2028	449.675	0,26	USD	260.000	NRG Energy Inc. 3.38% 15/02/2029	231.400	0,13
USD	173.000	Mattel Inc. 5.88% 15/12/2027	181.104	0,10	USD	625.000	NRG Energy Inc. 3.63% 15/02/2031	553.437	0,30
USD	457.000	Mauser Packaging Solutions Holding Company 5.50% 15/04/2024	454.664	0,26	USD	193.000	NRG Energy Inc. 3.88% 15/02/2032	170.617	0,10
USD	600.000	Meritage Homes Corp. 3.88% 15/04/2029	572.625	0,33	USD	71.000	Occidental Petroleum Corp. 4.50% 15/07/2044	68.057	0,04
USD	485.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP 4.63% 15/06/2025	490.784	0,28	USD	85.000	Occidental Petroleum Corp. 6.20% 15/03/2040	94.964	0,05
USD	260.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP Mgp Finance Co-Issuer Inc. 5.75% 01/02/2027	274.871	0,16	USD	695.000	Occidental Petroleum Corp. 6.45% 15/09/2036	819.370	0,47
USD	89.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP MGP Finance Co-Issuer Inc. 3.88% 15/02/2029	88.032	0,05	USD	122.000	Occidental Petroleum Corp. 6.60% 15/03/2046	144.471	0,08
USD	214.000	Midwest Gaming Borrower LLC 4.88% 01/05/2029	197.980	0,11	USD	484.000	Olympus Water USA 4.25% 01/10/2028	441.444	0,25
USD	899.469	Mileage Plus Holdings LLC 6.50% 20/06/2027	939.196	0,53	USD	480.000	Organon & Company 4.13% 30/04/2028	457.620	0,26
USD	173.000	Mozart Debt Merger Sub Inc. 5.25% 01/10/2029	162.188	0,09	USD	533.000	Organon & Company 5.13% 30/04/2031	515.344	0,29
USD	175.000	NCR Corp 5.75% 01/09/2027	175.760	0,10	USD	558.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc. 7.25% 01/02/2028	575.818	0,33
USD	120.000	NCR Corp 6.13% 01/09/2029	120.525	0,07	USD	65.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc. 7.38% 01/06/2025	67.241	0,04
USD	651.000	NCR Corp. 5.00% 01/10/2028	623.576	0,35	USD	196.000	Outfront Media Capital LLC 4.25% 15/01/2029	182.574	0,10
USD	452.000	NextEra Energy Operating Partners 4.50% 15/09/2027	451.353	0,25	USD	211.000	Outfront Media Capital LLC 4.63% 15/03/2030	199.131	0,11
USD	153.000	NextEra Energy Operating Partners LP 4.25% 15/07/2024	155.133	0,09	USD	257.000	Par Pharmaceutical Inc. 7.50% 01/04/2027	240.650	0,14
USD	488.000	NFP Corp. 4.88% 15/08/2028	468.536	0,27	USD	273.000	Park Intermediate Holdings LLC 4.88% 15/05/2029	256.477	0,15
USD	1.038.000	NFP Corp. 6.88% 15/08/2028	992.588	0,56	USD	395.000	Park Intermediate Holdings LLC 5.88% 01/10/2028	395.273	0,22
USD	268.000	Nielsen Finance LLC 4.50% 15/07/2029	267.498	0,15	USD	474.000	PetSmart Inc. 4.75% 15/02/2028	459.297	0,26
USD	336.000	Nielsen Finance LLC 4.75% 15/07/2031	335.790	0,19	USD	166.000	PetSmart Inc. 7.75% 15/02/2029	171.603	0,10
USD	261.000	Nielsen Finance LLC 5.63% 01/10/2028	262.905	0,15	USD	796.000	Pilgrim's Pride Corp. 3.50% 01/03/2032	697.156	0,39
USD	327.000	Nielsen Finance LLC 5.88% 01/10/2030	328.989	0,19	USD	641.000	Pilgrim's Pride Corp. 4.25% 15/04/2031	594.254	0,34
USD	58.000	Northwest Fiber LLC 6.00% 15/02/2028	51.172	0,03	USD	1.012.000	Plantronics Inc. 4.75% 01/03/2029	1.040.915	0,59
USD	268.000	Novelis Corp. 3.25% 15/11/2026	256.392	0,15	USD	672.000	Post Holdings Inc. 4.63% 15/04/2030	606.479	0,34
					USD	230.000	Post Holdings Inc. 5.63% 15/01/2028	226.547	0,13
					USD	289.000	Post Holdings Inc. 5.75% 01/03/2027	290.987	0,17

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	200.000	PRA Health Sciences Inc. 2.88% 15/07/2026	190.778	0,11	USD	259.000	Sirius XM Radio Inc. 4.00% 15/07/2028	246.077	0,14
USD	279.000	Prestige Brands Inc. 5.13% 15/01/2028	278.303	0,16	USD	174.000	Sirius XM Radio Inc. 5.50% 01/07/2029	176.828	0,10
USD	740.000	Provident Funding Associates LP 6.38% 15/06/2025	729.630	0,41	USD	400.000	Six Flags Entertainment Corp. 4.88% 31/07/2024	401.735	0,23
USD	446.000	Radiate Holco LLC 4.50% 15/09/2026	431.226	0,24	USD	268.000	Six Flags Theme Parks Inc. 7.00% 01/07/2025	280.369	0,16
USD	854.000	Radiate Holco LLC 6.50% 15/09/2028	810.233	0,46	USD	206.000	Southwestern Energy Company 5.38% 01/02/2029	209.454	0,12
USD	358.000	Resideo Funding Inc. 4.00% 01/09/2029	326.693	0,19	USD	238.000	SRS Distribution Inc. 4.63% 01/07/2028	227.460	0,13
USD	662.000	Ritchie Bros Holdings Inc. 4.75% 15/12/2031	646.277	0,36	USD	566.000	SRS Distribution Inc. 6.00% 01/12/2029	526.538	0,29
USD	230.000	RLJ Lodging Trust LP 3.75% 01/07/2026	218.608	0,12	USD	520.000	SRS Distribution Inc. 6.13% 01/07/2029	484.823	0,28
USD	219.000	RLJ Lodging Trust LP 4.00% 15/09/2029	203.057	0,12	USD	479.000	Staples Inc. 7.50% 15/04/2026	462.474	0,26
USD	626.000	Roblox Corp. 3.88% 01/05/2030	588.440	0,33	USD	188.000	Staples Inc. 10.75% 15/04/2027	167.790	0,10
USD	483.000	Rocket Mortgage LLC 3.63% 01/03/2029	442.871	0,25	USD	235.000	Stevens Holding Company Inc. 6.13% 01/10/2026	242.673	0,14
USD	299.000	Rocket Mortgage LLC 3.88% 01/03/2031	271.255	0,15	USD	442.000	Sunoco LP Sunoco Finance Corp. 5.88% 15/03/2028	450.248	0,26
USD	1.011.000	Rocket Mortgage LLC 4.00% 15/10/2033	890.666	0,51	USD	217.000	Surgery Center Holdings Inc. 6.75% 01/07/2025	216.908	0,12
USD	135.000	Ryan Specialty Group LLC 4.38% 01/02/2030	129.111	0,07	USD	90.000	Switch Limited 3.75% 15/09/2028	87.410	0,05
USD	137.000	Sabre Global Inc. 9.25% 15/04/2025	152.025	0,09	USD	492.000	Switch Limited 4.13% 15/06/2029	484.620	0,28
USD	301.000	Sabre Global Inc. 7.38% 01/09/2025	314.733	0,18	USD	332.000	Targa Resources Partners LP 5.50% 01/03/2030	345.625	0,20
USD	458.000	Scientific Games International Inc. 5.00% 15/10/2025	469.736	0,27	USD	88.000	Teleflex Inc. 4.25% 01/06/2028	86.216	0,05
USD	164.000	Scientific Games International Inc. 7.00% 15/05/2028	170.253	0,10	USD	136.000	Tempo Acquisition LLC 5.75% 01/06/2025	137.588	0,08
USD	166.000	Scientific Games International Inc. 7.25% 15/11/2029	174.117	0,10	USD	365.000	Tenet Healthcare Corp 4.88% 01/01/2026	370.056	0,21
USD	217.000	Scientific Games International Inc. 8.25% 15/03/2026	226.494	0,13	USD	505.000	Tenet Healthcare Corp 5.13% 01/11/2027	508.346	0,29
USD	676.000	Select Medical Corp. 6.25% 15/08/2026	700.248	0,39	USD	595.000	Tenet Healthcare Corp 6.25% 01/02/2027	611.853	0,35
USD	130.000	Service Properties Trust 5.50% 15/12/2027	125.563	0,07	USD	203.000	Tenet Healthcare Corp. 4.38% 15/01/2030	195.115	0,11
USD	173.000	Shea Homes LP Shea Homes Funding Corp. 4.75% 15/02/2028	164.226	0,09	USD	115.000	Tenet Healthcare Corp. 4.63% 15/06/2028	113.384	0,06
USD	362.000	Shift4 Payments LLC 4.63% 01/11/2026	352.498	0,20	USD	541.000	Tenet Healthcare Corp. 6.13% 01/10/2028	549.365	0,31
USD	235.000	Simmons Food Inc. 4.63% 01/03/2029	220.834	0,13	USD	748.000	Tenneco Inc. 7.88% 15/01/2029	788.672	0,44
					USD	179.000	Terraform Power Operating LLC 4.75% 15/01/2030	174.901	0,10
					USD	192.000	Terraform Power Operating LLC 5.00% 31/01/2028	191.880	0,11

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	439.000	TK Elevator US Newco Inc. 5.25% 15/07/2027	436.631	0,24	USD	690.000	ZoomInfo Technologies LLC 3.88% 01/02/2029	631.988	0,36
USD	1.263.000	Transdigm Inc. 6.25% 15/03/2026	1.298.348	0,74	Total de Estados Unidos				
USD	569.000	Transdigm Inc. 8.00% 15/12/2025	594.079	0,34	Total de bonos				
USD	619.000	Transmontaigne Partners LP 6.13% 15/02/2026	611.368	0,35	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
USD	1.387.000	Uber Technologies Inc. 4.50% 15/08/2029	1.301.180	0,73	130.620.827 74,14				
USD	86.000	Uber Technologies Inc. 6.25% 15/01/2028	89.113	0,05	Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				
USD	482.000	United Airlines Inc. 4.38% 15/04/2026	473.866	0,27	Bonos				
USD	279.000	Univision Communications Inc. 4.50% 01/05/2029	265.446	0,15	BERMUDAS				
USD	287.000	US Foods Inc. 4.63% 01/06/2030	265.588	0,15	USD	74.000	Ncl Corp. Limited 7.75% 15/02/2029	74.833	0,04
USD	498.000	US Foods Inc. 4.75% 15/02/2029	477.696	0,27	Total de Bermudas				
USD	136.000	USA Compression Partners LP 6.88% 01/04/2026	137.345	0,08	74.833 0,04				
USD	481.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC 3.88% 15/08/2029	468.374	0,27	CANADÁ				
USD	440.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC 3.88% 01/11/2033	420.434	0,24	USD	324.000	Bausch Health Cos Inc. 6.13% 01/02/2027	326.229	0,19
USD	833.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC 4.13% 15/08/2031	818.754	0,45	USD	365.000	Rockpoint Gas Storage 7.00% 31/03/2023	365.119	0,21
USD	452.000	Verscend Escrow Corp. 9.75% 15/08/2026	471.211	0,26	Total de Canadá				
USD	509.000	Vici Properties 3.75% 15/02/2027	495.492	0,28	691.348 0,40				
USD	449.000	Vistra Operations Company LLC 5.63% 15/02/2027	450.340	0,26	LIBERIA				
USD	801.000	Waste Pro USA Inc. 5.50% 15/02/2026	756.544	0,43	USD	179.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.38% 15/07/2027	171.361	0,10
USD	344.000	Wesco Distribution Inc. 7.13% 15/06/2025	358.190	0,20	Total de Liberia				
USD	1.032.000	Wesco Distribution Inc. 7.25% 15/06/2028	1.098.254	0,63	171.361 0,10				
USD	394.000	White Cap Buyer LLC 6.88% 15/10/2028	373.808	0,21	LUXEMBURGO				
USD	567.000	WR Grace Holdings LLC 4.88% 15/06/2027	555.844	0,32	USD	327.000	Altice France Holding SA 10.50% 15/05/2027	342.802	0,19
USD	929.000	WR Grace Holdings LLC 5.63% 15/08/2029	869.437	0,49	Total de Luxemburgo				
USD	581.000	Zayo Group Holdings Inc. 4.00% 01/03/2027	535.380	0,30	342.802 0,19				
USD	196.000	Zayo Group Holdings Inc. 6.13% 01/03/2028	175.485	0,10	PAÍSES BAJOS				
				ESTADOS UNIDOS					
				USD	798.000	VZ Secured Financing BV Bond 5.00% 15/01/2032	746.465	0,42	
				Total de Países Bajos					
				746.465 0,42					
				USD	806.000	CHS Community Health Systems Inc. 5.25% 15/05/2030	775.776	0,43	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)			
Bonos (continuación)			
ESTADOS UNIDOS (continuación)			
USD	582.000	Condor Merger Sub Inc. 7.38% 15/02/2030	558.257 0,32
USD	306.000	Covanta Holding Corp. 4.88% 01/12/2029	292.521 0,17
USD	472.000	Fair Isaac Corp. 4.00% 15/06/2028	456.817 0,26
USD	444.000	Fertitta Entertainment LLC 6.75% 15/01/2030	409.035 0,23
USD	20.000	Kaiser Aluminum Corp. 4.63% 01/03/2028	18.850 0,01
USD	690.000	Minerva Merger Sub Inc. 6.50% 15/02/2030	669.644 0,38
USD	309.000	Owens & Minor Inc. 6.63% 01/04/2030	318.168 0,18
USD	477.000	Scientific Games Holdings LP 6.63% 01/03/2030	470.203 0,27
	Total de Estados Unidos	3.969.271	2,25
	Total de bonos	5.996.080	3,40
	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	5.996.080	3,40
	Valor total de las inversiones	166.681.017	94,65
	(Coste total: 171.526.270 USD)		

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
BAHAMAS				ISLAS CAIMÁN (continuación)					
USD	200.000	Competition Team Technologies Limited 3.75% 12/03/2024	202.770	0,35	USD	450.000	Sunac China Holdings Limited 8.35% 19/04/2023	123.750	0,22
Total de Bahamas			202.770	0,35	USD	400.000	Tencent Holdings Limited 2.88% 22/04/2031	367.117	0,64
BERMUDAS				USD	300.000	Tencent Holdings Limited 3.98% 11/04/2029	299.854	0,52	
USD	200.000	China Oil & Gas Group Limited 5.50% 25/01/2023	201.675	0,35	USD	600.000	Times China Holdings Limited 6.75% 16/07/2023	306.720	0,53
Total de Bermudas			201.675	0,35	USD	467.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp. 1.63% 24/09/2025	436.154	0,76
ISLAS CAIMÁN				Total de Islas Caimán					
USD	250.000	AAC Technologies Holdings Inc. 3.00% 27/11/2024	237.185	0,42	8.350.525				
USD	250.000	Alibaba Group Holding Limited 4.50% 28/11/2034	250.442	0,44	14,53				
USD	500.000	China Mengniu Dairy Company 1.88% 17/06/2025	475.078	0,83	HONG KONG				
USD	600.000	Cifi Holdings Group Company Limited 6.00% 16/07/2025	508.671	0,89	USD	400.000	Bank of East Asia Limited FRN 29/05/2030	397.512	0,69
USD	600.000	CK Hutchison International 17 II Limited 3.25% 29/09/2027	599.278	1,04	USD	200.000	Glp China Holdings 2.95% 29/03/2026	186.395	0,32
USD	200.000	Country Garden Holdings Company Limited 3.13% 22/10/2025	147.950	0,26	USD	500.000	Icbcil Finance Company 3.13% 15/11/2022	500.702	0,87
USD	200.000	Country Garden Holdings Company Limited 5.40% 27/05/2025	154.294	0,27	USD	950.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	996.224	1,73
USD	500.000	ENN Energy Holdings Limited 2.63% 17/09/2030	449.061	0,78	USD	700.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	606.558	1,06
USD	600.000	Goodman HK Finance 3.00% 22/07/2030	573.872	1,00	Total de Hong Kong				
USD	500.000	HPHT Finance 19 Limited 2.88% 05/11/2024	496.139	0,86	2.687.391				
USD	500.000	JD.Com Inc. 3.38% 14/01/2030	472.357	0,82	INDIA				
USD	1.000.000	Logan Group Company Limited 4.70% 06/07/2026	209.625	0,36	USD	600.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	546.747	0,95
USD	600.000	Longfor Properties Company 4.50% 16/01/2028	565.307	0,98	USD	280.000	Adani Green Energy Limited 4.38% 08/09/2024	275.369	0,48
USD	800.000	Meituan 3.05% 28/10/2030	646.650	1,12	USD	300.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 3.10% 02/02/2031	258.615	0,45
USD	500.000	Melco Resorts Finance 4.88% 06/06/2025	461.908	0,80	USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	195.160	0,34
USD	250.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Limited 2.75% 13/05/2030	237.895	0,41	USD	400.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	385.758	0,67
USD	270.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Limited 3.75% 25/02/2029	276.218	0,48	USD	800.000	Adani Transmission Limited 4.00% 03/08/2026	778.219	1,36
USD	200.000	Sunac China Holdings Limited 6.50% 09/07/2023	55.000	0,10	USD	650.000	Bharti Airtel Limited 4.38% 10/06/2025	659.169	1,15
					USD	226.000	GMR Hyderabad International Airport 4.75% 02/02/2026	217.525	0,38
					USD	500.000	Indian Railway Finance Corp. Limited 3.57% 21/01/2032	474.290	0,83

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)						
INDIA (continuación)				PAÍSES BAJOS						
USD	200.000	JSW Steel Limited 5.95% 18/04/2024	205.064	0,36	USD	543.200	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	517.715	0,90	
USD	500.000	Ongc Videsh Limited 4.63% 15/07/2024	512.007	0,89	USD	250.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	224.688	0,39	
USD	500.000	Reliance Industries Limited 3.67% 30/11/2027	498.809	0,87	USD	500.000	Royal Capital BV Perp FRN	499.605	0,87	
USD	800.000	ReNew Power Limited 6.45% 27/09/2022	804.217	1,41	Total de Paises Bajos			1.242.008	2,16	
USD	690.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	633.326	1,10	FILIPINAS					
Total de India				6.444.275	11,24	USD	800.000	Globe Telecom Inc. 2.50% 23/07/2030	697.161	1,21
INDONESIA						USD	520.000	Globe Telecom Inc. - Perp FRN	507.202	0,88
USD	1.400.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 6.76% 15/11/2048	1.562.945	2,72	USD	200.000	International Container Terminal Services Inc. 4.75% 17/06/2030	200.595	0,35	
USD	400.000	Pertamina Persero Pt 5.63% 20/05/2043	426.244	0,74	USD	714.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	683.428	1,19	
USD	1.000.000	Perusahaan Listrik Negara Pt 5.25% 24/10/2042	1.013.780	1,77	USD	670.000	Smc Global Power Holdings Corp. Perp FRN	617.321	1,07	
USD	200.000	Perusahaan Listrik Negara Pt 6.25% 25/01/2049	226.513	0,39	USD	200.000	Smc Global Power Holdings Corp. Perp FRN	188.358	0,33	
USD	200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT 4.00% 30/06/2050	178.095	0,31	USD	400.000	Smc Global Power Holdings Corp. Perp FRN	390.300	0,68	
USD	279.000	Saka Energi Indonesia Pt 4.45% 05/05/2024	274.610	0,48	Total de Filipinas			3.284.365	5,71	
USD	400.000	Sri Rejeki Isman TBK PT 7.25% 16/01/2025	48.668	0,08	REPÚBLICA DE COREA (SUR)					
Total de Indonesia				3.730.855	6,49	USD	500.000	Shinhan Financial Group Company Limited Perp FRN	511.272	0,89
ISLA DE MAN						USD	500.000	Sk Hynix Inc. 1.50% 19/01/2026	463.587	0,81
USD	400.000	Gohl Capital Limited 4.25% 24/01/2027	379.353	0,66	Total de República de Corea (Sur)			974.859	1,70	
Total de Isla de Man				379.353	0,66	SINGAPUR				
MALASIA						USD	500.000	ABJA Investment Company 5.45% 24/01/2028	517.528	0,90
USD	200.000	Axiata Bhd 4.36% 24/03/2026	207.798	0,36	USD	400.000	BOC Aviation Limited 2.63% 17/09/2030	360.994	0,63	
USD	500.000	Petronas Capital Limited 3.50% 21/04/2030	509.963	0,89	USD	550.000	DBS Group Holdings Limited FRN 11/12/2028	561.443	0,98	
USD	400.000	TNB Global Ventures Capital Bhd 4.85% 01/11/2028	424.885	0,74	USD	700.000	SingTel Group Treasury Pte Limited 1.88% 10/06/2030	637.853	1,11	
Total de Malasia				1.142.646	1,99	USD	550.000	United Overseas Bank LT FRN 16/03/2031	511.397	0,89
MAURICIO						Total de Singapur			2.589.215	4,51
USD	400.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	403.541	0,70	TAILANDIA					
Total de Mauricio				403.541	0,70	USD	800.000	Bangkok Bank pcl FRN 25/09/2034	748.503	1,30

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						
Bonos (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda						
TAILANDIA (continuación)				CHINA						
USD	200.000	GC Treasury Centre Company 2.98% 18/03/2031	183.324	0,32	USD	606.000	China (Govt of) 1.95% 03/12/2024	598.004	1,04	
USD	400.000	Kasikornbank plc FRN 02/10/2031	377.231	0,66	Total de China			598.004	1,04	
Total de Tailandia				1.309.058	2,28					
REINO UNIDO				INDIA						
USD	1.000.000	HSBC Holdings plc Perp FRN	1.013.742	1,77	USD	400.000	Export-Import Bank of India 3.25% 15/01/2030	377.942	0,66	
USD	600.000	Standard Chartered plc Perp FRN	620.740	1,08	Total de India			377.942	0,66	
USD	400.000	Vedanta Resources plc 6.13% 09/08/2024	347.226	0,60						
Total de Reino Unido				1.981.708	3,45					
ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)				INDONESIA						
USD	500.000	CMHI Finance BVI Company Perp FRN	502.476	0,87	USD	800.000	Indonesia (Govt of) 3.40% 18/09/2029	820.566	1,43	
USD	500.000	CNPC Global Capital Limited 1.35% 23/06/2025	471.923	0,82	USD	1.000.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 11/02/2029	1.107.411	1,92	
USD	650.000	Contemporary Ruiding Development Limited 2.63% 17/09/2030	576.435	1,00	USD	200.000	Indonesia (Govt of) 6.63% 17/02/2037	251.434	0,44	
USD	800.000	Elect Global Investments Limited Perp FRN	774.534	1,35	USD	300.000	Indonesia (Govt of) 7.75% 17/01/2038	411.787	0,72	
USD	750.000	FPC Resources Limited 4.38% 11/09/2027	753.459	1,31	USD	200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 2.30% 23/06/2025	198.393	0,35	
USD	511.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	491.390	0,86	Total de Indonesia			2.789.591	4,86	
USD	500.000	Hongkong Electric Finance Limited 1.88% 27/08/2030	439.568	0,77						
USD	1.439.000	Jgsh Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	1.406.353	2,45	PAKISTÁN					
USD	600.000	Nan Fung Treasury Limited 5.00% 05/09/2028	610.473	1,06	USD	350.000	Pakistan (Govt of) 6.00% 08/04/2026	269.351	0,47	
USD	750.000	State Grid Overseas Investment BVI Limited 1.63% 05/08/2030	654.916	1,14	USD	350.000	Pakistan (Govt of) 6.88% 05/12/2027	275.650	0,48	
USD	500.000	Studio City Finance Limited 5.00% 15/01/2029	383.734	0,67	USD	200.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 30/09/2025	163.795	0,29	
USD	700.000	Studio City Finance Limited 6.00% 15/07/2025	644.475	1,12	Total de Pakistán			708.796	1,24	
USD	850.000	Tsmc Global Limited 0.75% 28/09/2025	785.560	1,36						
USD	400.000	Yongda Investment Limited 2.25% 16/06/2025	383.166	0,67	FILIPINAS					
Total de Islas Vírgenes (Británicas)				8.878.462	15,45	USD	1.000.000	Philippine (Govt of) 3.00% 01/02/2028	1.005.993	1,75
Total de bonos				43.802.706	76,24	USD	900.000	Philippine (Govt of) 3.75% 14/01/2029	938.486	1,63
						Total de Filipinas			1.944.479	3,38
						SRI LANKA				
						USD	540.000	Sri Lanka (Govt of) 7.55% 28/03/2030	259.704	0,45
						Total de Sri Lanka			259.704	0,45

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)			
ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)			
USD	700.000 Talent Yield International Limited 3.13% 06/05/2031	665.401	1,16
	Total de Islas Vírgenes (Británicas)	665.401	1,16
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda		7.343.917	12,79
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		51.146.623	89,03
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente			
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			
CHINA			
CNY	6.000.000 China (Govt of) 2.36% 02/07/2023	947.451	1,65
CNY	10.000.000 China (Govt of) 2.85% 04/06/2027	1.594.710	2,77
CNY	7.000.000 China (Govt of) 3.12% 05/12/2026	1.130.375	1,96
	Total de China	3.672.536	6,38
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda		3.672.536	6,38
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		3.672.536	6,38
Valor total de las inversiones		54.819.159	95,41
(Coste total: 59.796.370 USD)			

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
REINO UNIDO				
GBP	575.000	United Kingdom Gilt 1.25% 22/07/2027	674.933	2,00
Total de Reino Unido		674.933	2,00	
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda		674.933	2,00	
Instrumentos estructurados - Materias primas				
IRLANDA				
61	Invesco Physical Gold ETC 0.00%	10.305	0,03	
Total de Irlanda		10.305	0,03	
Total de Instrumentos estructurados - Materias primas		10.305	0,03	
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		685.238	2,03	
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
FRANCIA				
EUR	3.000.000	France (Govt of) 0.00% 24/08/2022	3.007.272	8,93
Total de Francia		3.007.272	8,93	
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda		3.007.272	8,93	
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		3.007.272	8,93	
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				
Fondos				
IRLANDA				
12.646	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	1.242.143	3,69	
Total de Irlanda		1.242.143	3,69	

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios (continuación)				
Fondos (continuación)				
LUXEMBURGO				
128.249	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities XU**	2.648.205	7,86	
236.347	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond 4E**	2.469.877	7,33	
74.915	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds XU**	714.888	2,12	
305.372	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities XE**	3.233.732	9,59	
121.975	Threadneedle Lux - European High Yield Bond 4E**	1.357.249	4,03	
140.933	Threadneedle Lux - Global Focus XU**	3.141.191	9,32	
88.703	Threadneedle Lux - Pan European Smaller Companies 4E**	1.082.041	3,21	
33.181	Threadneedle Lux-European Short Term High Yield Bond XE**	3.471.871	10,29	
Total de Luxemburgo		18.119.054	53,75	
Total de fondos		19.361.197	57,44	
Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		19.361.197	57,44	
Otros organismos de inversión colectiva				
Fondos				
REINO UNIDO				
GBP	144.724	Threadneedle European Select Fund X***	337.277	1,00
EUR	67.108	Threadneedle Investment Funds ICVC - American Fund***	532.633	1,58
GBP	522.117	Threadneedle Investment Funds ICVC - Asia Fund***	1.346.409	4,00
GBP	154.866	Threadneedle Investment Funds ICVC - European Fund***	351.531	1,04
GBP	1.011.972	Threadneedle Investment Funds ICVC - Japan Fund***	2.358.024	7,00
EUR	339.911	Threadneedle Specialist Investment Funds Icvc - Emerging Market Local Fund***	854.604	2,54

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Otros organismos de inversión colectiva (continuación)			
Fondos (continuación)			
REINO UNIDO (continuación)			
GBP	1.548.159	Threadneedle Specialist Investment Funds ICVC - Sterling Short-Dated Corporate Bond Fund***	2.064.673 6,13
	Total de Reino Unido	7.845.151	23,29
	Total de fondos	7.845.151	23,29
	Total de otros organismos de inversión colectiva	7.845.151	23,29
	Valor total de las inversiones	30.898.858	91,69

(Coste total: 27.284.779 EUR)

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

** Consulte la nota 18.

*** Fondo de parte vinculada.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				Renta variable (continuación)					
ESTADOS UNIDOS				INDONESIA					
USD	3.000.000	United States Treasury N/B 0.13% 31/01/2023	2.964.609	6,62	1.359.250	Bank Rakyat Indonesia	441.044	0,98	
Total de Estados Unidos			2.964.609	6,62	Total de Indonesia			441.044	0,98
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				2.964.609	6,62	IRLANDA			
Renta variable				JAPÓN					
ISLAS CAIMÁN				PAÍSES BAJOS					
1.683	Sea Limited	201.607	0,45	900	Keyence Corp.	424.511	0,94		
Total de Islas Caimán			201.607	0,45	5.500	Recruit Holdings Company Limited	245.331	0,55	
DINAMARCA				NORUEGA					
4.934	Novo Nordisk A/S	552.712	1,23	1.510	Airbus SE	185.416	0,41		
3.521	Orsted A/S	447.252	0,99	1.637	Koninklijke DSM NV	295.979	0,66		
11.886	Tryg A/S	292.024	0,65	Total de Países Bajos			481.395	1,07	
Total de Dinamarca			1.291.988	2,87	REPÚBLICA DE COREA (SUR)				
FINLANDIA				SUIZA					
6.895	Upm-Kymmene Oyj	227.543	0,51	4.084	Nestle SA - Reg	533.438	1,19		
Total de Finlandia			227.543	0,51	1.106	Roche Holding AG	440.417	0,98	
FRANCIA				TAIWÁN					
2.323	Essilor International SA	429.833	0,96	43.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	895.968	2,00		
3.782	Schneider Electric SE	640.296	1,43	Total de República de Corea (Sur)			1.115.686	2,49	
Total de Francia			1.070.129	2,39	INDIA				
ALEMANIA				HONG KONG					
1.168	Adidas AG	275.380	0,61	21.600	AIA Group Limited	227.407	0,51		
Total de Alemania			275.380	0,61	Total de Hong Kong			227.407	0,51
INDIA				INDIA					
6.587	HDFC Bank Limited - ADR	403.981	0,90	Total de India			403.981	0,90	
Total de India			403.981	0,90	TOTAL				
Total de Taiwán			895.968	2,00	2.964.609				6,62

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Instrumentos estructurados - Materias primas			
REINO UNIDO				IRLANDA			
7.569	Diageo plc	385.026	0,86	8.169	Invesco Physical Gold ETC	1.535.445	3,43
13.734	SSE PLC	316.179	0,71	0.00%			
	Total de Reino Unido	701.205	1,57		Total de Irlanda	1.535.445	3,43
ESTADOS UNIDOS				Total de Instrumentos estructurados - Materias primas			
2.682	Abbott Laboratories	317.442	0,71			1.535.445	3,43
1.325	Adobe Systems Inc.	603.696	1,35		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	34.407.100	76,76
623	Alphabet Inc. - A	1.732.781	3,87				
461	Amazon.com Inc.	1.502.837	3,36		Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		
1.317	American Tower Corp.	330.857	0,74		Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda		
1.702	Autodesk Inc.	364.824	0,81		ESTADOS UNIDOS		
5.155	Centene Corp.	433.999	0,97	USD 2.500.000	United States Treasury Bill	2.497.295	5,57
892	Cooper Companies Inc.	372.490	0,83	0.00%	23/06/2022		
1.436	Deere & Company	596.601	1,33		Total de Estados Unidos	2.497.295	5,57
2.539	Doximity Inc.	132.257	0,30		Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda	2.497.295	5,57
1.677	Ecolab Inc.	296.091	0,66		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente	2.497.295	5,57
3.193	Electronic Arts Inc.	403.946	0,90		Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		
1.473	Eli Lilly & Company	421.823	0,94		Fondos		
410	Equinix Inc.	304.064	0,68		LUXEMBURGO		
1.864	Fidelity National Information Services Inc.	187.183	0,42	158.873	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio XU**	3.650.129	8,14
7.429	General Motors Company	324.944	0,72	6.432	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds XU**	68.290	0,15
1.569	IntercontinentalExchange Inc.	207.296	0,46	539	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond XE**	62.775	0,14
1.242	Intuit Inc.	597.203	1,33		Total de Luxemburgo	3.781.194	8,43
4.206	JPMorgan Chase & Company	573.361	1,28		Total de fondos	3.781.194	8,43
927	Lam Research Corp.	498.364	1,11		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	3.781.194	8,43
2.517	Mastercard Inc. - A	899.526	2,00				
239	Mercadolibre Inc.	284.286	0,63				
6.302	Microsoft Corp.	1.942.969	4,33				
3.692	NextEra Energy Inc.	312.749	0,70				
2.181	Nvidia Corp.	595.108	1,33				
2.439	Paypal Holdings Inc.	282.070	0,63				
3.399	Qualcomm Inc.	519.435	1,16				
553	S&P Global Inc.	226.830	0,51				
1.642	Stryker Corp.	438.989	0,98				
829	Thermo Fisher Scientific Inc.	489.649	1,09				
5.531	T-Mobile USA Inc.	709.904	1,58				
2.551	Transunion	263.620	0,59				
3.213	Trimble Navigation Limited	231.786	0,52				
8.061	Uber Technologies Inc.	287.616	0,64				
1.594	Union Pacific Corp.	435.497	0,97				
3.748	Walt Disney Company	514.076	1,15				
	Total de Estados Unidos	18.636.169	41,58				
	Total de renta variable	29.907.046	66,71				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Otros organismos de inversión colectiva			
Fondos			
REINO UNIDO			
USD	45.881	Threadneedle Specialist Investment Funds ICVC - Emerging Market Local Fund***	127.994 0,29
		Total de Reino Unido	127.994 0,29
		Total de fondos	127.994 0,29
		Total de otros organismos de inversión colectiva	127.994 0,29
		Valor total de las inversiones	40.813.583 91,05
		(Coste total: 32.071.345 USD)	

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

** Consulte la nota 18.

*** Fondo de parte vinculada.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)							
Bonos				Bonos (continuación)							
AUSTRALIA				FINLANDIA (continuación)							
EUR	100.000	APT Pipelines Limited 0.75% 15/03/2029	101.085	0,07	EUR	100.000	Teollisuuden Voima Oyj 2.63% 31/03/2027	110.639	0,08		
USD	77.000	Ausgrid Finance Pty Limited 4.35% 01/08/2028	78.681	0,06	Total de Finlandia						
Total de Australia				179.766	0,13	423.164					
BÉLGICA				FRANCIA							
EUR	100.000	Solvay SA Perp FRN	104.697	0,07	EUR	100.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	107.269	0,08		
EUR	200.000	Solvay SA Perp FRN	226.761	0,17	EUR	100.000	Altice France SA 4.00% 15/07/2029	100.408	0,07		
Total de Bélgica				331.458	0,24	EUR	100.000	Altice France SA 4.13% 15/01/2029	101.231	0,07	
BERMUDAS				FRANCIA (continuación)							
USD	100.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	112.117	0,08	EUR	104.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	105.281	0,07		
Total de Bermudas				112.117	0,08	EUR	100.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	114.116	0,08	
CANADÁ				FRANCIA (continuación)							
USD	29.000	Canadian Pacific Railway Company 3.10% 02/12/2051	25.789	0,02	EUR	100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.25% 29/06/2028	102.790	0,07		
EUR	172.000	Primo Water Holdings Inc. 3.88% 31/10/2028	178.722	0,13	EUR	100.000	BPCE SA 0.25% 14/01/2031	98.322	0,07		
USD	10.000	Rogers Communications Inc. 3.70% 15/11/2049	9.028	0,01	EUR	192.000	CAB Selas 3.38% 01/02/2028	203.653	0,14		
Total de Canadá				213.539	0,16	EUR	100.000	Casino Guichard Perrachon SA 5.25% 15/04/2027	95.173	0,07	
ISLAS CAIMÁN				FRANCIA (continuación)							
GBP	212.000	Southern Water Services Limited 2.38% 28/05/2028	272.859	0,19	EUR	107.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	108.822	0,08		
Total de Islas Caimán				272.859	0,19	EUR	200.000	Casino Guichard-Perrachon SA 4.50% 07/03/2024	208.408	0,15	
DINAMARCA				FRANCIA (continuación)							
EUR	100.000	Danske Bank AS 0.63% 26/05/2025	109.633	0,08	EUR	100.000	Chrome Holding SASU 5.00% 31/05/2029	103.732	0,07		
Total de Dinamarca				109.633	0,08	EUR	139.000	CMA CGM SA 7.50% 15/01/2026	167.499	0,12	
FINLANDIA				FRANCIA (continuación)							
EUR	100.000	Nordea Bank Abp 0.50% 14/05/2027	107.191	0,08	EUR	214.000	Constellium SE 3.13% 15/07/2029	219.330	0,15		
EUR	100.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	103.201	0,07	EUR	100.000	Credit Agricole SA FRN 21/09/2029	102.246	0,07		
EUR	100.000	Teollisuuden Voima Oyj 1.38% 23/06/2028	102.133	0,07	EUR	100.000	Crown European Holdings SA 2.88% 01/02/2026	113.019	0,08		
				FRANCIA (continuación)							
				EUR				200.000	Electricite de France SA Perp FRN	199.900	0,14
				EUR				200.000	Electricite de France SA Perp FRN	207.545	0,15
				EUR				200.000	Electricite de France SA Perp FRN	228.173	0,16
				EUR				100.000	Electricite de France SA Perp FRN	115.812	0,08
				GBP				200.000	Electricite de France SA Perp FRN	261.114	0,19
				EUR				100.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	101.764	0,07
				EUR				100.000	Elis SA 1.00% 03/04/2025	107.820	0,08
				EUR				100.000	Emeria SASU 3.38% 31/03/2028	104.995	0,07
				EUR				400.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2027	398.266	0,27

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
FRANCIA (continuación)				ALEMANIA (continuación)					
EUR	187.000	Faurecia SE 2.75% 15/02/2027	190.677	0,13	EUR	89.000	Commerzbank AG 0.50% 04/12/2026	95.396	0,07
EUR	100.000	Faurecia SE 3.75% 15/06/2028	104.847	0,07	EUR	100.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	114.028	0,08
EUR	205.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	233.663	0,16	EUR	66.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	73.956	0,05
EUR	100.000	Holding d'infrastructures de Transport SASU 1.48% 18/01/2031	105.287	0,07	USD	150.000	Deutsche Bank AG FRN 28/05/2032	134.870	0,09
EUR	317.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	357.602	0,26	EUR	100.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	109.548	0,08
EUR	100.000	Iliad Holding SASU 5.63% 15/10/2028	111.292	0,08	EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	207.387	0,15
EUR	100.000	Iqera Group SAS 6.50% 30/09/2024	111.982	0,08	EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	214.754	0,14
EUR	100.000	La Financiere Atalian SASU 5.13% 15/05/2025	101.271	0,07	EUR	100.000	Deutsche Lufthansa AG 3.50% 14/07/2029	102.960	0,07
EUR	182.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	199.781	0,14	EUR	100.000	Deutsche Lufthansa AG 3.75% 11/02/2028	107.350	0,08
EUR	100.000	Loxam SAS 5.75% 15/07/2027	108.868	0,08	EUR	100.000	Douglas GmbH 6.00% 08/04/2026	106.180	0,07
EUR	100.000	Orano SA 3.38% 23/04/2026	114.494	0,08	EUR	111.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	120.419	0,08
EUR	100.000	Paprec Holding SA 3.50% 01/07/2028	106.281	0,07	EUR	100.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	108.485	0,08
EUR	160.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	179.584	0,13	EUR	210.000	HT Troplast AG 9.25% 15/07/2025	234.051	0,16
EUR	163.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	187.541	0,14	EUR	100.000	Infineon Technologies AG Perp FRN	111.634	0,08
EUR	117.000	Picard Groupe SAS 3.88% 01/07/2026	126.724	0,09	EUR	200.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	189.990	0,13
EUR	200.000	Renault SA 2.38% 25/05/2026	210.202	0,15	EUR	150.000	Nidda Healthcare Holding GmbH 3.50% 30/09/2024	160.510	0,11
EUR	100.000	Renault SA 2.50% 02/06/2027	102.727	0,07	EUR	215.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	228.189	0,17
EUR	100.000	Rexel SA 2.13% 15/06/2028	106.629	0,07	EUR	226.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	242.472	0,17
EUR	100.000	Rexel SA 2.13% 15/12/2028	105.355	0,07	EUR	191.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	210.735	0,15
EUR	100.000	Spie SA 3.13% 22/03/2024	114.337	0,08	EUR	100.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	111.928	0,08
EUR	200.000	Valeo 1.00% 03/08/2028	194.642	0,14	EUR	150.000	Schaeffler AG 2.88% 26/03/2027	164.671	0,12
EUR	100.000	Veolia Environnement SA Perp FRN	108.514	0,08	EUR	100.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	109.187	0,08
EUR	200.000	Verallia SA 1.63% 14/05/2028	207.951	0,15	EUR	100.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	109.187	0,08
EUR	100.000	Verallia SA 1.88% 10/11/2031	98.380	0,07	EUR	150.000	Schenck Process Holding GmbH 5.38% 15/06/2023	165.579	0,11
		Total de Francia	7.365.319	5,18	EUR	329.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 2.00% 15/07/2025	352.780	0,24
ALEMANIA					EUR	100.000	Tele Columbus AG 3.88% 02/05/2025	103.681	0,07
EUR	100.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	105.789	0,07	EUR	94.000	thyssenkrupp AG 2.50% 25/02/2025	104.339	0,07
EUR	100.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	93.611	0,07					
EUR	100.000	Bayer AG 1.13% 06/01/2030	104.304	0,07					
EUR	200.000	Bayer AG FRN 25/03/2082	224.973	0,16					
EUR	130.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	140.677	0,10					
EUR	101.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	111.262	0,08					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ALEMANIA (continuación)				ITALIA (continuación)					
EUR	110.000	Thyssenkrupp AG 2.88% 22/02/2024	122.194	0,09	EUR	100.000	IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3.75% 15/01/2028	104.518	0,07
EUR	100.000	TK Elevator Midco GmbH 4.38% 15/07/2027	110.127	0,08	EUR	174.000	International Design Group SPA 6.50% 15/11/2025	195.601	0,13
EUR	19.000	Volkswagen Financial Services AG 3.38% 06/04/2028	22.620	0,02	EUR	100.000	Intesa Sanpaolo SpA FRN 12/07/2029	116.139	0,08
EUR	100.000	ZF Finance GmbH 3.75% 21/09/2028	105.955	0,07	EUR	107.000	Leonardo SpA 2.38% 08/01/2026	120.488	0,08
		Total de Alemania	5.235.778	3,67	EUR	111.000	Marcolin SpA 6.13% 15/11/2026	120.312	0,08
					EUR	293.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	311.218	0,22
					EUR	120.000	Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	131.306	0,09
IRLANDA					EUR	150.000	Telecom Italia SpA 3.63% 25/05/2026	166.772	0,12
EUR	100.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	108.820	0,08	EUR	146.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	166.850	0,12
EUR	101.000	Eaton Capital Unlimi 0.58% 08/03/2030	103.206	0,07	EUR	100.000	Unipol Gruppo SpA 3.25% 23/09/2030	114.181	0,08
EUR	276.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	303.291	0,21			Total de Italia	3.454.213	2,42
EUR	100.000	Experian Europe DAC 1.56% 16/05/2031	109.378	0,08					
GBP	185.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III 4.88% 15/07/2028	230.428	0,16	JAPÓN				
		Total de Irlanda	855.123	0,60	USD	200.000	Central Nippon Expressway Company Limited 0.89% 10/12/2025	184.886	0,13
ISLA DE MAN					USD	200.000	Japan Finance Organization for Municipalities 0.63% 02/09/2025	185.272	0,13
EUR	142.000	Playtech plc 4.25% 07/03/2026	158.801	0,11	EUR	100.000	Softbank Group Corp. 2.88% 06/01/2027	99.478	0,07
		Total de Isla de Man	158.801	0,11	EUR	100.000	Softbank Group Corp. 3.13% 19/09/2025	104.698	0,07
ITALIA					EUR	100.000	Softbank Group Corp. 4.00% 19/09/2029	97.381	0,07
EUR	113.000	Atlantia SpA 1.88% 13/07/2027	120.185	0,08			Total de Japón	671.715	0,47
EUR	124.000	Atlantia SpA 1.88% 12/02/2028	130.760	0,09	JERSEY - ISLAS DEL CANAL				
EUR	206.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.63% 25/01/2028	220.294	0,15	EUR	100.000	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	109.497	0,08
EUR	100.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 01/02/2027	108.644	0,08	EUR	259.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	290.217	0,20
EUR	100.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 04/11/2025	110.323	0,08	EUR	100.000	Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	108.980	0,08
EUR	300.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	324.967	0,23			Total de Jersey - Islas del Canal	508.694	0,36
EUR	200.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 15/01/2030	210.146	0,15	LUXEMBURGO				
EUR	199.000	Autostrade per l'Italia SpA 4.38% 16/09/2025	238.735	0,17	EUR	200.000	Adler Group SA 2.75% 13/11/2026	186.904	0,13
EUR	170.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	172.209	0,13					
EUR	100.000	Banco BPM SpA 1.75% 24/04/2023	112.646	0,08					
EUR	149.000	Fis Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	157.919	0,11					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
LUXEMBURGO (continuación)				MÉXICO					
EUR	200.000	Adler Group SA 3.25% 05/08/2025	196.688	0,14	EUR	100.000	Petroleos Mexicanos 2.75% 21/04/2027	98.753	0,07
EUR	130.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	138.258	0,10	EUR	137.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 21/02/2024	153.031	0,11
EUR	100.000	Altice Financing SA 4.25% 15/08/2029	99.621	0,07	EUR	149.000	Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	153.997	0,11
EUR	137.000	Altice Finco SA 4.75% 15/01/2028	134.039	0,09	EUR	140.000	Petroleos Mexicanos 4.88% 21/02/2028	148.571	0,10
EUR	264.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	303.767	0,21	USD	50.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 04/08/2026	52.404	0,04
GBP	120.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	151.924	0,11			Total de México	606.756	0,43
GBP	140.000	B&m European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	180.786	0,13	PAÍSES BAJOS				
GBP	100.000	B&m European Value Retail SA 4.00% 15/11/2028	123.809	0,09	EUR	137.000	Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	141.023	0,10
EUR	100.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	91.692	0,06	EUR	100.000	Cooperatieve Rabobank UA 1.38% 03/02/2027	112.922	0,08
EUR	141.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	144.793	0,10	EUR	200.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	224.477	0,15
EUR	121.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	132.195	0,09	EUR	100.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	97.880	0,07
EUR	180.024	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	201.590	0,14	EUR	100.000	Dufry One BV 3.38% 15/04/2028	103.407	0,07
GBP	100.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	131.071	0,09	GBP	68.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	111.541	0,08
EUR	150.000	Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	171.073	0,12	EUR	100.000	Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	103.695	0,07
EUR	123.000	Holcim Finance Luxembourg SA Perp FRN	137.360	0,10	EUR	100.000	ING Groep NV FRN 16/02/2031	109.417	0,08
EUR	100.000	HSE Finance Sarl 5.63% 15/10/2026	105.681	0,07	EUR	128.000	Intertrust Group BV 3.38% 15/11/2025	142.513	0,10
EUR	284.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	290.877	0,21	EUR	100.000	Lkq European Holdings BV 4.13% 01/04/2028	115.425	0,08
EUR	100.000	Intralot Capital Lux 5.25% 15/09/2024	93.463	0,07	EUR	151.000	Nobel Bidco BV 3.13% 15/06/2028	150.069	0,11
EUR	198.000	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	220.651	0,15	EUR	90.000	Oci NV 3.63% 15/10/2025	101.883	0,07
EUR	100.000	Matterhorn Telecom SA 4.00% 15/11/2027	108.932	0,08	EUR	167.000	PPF Telecom Group BV 3.25% 29/09/2027	182.107	0,13
EUR	100.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	101.983	0,07	EUR	174.000	Repsol International Finance BV FRN 25/03/2075	201.806	0,14
EUR	100.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	109.369	0,08	EUR	224.000	Repsol International Finance BV Perp FRN	236.680	0,17
EUR	44.000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/01/2033	56.437	0,04	EUR	100.000	Repsol International Finance BV Perp FRN	112.385	0,08
EUR	100.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	108.990	0,08	EUR	100.000	Repsol International Finance BV Perp FRN	112.020	0,08
		Total de Luxemburgo	3.721.953	2,62	EUR	100.000	Stedin Holding NV Perp FRN	107.296	0,08
					EUR	131.619	Summer Bidco BV 9.00% 15/11/2025	146.204	0,10

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
PAÍSES BAJOS (continuación)				PORTUGAL (continuación)					
EUR	118.083	Summer Bidco BV 9.00% 15/11/2025	131.168	0,09	EUR	100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 30/04/2079	115.772	0,08
EUR	100.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	104.415	0,07			Total de Portugal	216.308	0,15
EUR	100.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	103.041	0,07					
EUR	200.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	206.082	0,14	RUMANÍA				
EUR	500.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	577.210	0,41	EUR	100.000	RCS & RDS SA 2.50% 05/02/2025	106.993	0,08
EUR	100.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	118.335	0,08			Total de Rumanía	106.993	0,08
EUR	287.000	Tennet Holding BV Perp FRN	320.616	0,23					
EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.75% 09/05/2027	105.452	0,07	ESPAÑA				
EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.38% 09/05/2030	103.589	0,07	EUR	100.000	Cellnex Finance Company 2.00% 15/02/2033	95.014	0,07
EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	112.366	0,08	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.00% 15/09/2027	101.002	0,07
EUR	100.000	Thermo Fisher Scientific Finance BV 1.63% 18/10/2041	100.262	0,07	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.25% 15/01/2029	97.434	0,06
EUR	100.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	105.111	0,07	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.50% 08/06/2028	101.430	0,07
EUR	180.000	United Group BV 4.63% 15/08/2028	187.704	0,13	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 2.25% 12/04/2026	110.438	0,08
EUR	100.000	Volkswagen International Finance NV 3.25% 18/11/2030	120.296	0,08	EUR	100.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	101.008	0,07
EUR	100.000	VZ Secured Financing BV Bond 3.50% 15/01/2032	102.600	0,07	EUR	144.000	Grifols Escrow Issuer SA 3.88% 15/10/2028	152.748	0,11
EUR	100.000	Vz Vendor Financing II BV 2.88% 15/01/2029	100.733	0,07	EUR	200.000	Grifols SA 2.25% 15/11/2027	213.043	0,15
EUR	100.000	ZF Europe Finance BV 3.00% 23/10/2029	99.645	0,07	EUR	100.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	110.878	0,08
Total de Países Bajos			5.311.375	3,71	EUR	100.000	Kaixo Bondco Telecom SA 5.13% 30/09/2029	104.683	0,07
					EUR	372.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	399.908	0,29
							Total de España	1.587.586	1,12
NORUEGA				SUECIA					
USD	244.000	Kommunalbanken AS 0.38% 11/09/2025	225.793	0,16	EUR	162.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	152.813	0,11
Total de Noruega			225.793	0,16	EUR	100.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	93.508	0,07
PANAMÁ									
EUR	201.000	Carnival Corp. 7.63% 01/03/2026	229.424	0,16	EUR	100.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	105.165	0,07
Total de Panamá			229.424	0,16	EUR	135.000	Intrum AB 3.50% 15/07/2026	144.425	0,10
PORTUGAL									
EUR	100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 14/03/2082	100.536	0,07	EUR	100.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	112.326	0,08
EUR	100.000				EUR	100.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	104.436	0,07
EUR	100.000				EUR	100.000	Sagax AB 2.25% 13/03/2025	112.263	0,08
EUR	199.000				EUR	199.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	208.442	0,15
EUR	100.000				EUR	100.000	Verisure Holding AB 3.88% 15/07/2026	108.981	0,08

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
SUECIA (continuación)				REINO UNIDO (continuación)					
EUR	155.000	Verisure Midholding AB 5.25% 15/02/2029	159.643	0,11	GBP	100.000	Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	133.312	0,09
		Total de Suecia	1.302.002	0,92	EUR	100.000	International Game Technology plc 2.38% 15/04/2028	104.070	0,07
					EUR	100.000	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	113.897	0,08
					EUR	190.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	213.390	0,15
					GBP	287.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	376.825	0,26
					EUR	100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.20% 15/01/2024	107.809	0,08
					EUR	100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 4.50% 15/07/2028	100.919	0,07
					EUR	136.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	154.379	0,11
					EUR	100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	114.549	0,08
					GBP	200.000	Jerrold Finco plc 5.25% 15/01/2027	254.365	0,18
					GBP	32.000	Lloyds TSB Bank plc 7.63% 22/04/2025	47.547	0,03
					GBP	201.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	259.755	0,18
					EUR	100.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	99.170	0,07
					EUR	100.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	101.098	0,07
					EUR	100.000	Natwest Group plc FRN 26/02/2030	102.652	0,07
					EUR	300.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	335.946	0,24
					GBP	204.000	Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	264.911	0,19
					GBP	100.000	Rolls-Royce plc 5.75% 15/10/2027	137.549	0,10
					GBP	15.000	Santander UK plc Perp 10.06%	34.734	0,02
					EUR	171.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	181.947	0,13
					EUR	100.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	111.784	0,08
					GBP	100.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	125.322	0,09
					GBP	93.531	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	146.016	0,10
					EUR	100.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	105.759	0,07
					GBP	100.000	Travis Perkins plc 3.75% 17/02/2026	130.793	0,09
					EUR	200.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	214.548	0,15

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)			
REINO UNIDO (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
GBP	181.000 Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	234.531	0,17	USD	106.000 Bank of America Corp. FRN 11/03/2032	97.397	0,07
EUR	222.000 Vmed O2 UK Financing 3.25% 31/01/2031	228.372	0,16	USD	30.000 Bank of America Corp. FRN 04/02/2033	28.166	0,02
EUR	100.000 Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	108.288	0,08	USD	42.000 Bank of America Corp. FRN 23/07/2030	40.674	0,03
GBP	255.000 Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	340.413	0,24	USD	137.000 BAT Capital Corp. 4.70% 02/04/2027	140.152	0,10
USD	231.000 Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	238.450	0,17	USD	16.000 Berkshire Hathaway Finance Corp 4.25% 15/01/2049	17.468	0,01
USD	159.000 Vodafone Group plc FRN 04/04/2079	176.267	0,12	USD	25.000 Boeing Company 3.95% 01/08/2059	21.760	0,02
GBP	284.000 Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	344.306	0,24	USD	30.000 Boeing Company 5.93% 01/05/2060	34.895	0,02
	Total de Reino Unido	8.465.026	5,93	USD	15.000 Bristol-Myers Squibb Company 3.70% 15/03/2052	15.135	0,01
				USD	28.000 Broadcom Inc. 4.15% 15/11/2030	28.362	0,02
ESTADOS UNIDOS				USD	52.000 Broadcom Inc. 5.00% 15/04/2030	55.403	0,04
USD	83.000 AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	87.148	0,06	EUR	200.000 Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	208.872	0,15
USD	32.000 AbbVie Inc. 4.88% 14/11/2048	36.497	0,03	USD	57.000 Charter Communications Operating LLC 3.95% 30/06/2062	46.254	0,03
USD	22.000 AEP Texas Inc. 3.45% 15/05/2051	19.640	0,01	USD	41.000 Chubb Ina Holdings Inc. 3.05% 15/12/2061	35.542	0,02
USD	70.000 Amazon.com Inc. 3.10% 12/05/2051	66.057	0,05	USD	21.000 Cigna Corp. 4.90% 15/12/2048	23.708	0,02
USD	32.000 Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	31.431	0,02	USD	150.000 Citigroup Inc. FRN 31/03/2031	156.111	0,12
USD	35.000 Amgen Inc. 3.15% 21/02/2040	32.081	0,02	USD	17.000 Commonwealth Edison Company 4.00% 01/03/2049	17.781	0,01
USD	12.000 Amgen Inc. 4.20% 22/02/2052	12.458	0,01	USD	15.000 Consolidated Edison Co of NY 3.95% 01/04/2050	15.536	0,01
USD	148.000 Anheuser-Busch Companies LLC 4.70% 01/02/2036	161.216	0,11	USD	21.000 CSX Corp. 3.80% 15/04/2050	21.277	0,01
USD	50.000 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 4.35% 01/06/2040	52.155	0,04	USD	33.000 CVS Health Corp. 5.05% 25/03/2048	37.489	0,03
USD	28.000 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	32.742	0,02	USD	46.000 Duke Energy Progress Inc. 4.20% 15/08/2045	48.363	0,03
USD	81.000 Apple Inc. 2.65% 11/05/2050	70.723	0,05	USD	30.000 Emera USA Finance LP 4.75% 15/06/2046	31.441	0,02
EUR	219.000 Ardagh Metal Packaging 2.00% 01/09/2028	225.184	0,15	USD	53.000 Enterprise Products Operating LLC 4.45% 15/02/2043	53.397	0,04
USD	15.000 AT&T Inc. 3.50% 01/06/2041	13.842	0,01	USD	94.000 Eversource Energy 2.55% 15/03/2031	86.233	0,06
USD	119.000 AT&T Inc. 3.50% 15/09/2053	105.543	0,07	USD	27.000 Eversource Energy 3.38% 01/03/2032	26.460	0,02
USD	91.000 AT&T Inc. 4.90% 15/08/2037	99.134	0,07	USD	25.000 Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	22.896	0,02
EUR	158.000 Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	178.304	0,13	USD	31.000 Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	28.391	0,02
USD	30.000 Bank of America Corp. FRN 21/07/2032	26.661	0,02				
USD	53.000 Bank of America Corp. FRN 13/02/2031	48.779	0,03				
USD	136.000 Bank of America Corp. FRN 29/04/2031	125.757	0,09				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	20.000	Federal Home Loan Banks 5.50% 15/07/2036	26.476	0,02	USD	65.000	Lowe's Cos Inc. 3.75% 01/04/2032	65.738	0,05
USD	15.000	Fedex Corp. 4.95% 17/10/2048	16.786	0,01	USD	25.000	Microsoft Corp. 4.10% 06/02/2037	27.726	0,02
EUR	100.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	110.618	0,08	USD	75.000	Morgan Stanley FRN 21/01/2033	70.291	0,05
EUR	100.000	Ford Motor Credit Company LLC 1.36% 07/02/2025	107.340	0,08	GBP	173.000	MPT Operating Partnership 3.69% 05/06/2028	221.713	0,15
EUR	196.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.33% 25/11/2025	214.512	0,15	EUR	203.000	Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	241.729	0,17
EUR	100.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	109.317	0,08	EUR	200.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	236.041	0,17
GBP	100.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	127.784	0,09	USD	25.000	Nisource Finance Corp. 4.38% 15/05/2047	25.523	0,02
EUR	323.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	364.277	0,25	USD	115.000	Nisource Finance Corp. 4.80% 15/02/2044	119.912	0,08
GBP	200.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	263.899	0,18	USD	35.000	Occidental Petroleum Corp. 3.20% 15/08/2026	34.491	0,02
EUR	10.000	General Electric Company 4.13% 19/09/2035	13.207	0,01	USD	45.000	Occidental Petroleum Corp. 5.88% 01/09/2025	47.852	0,03
USD	100.000	General Motors Financial Company Inc. 2.40% 15/10/2028	89.901	0,06	USD	28.000	Occidental Petroleum Corp. 6.38% 01/09/2028	31.605	0,02
USD	19.000	Georgia Power Company 3.70% 30/01/2050	17.837	0,01	USD	56.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	64.330	0,05
USD	40.000	Goodman USA Finance Three 3.70% 15/03/2028	40.035	0,03	USD	45.000	Occidental Petroleum Corp. 8.00% 15/07/2025	50.556	0,04
USD	22.000	Intel Corp. 3.05% 12/08/2051	19.832	0,01	USD	30.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	35.620	0,02
USD	36.000	Intel Corp. 4.75% 25/03/2050	42.147	0,03	USD	65.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	83.764	0,06
EUR	200.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/01/2028	211.837	0,15	EUR	200.000	Olympus Water USA 3.88% 01/10/2028	204.959	0,15
EUR	216.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/03/2029	220.895	0,15	USD	44.000	Oracle Corp. 2.88% 25/03/2031	40.189	0,03
EUR	100.000	Iqvia Inc. 2.88% 15/06/2028	107.602	0,08	USD	29.000	Oracle Corp. 3.60% 01/04/2040	25.219	0,02
USD	40.000	JPMorgan Chase & Company FRN 04/02/2032	35.079	0,02	USD	29.000	Oracle Corp. 3.65% 25/03/2041	25.295	0,02
USD	64.000	JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	58.391	0,04	USD	78.000	Pacific Gas and Electric Company 4.95% 01/07/2050	74.256	0,05
USD	110.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	100.864	0,07	USD	20.000	Piedmont Natural Gas Company Inc. 3.35% 01/06/2050	17.914	0,01
USD	33.000	JPMorgan Chase & Company FRN 25/01/2033	31.147	0,02	USD	39.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	37.741	0,03
USD	45.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2041	40.820	0,03	USD	39.000	Plains All American Pipeline LP 4.70% 15/06/2044	36.555	0,03
USD	58.000	JPMorgan Chase & Company FRN 24/07/2038	58.837	0,04	USD	33.000	PPL Electric Utilities Corp 4.15% 15/06/2048	34.964	0,02
USD	29.000	Kimco Realty Corp. 2.25% 01/12/2031	25.889	0,02	EUR	100.000	Prologis Euro Finance LLC 1.00% 08/02/2029	105.549	0,07
USD	78.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	80.701	0,05	USD	40.000	Relx Capital Inc. 3.50% 16/03/2023	40.350	0,03
GBP	100.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	138.282	0,10	USD	30.000	San Diego Gas & Electric Company 3.32% 15/04/2050	28.079	0,02
USD	10.000	Kraft Heinz Foods Company 4.38% 01/06/2046	9.963	0,01	USD	37.000	San Diego Gas & Electric Company 4.15% 15/05/2048	39.172	0,03

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				CANADÁ					
EUR	100.000	Scientific Games International Inc. 5.50% 15/02/2026	114.464	0,08	CAD	47.000	Canada (Govt of) 2.75% 01/12/2048	40.270	0,03
EUR	100.000	Silgan Holdings Inc. 2.25% 01/06/2028	101.552	0,07	CAD	200.000	Canada Housing Trust No 1 1.10% 15/03/2031	138.030	0,10
EUR	129.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	143.029	0,10	USD	80.000	Province of Ontario Canada 1.13% 07/10/2030	70.578	0,05
USD	22.000	Southern California Edison Company 4.13% 01/03/2048	21.657	0,02	Total de Canadá			248.878	0,18
USD	19.000	Southern Company 4.40% 01/07/2046	19.530	0,01	FRANCIA				
EUR	121.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	134.204	0,09	EUR	100.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/02/2028	105.375	0,07
GBP	50.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	74.698	0,05	USD	200.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.38% 23/09/2025	184.759	0,13
USD	23.000	T-Mobile USA Inc. 2.63% 15/02/2029	21.053	0,01	USD	200.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 1.00% 21/10/2030	176.003	0,12
USD	50.000	T-Mobile USA Inc. 3.40% 15/10/2052	42.921	0,03	USD	200.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 20/01/2031	180.606	0,13
USD	40.000	Verizon Communications Inc. 2.65% 20/11/2040	34.118	0,02	EUR	95.720	France (Govt of) OAT 0.50% 25/06/2044	90.200	0,06
USD	27.000	Verizon Communications Inc. 3.70% 22/03/2061	25.329	0,02	EUR	15.000	France (Govt of) OAT 0.75% 25/05/2053	13.837	0,01
USD	101.000	Verizon Communications Inc. 4.40% 01/11/2034	107.836	0,08	EUR	57.014	France (Govt of) OAT 1.25% 25/05/2034	64.692	0,05
USD	50.000	Williams Partners LP 4.85% 01/03/2048	53.551	0,03	EUR	58.000	France (Govt of) OAT 1.50% 25/05/2031	68.125	0,05
Total de Estados Unidos			8.409.865	5,88	EUR	100.000	Unedic Asseo 0.25% 16/07/2035	96.325	0,07
ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)				ALEMANIA					
USD	200.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	204.561	0,14	EUR	104.000	Germany (Govt of) 0.00% 09/10/2026	113.978	0,08
Total de Islas Vírgenes (Británicas)			204.561	0,14	EUR	50.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2050	46.646	0,03
Total de bonos			50.575.131	35,49	Total de Alemania			160.624	0,11
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				ITALIA					
AUSTRIA				USD	200.000	Italy (Govt of) 1.25% 17/02/2026	184.406	0,13	
EUR	5.000	Austria (Govt of) 0.85% 30/06/2120	3.613	0,00	EUR	21.000	Italy (Govt of) 1.50% 30/04/2045	19.930	0,01
Total de Austria			3.613	0,00	EUR	25.000	Italy (Govt of) 2.15% 01/03/2072	23.740	0,02
BÉLGICA				EUR	93.000	Italy (Govt of) BPT 0.95% 01/08/2030	96.554	0,07	
EUR	13.000	Kingdom of Belgium (Govt of) 1.70% 22/06/2050	15.158	0,01	Total de Italia			324.630	0,23
Total de Bélgica			15.158	0,01					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					
JAPÓN				SUPRANACIONAL (continuación)					
JPY	10.450.000	Japan (Govt of) Forty Year Bond 0.40% 20/03/2056	73.091	0,05	USD	150.000	Inter-American Development Bank 3.00% 21/02/2024	151.975	0,11
JPY	24.900.000	Japan (Govt of) Ten Year Bond 0.10% 20/12/2031	202.999	0,14	USD	250.000	International Bank for Reconstruction & Development FRN 18/09/2025	251.251	0,17
JPY	5.050.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.40% 20/06/2049	36.658	0,03	USD	135.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 11/03/2025	128.213	0,09
JPY	4.500.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.40% 20/03/2050	32.569	0,02	USD	80.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.88% 14/05/2030	70.422	0,05
JPY	7.600.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.60% 20/09/2050	57.899	0,04	USD	100.000	International Bank for Reconstruction & Development 1.88% 27/10/2026	97.347	0,07
JPY	5.550.000	Japan (Govt of) Twenty Year Bond 0.50% 20/12/2041	44.141	0,03	AUD	70.000	International Finance Corp. 1.50% 15/04/2035	41.097	0,03
		Total de Japón	447.357	0,31	USD	200.000	New Development Bank 0.63% 29/09/2025	181.196	0,12
						Total de supranacional	1.211.389	0,86	
MÉXICO									
USD	2.000.000	Mexico (Govt of) 5.75% 12/10/2110	2.036.199	1,42					
		Total de México	2.036.199	1,42					
ESPAÑA				REINO UNIDO					
EUR	45.000	Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2027	47.764	0,03	GBP	59.000	United Kingdom Gilt 0.13% 30/01/2026	74.098	0,05
EUR	9.000	Spain (Govt of) 0.10% 30/04/2031	9.015	0,01	GBP	161.000	United Kingdom Gilt 0.13% 31/01/2028	196.447	0,14
EUR	11.000	Spain (Govt of) 1.00% 30/07/2042	10.601	0,01	GBP	103.000	United Kingdom Gilt 0.63% 31/07/2035	116.758	0,08
EUR	19.000	Spain (Govt of) 1.45% 31/10/2071	15.446	0,01	GBP	21.000	United Kingdom Gilt 0.88% 31/07/2033	25.334	0,02
EUR	18.000	Spain (Govt of) 2.90% 31/10/2046	24.134	0,02	GBP	3.000	United Kingdom Gilt 1.13% 31/01/2039	3.539	0,00
		Total de España	106.960	0,08	GBP	62.000	United Kingdom Gilt 1.75% 22/01/2049	80.920	0,06
						Total de Reino Unido	497.096	0,35	
SUPRANACIONAL				ESTADOS UNIDOS					
USD	80.000	Asian Development Bank 0.75% 08/10/2030	69.754	0,05	USD	40.000	United States Treasury N/B 0.25% 15/06/2024	38.166	0,03
USD	124.000	Asian Development Bank 1.75% 19/09/2029	117.498	0,08	USD	97.000	United States Treasury N/B 0.50% 31/10/2027	87.111	0,06
USD	25.000	European Investment Bank 0.63% 21/10/2027	22.519	0,02	USD	80.000	United States Treasury N/B 0.63% 15/08/2030	69.494	0,05
USD	25.000	European Investment Bank 1.63% 13/05/2031	23.435	0,02	USD	34.200	United States Treasury N/B 0.75% 31/05/2026	31.811	0,02
EUR	8.000	European Union 0.10% 04/10/2040	7.177	0,01	USD	132.000	United States Treasury N/B 0.75% 31/01/2028	119.790	0,08
EUR	18.000	IBRD 0.20% 21/01/2061	13.687	0,01					
USD	40.000	Inter-American Development Bank 1.13% 13/01/2031	35.818	0,03					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Renta variable (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ISLAS CAIMÁN					
USD	145.000	United States Treasury N/B 1.00% 31/07/2028	132.698	0,09	46.000	China Mengniu Dairy Company Limited	247.874	0,18	
USD	263.600	United States Treasury N/B 1.13% 15/08/2040	207.234	0,14	74.000	China Resources Land Limited	344.894	0,24	
USD	38.000	United States Treasury N/B 1.25% 15/05/2050	28.363	0,02	195	JD.com Inc. - A	5.827	0,00	
USD	18.000	United States Treasury N/B 1.38% 15/11/2040	14.750	0,01	16.955	NetEase Inc.	311.327	0,22	
USD	149.600	United States Treasury N/B 1.38% 15/08/2050	115.239	0,08	504	Netease.com - ADR	45.204	0,03	
USD	112.200	United States Treasury N/B 1.88% 15/02/2051	98.473	0,07	4.100	Tencent Holdings Limited	195.906	0,14	
Total de Estados Unidos			943.129	0,65	Total de Islas Caimán			1.151.032	0,81
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				6.974.955	4,89	CHINA			
Renta variable				DINAMARCA					
AUSTRALIA				FINLANDIA					
5.200	Aristocrat Leisure Limited	143.311	0,10	148.300	Baoshan Iron & Steel Company Limited - A	157.688	0,11		
19.303	Australia & New Zealand Banking Group Limited	400.078	0,28	302.000	China Construction Bank Corp.	227.134	0,16		
2.191	Carsales.Com Limited	34.420	0,02	48.500	China Merchants Bank Company Limited - H	381.180	0,27		
107.542	Deterra Royalties Limited	390.064	0,27	35.100	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	203.972	0,14		
38.060	Dexus Property Group	312.964	0,22	37.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	262.922	0,18		
3.208	Macquarie Group Limited	489.687	0,34	3.700	Wuliangye Yibin Company Limited - A	90.377	0,06		
11.612	Oz Minerals Limited	232.563	0,16	Total de China			1.323.273	0,92	
39.074	Transurban Group	397.593	0,28	FRANCIA					
Total de Australia			2.400.680	1,67	852	Air Liquide SA	150.653	0,11	
BÉLGICA				12.366	AXA SA	365.509	0,26		
3.144	KBC Group NV	228.710	0,16	2.973	BNP Paribas	171.780	0,12		
2.688	Melexis NV	251.227	0,18	3.382	Compagnie de Saint-Gobain	204.217	0,14		
Total de Bélgica			479.937	0,34	2.912	Edenred	145.542	0,10	
CANADÁ				372	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	268.790	0,19		
675	Canadian National Railway Company	90.627	0,06	3.682	Nexity SA	130.687	0,09		
3.263	Manulife Financial Corp.	69.646	0,05	1.042	Pernod-Ricard SA	231.065	0,16		
514	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	30.341	0,02	1.775	Schneider Electric SE	300.509	0,21		
2.319	Suncor Energy Inc.	75.564	0,05	6.428	Total SA	329.212	0,23		
Total de Canadá			266.178	0,18	2.278	Vinci SA	235.694	0,17	
				Total de Francia			2.533.658	1,78	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)				
ALEMANIA				IRLANDA (continuación)				
2.690	Brenntag AG	219.509	0,15	1.426	Experian plc	55.406	0,04	
3.907	Daimler Truck Holding AG	109.678	0,08	205	Linde plc	65.483	0,05	
3.668	Deutsche Telekom AG - Reg	69.103	0,05	2.634	Medtronic Inc.	292.242	0,20	
3.752	E.ON AG	44.009	0,03	3.647	Trinseo plc	174.764	0,12	
1.525	Evonik Industries AG	42.725	0,03	Total de Irlanda			1.828.975	1,27
3.222	Mercedes-Benz Group AG - Reg	228.756	0,15	ITALIA				
107	Muenchener Rueckversicherungs AG - Reg	28.930	0,02	30.414	Enel SpA	205.342	0,14	
1.697	SAP SE	190.931	0,13	9.721	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	109.945	0,08	
2.839	Siemens AG - Reg	396.936	0,28	14.790	Nexi SpA	172.789	0,12	
1.775	Siemens Healthineers AG	111.071	0,08	Total de Italia			488.076	0,34
620	Volkswagen AG Pfd	108.305	0,08	JAPÓN				
3.626	Vonovia SE	170.698	0,12	200	Disco Corp.	56.683	0,04	
Total de Alemania				800	Rohm Company Limited	63.209	0,04	
1.720.651				4.900	Z Holdings Corp.	21.655	0,02	
1,20				Total de Japón			141.547	0,10
HONG KONG				JERSEY - ISLAS DEL CANAL				
43.800	AIA Group Limited	461.132	0,32	23.911	WPP plc	315.769	0,22	
33.000	Galaxy Entertainment Group Limited	198.049	0,14	Total de Jersey - Islas del Canal			315.769	0,22
5.100	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	241.865	0,17	PAÍSES BAJOS				
25.000	Sun Hung Kai Properties Limited	298.797	0,21	518	Akzo Nobel NV	45.082	0,03	
95.000	Xinyi Glass Holdings Limited	230.483	0,17	840	ASM International NV	310.389	0,22	
Total de Hong Kong				16.716	ING Groep NV	176.896	0,12	
1.430.326				915	Koninklijke DSM NV	165.437	0,12	
1,01				896	Philips NV	27.645	0,02	
INDIA				Total de Países Bajos			725.449	0,51
53.600	Embassy Office Parks REIT	262.961	0,18	NORUEGA				
10.964	HDFC Bank Limited	212.748	0,15	1.938	Equinor ASA	73.406	0,05	
31.951	Hindalco Industries Limited	240.134	0,17	Total de Noruega			73.406	0,05
53.158	Petronet Lng Limited	135.921	0,10	REPÚBLICA DE COREA (SUR)				
15.379	Tech Mahindra Limited	304.323	0,21	9.404	Hanon Systems	91.553	0,06	
Total de India				6.066	KB Financial Group Inc.	306.791	0,22	
1.156.087				2.141	Kia Corp.	130.716	0,09	
0,81				10.398	Kt Corp.	306.266	0,21	
INDONESIA				826	Posco Holdings Inc.	199.677	0,14	
877.221	Bank Rakyat Indonesia	284.637	0,20	1.986	Samsung Electronics Company Limited	114.043	0,08	
930.800	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	296.837	0,21	IRLANDA				
Total de Indonesia				1.407	CRH plc	56.906	0,04	
581.474				5.095	CRH plc	206.080	0,14	
0,41				6.445	Eaton Corp. plc	978.094	0,68	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)			
REPÚBLICA DE COREA (SUR) (continuación)				TAILANDIA			
10.838	Samsung Electronics Company Limited Pfd	563.339	0,40	83.200	PTT Exploration & Production pcl	360.323	0,25
3.680	SK Telecom Company Limited	172.759	0,12	556.500	Thai Beverage pcl	294.009	0,21
Total de República de Corea (Sur)		1.885.144	1,32	Total de Tailandia		654.332	0,46
SINGAPUR				REINO UNIDO			
194.600	Capitamall Trust	323.530	0,23	23.495	3i Group plc	429.528	0,30
800	DBS Group Holdings Limited	21.180	0,01	5.006	Anglo American plc	261.834	0,19
205.500	Digital Core REIT Management Pte Limited	228.105	0,16	2.878	Astrazeneca plc	383.934	0,27
73.100	Keppel Corp. Limited	346.771	0,24	31.373	BT Group plc	75.262	0,05
17.100	United Overseas Bank Limited	404.583	0,28	961	Diageo plc	48.885	0,03
Total de Singapur		1.324.169	0,92	12.139	Glaxosmithkline plc	263.269	0,18
ESPAÑA				89.334	lbstock plc	206.308	0,15
22.981	Iberdrola SA	253.653	0,18	2.207	London Stock Exchange Group plc	231.480	0,16
13.003	Inditex SA	286.173	0,20	6.671	Persimmon plc	188.930	0,13
Total de España		539.826	0,38	838	Reckitt Benckiser Group plc	64.348	0,05
SUECIA				14.014	St James's Place plc	267.270	0,19
2.189	Atlas Copco AB	100.884	0,07	1.046.843	Supermarket Income Reit plc	1.743.582	1,23
9.436	Sandvik AB	203.515	0,14	1.100.000	Target Healthcare REIT plc	1.625.009	1,14
8.752	Volvo AB - B	165.848	0,12	216.124	Vodafone Group plc	355.244	0,25
Total de Suecia		470.247	0,33	Total de Reino Unido			
SUIZA				6.144.883			
4,32				ESTADOS UNIDOS			
1.580	Nestle SA - Reg	206.374	0,14	7.678	American Electric Power Company Inc.	766.034	0,54
595	Novartis AG - Reg	52.533	0,04	184	American Tower Corp.	46.224	0,03
147	Partners Group Holding AG - Reg	184.259	0,13	389	Analog Devices Inc.	64.255	0,05
3.971	TE Connectivity Limited	520.121	0,36	177	Anthem Inc.	86.946	0,06
Total de Suiza		963.287	0,67	3.205	Apple Inc.	559.625	0,39
TAIWÁN				13.727	AT&T Inc.	324.369	0,23
23.000	Chailease Holding Company Limited	203.496	0,14	3.007	Automatic Data Processing Inc.	684.214	0,48
36.000	Chroma ATE Inc.	226.165	0,16	670	BlackRock Inc.	511.994	0,36
5.000	MediaTek Inc.	157.932	0,11	10.906	Bristol-Myers Squibb Company	796.465	0,56
59.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	1.229.354	0,86	2.027	Broadcom Inc.	1.276.362	0,91
14.000	Yageo Corp.	212.065	0,15	3.713	Caterpillar Inc.	827.330	0,59
Total de Taiwán		2.029.012	1,42	3.456	Chevron Corp.	562.740	0,39
				14.921	Cisco Systems Inc.	831.995	0,58
				2.587	CME Group Inc.	615.344	0,44
				1.265	Coca Cola Company	78.430	0,05
				15.237	Comcast Corp.	713.396	0,50
				16.028	Conocophillips	1.602.800	1,13
				382	Crown Castle International Corp.	70.517	0,05
				5.321	DuPont de Nemours Inc.	391.519	0,27
				9.519	Ebay Inc.	545.058	0,38
				4.902	Edison International	343.630	0,24

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)			
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
4.125	Eli Lilly & Company	1.181.276	0,82	8.010	Xcel Energy Inc.	578.082	0,41
6.107	Equity Lifestyle Properties Inc.	467.063	0,33				
504	Fidelity National Information Services Inc.	50.612	0,04		Total de Estados Unidos	38.507.958	27,04
1.961	General Motors Company	85.774	0,06		Total de renta variable	69.746.098	48,91
106	Grainger (WWW) Inc.	54.674	0,04				
3.631	Home Depot Inc.	1.086.868	0,77		Bonos - convertibles		
305	IBM Corp.	39.656	0,03		CANADÁ		
672	IntercontinentalExchange Inc.	88.785	0,06		USD 149.000	Air Canada 4.00% 01/07/2025	216.959 0,15
6.260	Johnson & Johnson	1.109.460	0,78			Total de Canadá	216.959 0,15
2.913	JPMorgan Chase & Company	397.100	0,28			Total de bonos - convertibles	216.959 0,15
2.824	KLA Corp.	1.033.753	0,72			Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	127.513.143 89,44
8.969	Kontoor Brands Inc.	370.869	0,26			Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente	
4.742	Lamb Weston Holding Inc.	284.093	0,20			Bonos	
295	Marsh & McLennan Companies Inc.	50.274	0,04			AUSTRALIA	
1.043	Mastercard Inc. - A	372.747	0,26		USD 35.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	35.947 0,03
283	McDonald's Corp.	69.980	0,05		USD 137.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	141.533 0,10
8.974	Merck & Company Inc.	736.317	0,52			Total de Australia	177.480 0,13
10.496	Metlife Inc.	737.659	0,51			BERMUDAS	
8.666	Microsoft Corp.	2.671.815	1,88		USD 100.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	104.435 0,07
6.384	Moelis & Company - A	299.729	0,21			Total de Bermudas	104.435 0,07
7.965	Morgan Stanley	696.141	0,50			CANADÁ	
5.424	NextEra Energy Inc.	459.467	0,32		USD 18.000	Rogers Communications 3.80% 15/03/2032	17.866 0,01
4.095	Northern Trust Corp.	476.863	0,33			Total de Canadá	17.866 0,01
24.515	Nortonlifelock Inc.	650.138	0,46			PAÍSES BAJOS	
5.818	PepsiCo Inc.	973.816	0,69		USD 15.000	E.ON International Finance BV 6.65% 30/04/2038	18.827 0,01
9.817	Philip Morris International Inc.	922.209	0,65			Total de Países Bajos	18.827 0,01
7.512	Procter & Gamble Company	1.147.834	0,80				
6.399	Prologis Inc.	1.033.311	0,72				
220	Qualcomm Inc.	33.620	0,02				
455	Quest Diagnostics Inc.	62.271	0,04				
7.801	Raytheon Technologies Corp.	772.845	0,54				
1.027	SBA Communications	353.391	0,24				
350	Stanley Works	48.927	0,03				
6.325	Starbucks Corp.	575.385	0,40				
1.154	State Street Corp.	100.536	0,07				
11.004	Store Capital Corp.	321.647	0,23				
3.242	Target Corp.	688.017	0,48				
4.056	Texas Instruments Inc.	744.195	0,52				
8.457	Tjx Companies Inc.	512.325	0,36				
12.263	Truist Financial Corp.	695.312	0,49				
3.870	Union Pacific Corp.	1.057.323	0,74				
5.026	United Parcel Service Inc.	1.077.875	0,76				
4.582	Valero Energy Corp.	465.256	0,33				
14.009	Verizon Communications Inc.	713.618	0,50				
3.608	Virtu Financial Inc.	134.290	0,09				
4.906	Voya Financial Inc.	325.513	0,23				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					
Bonos (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					
ESTADOS UNIDOS				ESTADOS UNIDOS					
USD	21.000	American Transmission Systems Inc. 2.65% 15/01/2032	19.381	0,01	USD	180.000	Fannie Mae 5.63% 15/07/2037	239.678	0,17
USD	48.000	Atlantic City Electric 2.30% 15/03/2031	44.637	0,03	Total de Estados Unidos			239.678	0,17
USD	119.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	111.960	0,08	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
USD	25.000	Guardian Life Insurance Company of America 4.85% 24/01/2077	27.688	0,02	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
USD	47.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	43.855	0,03				1.583.462	1,11
USD	57.000	Magallanes Inc. 5.14% 15/03/2052	58.470	0,04	Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				
USD	50.000	Magallanes Inc. 5.39% 15/03/2062	51.826	0,04	Bonos				
USD	35.000	Metropolitan Edison Company 4.30% 15/01/2029	36.402	0,03	CANADÁ				
USD	156.000	Metropolitan Life Global Funding I 1.55% 07/01/2031	134.561	0,09	CAD	50.000	Rogers Communications Inc. 3.65% 31/03/2027	39.609	0,03
USD	17.000	New York Life Insurance Company 4.45% 04/04/2069	17.700	0,01	Total de Canadá			39.609	0,03
USD	18.000	Northwestern Mutual 3.85% 30/09/2047	17.703	0,01	PORTUGAL				
USD	86.000	Northwestern Mutual L 3.45% 30/03/2051	78.513	0,06	EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2099**	12.239	0,01
USD	8.000	Northwestern Mutual Life Insurance Co/The 3.63% 30/09/2059	7.314	0,01	Total de Portugal			12.239	0,01
USD	45.000	Occidental Petroleum Corp. 6.95% 01/07/2024	48.431	0,03	REINO UNIDO				
USD	25.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	31.250	0,02	EUR	100.000	BCP V Modular Services Finance II plc 6.75% 30/11/2029	101.507	0,07
USD	200.000	Roche Holdings Inc. 1.93% 13/12/2028	186.261	0,13	GBP	235.000	Bellis Acquisition Company 3.25% 16/02/2026	286.640	0,19
USD	11.000	Teachers Insurance & Annuity Association America 4.90% 15/09/2044	12.198	0,01	GBP	100.000	Bracken Midco1 plc 6.75% 01/11/2027	127.162	0,09
USD	75.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.27% 15/05/2047	79.941	0,06	GBP	205.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	261.496	0,17
USD	20.000	T-Mobile USA Inc. 3.60% 15/11/2060	17.085	0,01	GBP	100.000	Pinewood Finance Company Limited 3.63% 15/11/2027	123.597	0,09
Total de Estados Unidos		1.025.176	0,72	GBP	100.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	125.100	0,09	
Total de bonos		1.343.784	0,94	GBP	166.000	Talktalk Telecom Group plc 3.88% 20/02/2025	190.705	0,13	
				GBP	145.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.50% 15/07/2031	176.056	0,12	
				Total de Reino Unido			1.392.263	0,95	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)				
Bonos (continuación)				
ESTADOS UNIDOS				
USD	45.000	Broadcom Inc. 2.45% 15/02/2031	40.013	0,03
Total de Estados Unidos		40.013	0,03	
Total de bonos		1.484.124	1,02	
Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario		1.484.124	1,02	
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				
Fondos				
LUXEMBURGO				
	20.271	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income Fund XUP***	286.675	0,20
	24.810	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds XUP***	214.969	0,15
Total de Luxemburgo		501.644	0,35	
Total de fondos		501.644	0,35	
Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		501.644	0,35	
Otros organismos de inversión colectiva				
Fondos				
REINO UNIDO				
USD	106.746	Threadneedle Specialist Investment Funds ICVC - Emerging Market Local Fund****	297.790	0,21
Total de Reino Unido		297.790	0,21	
Total de fondos		297.790	0,21	
Total de otros organismos de inversión colectiva		297.790	0,21	
Valor total de las inversiones		131.380.163	92,13	
(Coste total: 124.614.784 USD)				

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

** Título a su valor razonable.

*** Consulte la nota 18.

**** Fondo de parte vinculada.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BRASIL				HONG KONG			
20.622	Azul SA	103.805	1,70	9.000	AIA Group Limited	94.753	1,55
17.816	Itau Unibanco Holding SA - ADR	101.729	1,67	1.300	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	61.652	1,01
11.131	Localiza Rent a Car	143.122	2,34	7.476	Techtronic Industries Company	121.141	1,99
	Total de Brasil	348.656	5,71		Total de Hong Kong	277.546	4,55
ISLAS CAIMÁN				INDIA			
2.281	Afyra Limited	32.869	0,54	1.385	Apollo Hospitals Enterprise Limited	82.544	1,36
1.363	Dlocal Limited	42.607	0,70	1.334	Bajaj Finance Limited	127.810	2,10
885	JD.com Inc. - A	26.444	0,43	4.986	HDFC Bank Limited - ADR	305.791	5,02
10.088	Kingdee International Software Group Company Limited	22.440	0,37	10.177	Hdfc Standard Life Insurance	72.283	1,19
7.900	Meituan Dianping - B	156.963	2,58	11.749	ICICI Bank Limited - ADR	222.526	3,65
3.500	Pagseguro Digital Limited	70.175	1,15	6.698	Infosys Technologies Limited - ADR	166.713	2,74
1.000	Parade Technologies Limited	63.173	1,04	2.849	Reliance Industries Limited	99.062	1,63
511	Sea Limited	61.213	1,00		Total de India	1.076.729	17,69
3.900	Shenzhou International Group Holdings Limited	52.190	0,86				
7.500	Tencent Holdings Limited	358.365	5,88		INDONESIA		
9.500	Wuxi Biologics Cayman Inc.	78.910	1,29	286.200	Bank Central Asia Tbk Pt	158.927	2,61
2.366	Xp Inc. - A	71.217	1,17	781.536	Bank Rakyat Indonesia	253.590	4,16
	Total de Islas Caimán	1.036.566	17,01		Total de Indonesia	412.517	6,77
CHINA				KAZAJISTÁN			
1.138	Bafang Electric Suzhou Company Limited	31.284	0,51	625	Kaspi.Kz Jsc	31.313	0,51
1.343	Beijing Kingsoft Office Software Inc.	39.700	0,65		Total de Kazajistán	31.313	0,51
400	Contemporary Amperex Technology Company Limited - A	32.280	0,53		LUXEMBURGO		
17.000	Country Garden Services Holdings	72.937	1,20	571	Globant SA	149.642	2,46
2.764	JD.com Inc. - ADR	159.953	2,62		Total de Luxemburgo	149.642	2,46
1.600	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited	77.440	1,27		MÉXICO		
5.940	WuXi AppTec Company Limited - H	94.431	1,55	21.245	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	87.272	1,43
	Total de China	508.025	8,33		Total de México	87.272	1,43
CHIPRE				REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
1.129	Ozon Holdings plc**	0	0,00	1.291	Hana Financial Group Inc.	51.766	0,85
545	Tcs Group Holding plc - Reg**	0	0,00	409	Naver Corp.	114.900	1,89
	Total de Chipre	0	0,00	102	Samsung Biologics Company Limited	69.596	1,14
				602	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	81.952	1,34

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Derechos			
REPÚBLICA DE COREA (SUR) (continuación)				REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
7.882	Samsung Electronics Company Limited	452.612	7,43	7	Samsung Biologics Company Limited Right	1.149	0,02
189	Samsung Sdi Company Limited	92.937	1,52				
1.306	SK hynix Inc.	127.147	2,09		Total de República de Corea (Sur)	1.149	0,02
	Total de República de Corea (Sur)	990.910	16,26		Total de derechos	1.149	0,02
SUDÁFRICA				Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
807	Capitec Bank Holdings Limited	129.317	2,12			6.087.459	99,89
	Total de Sudáfrica	129.317	2,12		Valor total de las inversiones	6.087.459	99,89
TAIWÁN				(Coste total: 6.530.850 USD)			
54.000	Cathay Financial Holding Company Limited	121.564	2,00				
7.000	Delta Electronics Inc.	65.599	1,08				
2.000	MediaTek Inc.	63.173	1,04				
4.528	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited - ADR	472.088	7,74				
	Total de Taiwán	722.424	11,86				
TAILANDIA				<i>* Pequeñas diferencias debido al redondeo.</i>			
12.200	Kasikornbank pcl	59.257	0,97				
67.300	Muangthai Capital pcl	106.262	1,74				
	Total de Tailandia	165.519	2,71				
ESTADOS UNIDOS				<i>** Título a su valor razonable.</i>			
126	Mercadolibre Inc.	149.874	2,46				
	Total de Estados Unidos	149.874	2,46				
ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)							
12.165	Fix Price Group Limited**	0	0,00				
	Total de Islas Vírgenes (Británicas)	0	0,00				
Total de renta variable		6.086.310	99,87				

Threadneedle (Lux) - Global Focus

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Renta variable				Renta variable (continuación)				
DINAMARCA				SUIZA				
425.773	Novo Nordisk A/S	47.695.607	1,99	42.525	Lonza Group AG - Reg	31.062.536	1,29	
1.939.887	Tryg A/S	47.660.462	1,98	178.557	Nestle SA - Reg	23.322.518	0,97	
	Total de Dinamarca	95.356.069	3,97	74.475	Sika AG	24.877.599	1,03	
FRANCIA				TAIWÁN				
60.430	L'Oreal SA	24.464.342	1,02	2.560.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	53.341.425	2,22	
71.151	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	51.410.504	2,14		Total de Taiwán	53.341.425	2,22	
105.985	Pernod-Ricard SA	23.502.295	0,98					
172.600	Schneider Electric SE	29.221.322	1,21					
	Total de Francia	128.598.463	5,35					
ALEMANIA				REINO UNIDO				
343.565	Zalando SE	17.584.309	0,73	157.337	Linde plc	50.855.224	2,12	
	Total de Alemania	17.584.309	0,73		Total de Reino Unido	50.855.224	2,12	
HONG KONG				ESTADOS UNIDOS				
2.136.200	AIA Group Limited	22.490.176	0,94	364.414	Abbott Laboratories	43.132.041	1,79	
1.163.000	Techtronic Industries Company	18.845.238	0,78	205.176	Adobe Systems Inc.	93.482.289	3,89	
	Total de Hong Kong	41.335.414	1,72	53.548	Alphabet Inc. - A	148.935.730	6,19	
				43.502	Amazon.com Inc.	141.814.345	5,90	
				240.603	American Electric Power Company Inc.	24.004.961	1,00	
INDIA					68.332	Anthem Inc.	33.566.045	1,40
1.011.023	Kotak Mahindra Bank Limited	23.400.692	0,97	272.414	Apple Inc.	47.566.209	1,98	
	Total de India	23.400.692	0,97	88.534	Cintas Corp.	37.661.479	1,56	
IRLANDA					384.839	Coca Cola Company	23.860.018	0,99
287.507	Trane Technologies plc	43.902.319	1,83	240.712	Conocophillips	24.071.200	1,00	
	Total de Irlanda	43.902.319	1,83	208.205	Doximity Inc.	10.845.398	0,45	
JAPÓN					226.293	Edwards Lifesciences Corp.	26.639.212	1,11
355.300	Hoya Corp.	41.069.904	1,71	165.769	Eli Lilly & Company	47.471.269	1,97	
105.112	Keyence Corp.	49.579.096	2,06	381.000	IntercontinentalExchange Inc.	50.337.720	2,09	
1.321.400	Recruit Holdings Company Limited	58.941.796	2,45	254.555	Intuit Inc.	122.400.227	5,09	
5.239.600	Z Holdings Corp.	23.155.689	0,96	147.493	Lam Research Corp.	79.293.711	3,29	
	Total de Japón	172.746.485	7,18	141.620	Marsh & McLennan Companies Inc.	24.134.880	1,00	
PAÍSES BAJOS					361.431	Mastercard Inc. - A	129.168.210	5,38
42.001	ASML Holding NV	28.506.772	1,19	640.558	Microsoft Corp.	197.490.438	8,20	
	Total de Países Bajos	28.506.772	1,19	88.722	Nvidia Corp.	24.208.685	1,01	
				353.166	Qualcomm Inc.	53.970.828	2,24	
				56.789	S&P Global Inc.	23.293.712	0,97	
				102.519	Stryker Corp.	27.408.455	1,14	
				134.299	Thermo Fisher Scientific Inc.	79.323.705	3,30	
				276.869	T-Mobile USA Inc.	35.536.136	1,48	
				267.401	Transunion	27.633.219	1,15	
				87.620	Union Pacific Corp.	23.938.660	1,00	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

Estado de la cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
ESTADOS UNIDOS (continuación)			
222.686	United Parcel Service Inc.	47.757.240	1,98
	Total de Estados Unidos	1.648.946.022	68,55
	Total de renta variable	2.383.835.847	99,12
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	2.383.835.847	99,12
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
20.515.958	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	20.515.958	0,85
	Total de Irlanda	20.515.958	0,85
	Total de fondos	20.515.958	0,85
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	20.515.958	0,85
	Valor total de las inversiones	2.404.351.805	99,97

(Coste total: 2.122.956.477 USD)

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BRASIL				CHINA (continuación)			
398.107	Azul SA	2.003.961	1,49	212.500	Li Ning Company Limited	1.834.281	1,37
238.963	Hapvida Participacoes e Investimentos SA	595.403	0,44	75.400	Midea Group Company Limited - A	677.020	0,50
353.522	Itau Unibanco Holding SA - ADR	2.018.611	1,51	18.300	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited	885.723	0,66
170.661	Localiza Rent a Car	2.194.340	1,64	5.000	Silergy Corp.	598.569	0,45
133.021	Petro Rio SA	666.512	0,50	78.932	WuXi AppTec Company Limited - H	1.254.824	0,94
	Total de Brasil	7.478.827	5,58	155.100	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	406.067	0,30
CANADÁ				Total de China			
36.401	Parex Resources Inc.	747.516	0,56			13.619.888	10,15
	Total de Canadá	747.516	0,56	CHIPRE			
ISLAS CAIMÁN				31.029	Ozon Holdings plc**	0	0,00
60.276	Afy Limited	868.577	0,65	12.232	Tcs Group Holding plc - Reg**	0	0,00
6.139	Alibaba Group Holding Limited	667.923	0,50	Total de Chipre			
29.367	Dlocal Limited	918.012	0,68			0	0,00
19.807	JD.com Inc. - A	591.827	0,44	HONG KONG			
272.000	Kingdee International Software Group Company Limited	605.031	0,45	196.800	AIA Group Limited	2.071.935	1,54
67.000	Kuaishou Technology	634.803	0,47	21.700	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	1.029.110	0,77
158.100	Meituan Dianping - B	3.141.245	2,34	168.000	Techtronic Industries Company	2.722.270	2,03
20.868	Netease.com - ADR	1.871.651	1,40	Total de Hong Kong			
68.759	Pagseguro Digital Limited	1.378.618	1,03			5.823.315	4,34
18.000	Parade Technologies Limited	1.137.107	0,85	INDIA			
11.438	Sea Limited	1.370.158	1,02	27.285	Apollo Hospitals Enterprise Limited	1.626.158	1,21
108.400	Shenzhou International Group Holdings Limited	1.450.611	1,08	17.054	Bajaj Finance Limited	1.633.936	1,21
156.600	Tencent Holdings Limited	7.482.657	5,59	39.508	Balkrishna Industries Limited	1.113.787	0,83
211.500	Wuxi Biologics Cayman Inc.	1.756.782	1,31	167.898	Cholamandalam Investment and Finance Company Limited	1.591.906	1,19
48.059	Xp Inc. - A	1.446.576	1,08	12.658	Dixon Technologies India Limited	719.774	0,54
	Total de Islas Caimán	25.321.578	18,89	23.437	Eicher Motors Limited	759.992	0,57
CHINA				35.280	HDFC Bank Limited - ADR	2.163.722	1,61
25.350	Bafang Electric Suzhou Company Limited	696.872	0,52	186.525	Hdfc Standard Life Insurance	1.324.817	0,99
24.903	Beijing Kingsoft Office Software Inc.	736.170	0,55	147.776	ICICI Bank Limited - ADR	2.798.877	2,09
33.200	China International Travel Service Corp. Limited - A	859.638	0,64	92.346	Infosys Technologies Limited - ADR	2.298.492	1,71
9.000	Contemporary Amperex Technology Company Limited - A	726.310	0,54	127.159	Reliance Industries Limited	4.421.420	3,29
372.895	Country Garden Services Holdings	1.599.875	1,19	Total de India			
57.794	JD.com Inc. - ADR	3.344.539	2,49			20.452.881	15,24
				INDONESIA			
				6.006.500	Bank Central Asia Tbk Pt	3.335.405	2,49
				13.643.566	Bank Rakyat Indonesia	4.427.008	3,29

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Estado de la cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)			
INDONESIA (continuación)				REPÚBLICA DE COREA (SUR) (continuación)			
4.509.800	Bank Tabungan Pensiunan Nasional Syariah Tbk Pt	1.036.257	0,77	13.337	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	1.815.609	1,35
	Total de Indonesia	8.798.670	6,55	134.960	Samsung Electronics Company Limited	7.749.873	5,78
				2.666	Samsung Sdi Company Limited	1.310.952	0,98
KAZAJISTÁN				29.278	SK hynix Inc.	2.850.386	2,13
6.794	Kaspi.Kz Jsc	340.379	0,25	Total de República de Corea (Sur)			
	Total de Kazajistán	340.379	0,25	18.223.255 13,59			
LUXEMBURGO				SUDÁFRICA			
12.572	Globant SA	3.294.744	2,46	9.555	Capitec Bank Holdings Limited	1.531.131	1,14
	Total de Luxemburgo	3.294.744	2,46	Total de Sudáfrica			
MALASIA				TAIWÁN			
308.000	Public Bank Bhd	342.079	0,26	7.000	Asmedia Technology Inc.	475.191	0,35
	Total de Malasia	342.079	0,26	955.000	Cathay Financial Holding Company Limited	2.149.875	1,61
MÉXICO				40.000	MediaTek Inc.	1.263.452	0,94
476.661	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	1.958.065	1,46	99.949	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited - ADR	10.420.684	7,77
	Total de México	1.958.065	1,46	96.493	Unimicron Technology Corp.	838.582	0,63
PAÍSES BAJOS				TAILANDIA			
33.179	Yandex NV - A**	0	0,00	268.700	Kasikornbank pcl	1.305.106	0,97
	Total de Países Bajos	0	0,00	1.015.300	Muangthai Capital pcl	1.603.095	1,20
FILIPINAS				Total de Tailandia			
2.095.300	Ayala Land Inc.	1.419.307	1,06	2.908.201 2,17			
	Total de Filipinas	1.419.307	1,06	ESTADOS UNIDOS			
POLONIA				53.495	Coupang Inc.	945.792	0,71
11.823	Dino Polska SA	966.039	0,72	2.821	Mercadolibre Inc.	3.355.523	2,50
	Total de Polonia	966.039	0,72	Total de Estados Unidos			
REPÚBLICA DE COREA (SUR)				4.301.315 3,21			
28.501	Hana Financial Group Inc.	1.142.817	0,85	ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)			
6.893	Naver Corp.	1.936.447	1,44	223.974	Fix Price Group Limited**	0	0,00
2.077	Samsung Biologics Company Limited	1.417.171	1,06	Total de Islas Vírgenes (Británicas)			
				0 0,00			
Total de renta variable						132.674.974	98,93

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Estado de la cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Derechos			
REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
137	Samsung Biologics Company Limited Right	22.493	0,02
	Total de República de Corea (Sur)	22.493	0,02
	Total de derechos	22.493	0,02
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	132.697.467	98,95
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente			
Renta variable			
FEDERACIÓN RUSA			
597.602	Detsky Mir PJSC**	0	0,00
	Total de Federación Rusa	0	0,00
	Total de renta variable	0	0,00
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente	0	0,00
	Valor total de las inversiones	132.697.467	98,95
(Coste total: 125.309.026 USD)			

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

** Título a su valor razonable.

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
AUSTRALIA				HONG KONG			
105.874	Carsales.Com Limited	1.663.267	0,77	216.000	AIA Group Limited	2.274.075	1,05
	Total de Australia	1.663.267	0,77		Total de Hong Kong	2.274.075	1,05
CANADÁ				IRLANDA			
31.159	Canadian National Railway Company	4.183.469	1,93	54.213	CRH plc	2.192.635	1,02
157.783	Manulife Financial Corp.	3.367.752	1,57	68.981	Experian plc	2.680.212	1,24
25.269	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	1.491.629	0,69	10.136	Linde plc	3.237.743	1,50
114.787	Suncor Energy Inc.	3.740.305	1,73	42.521	Medtronic Inc.	4.717.705	2,18
	Total de Canadá	12.783.155	5,92		Total de Irlanda	12.828.295	5,94
ISLAS CAIMÁN				JAPÓN			
23.494	Netease.com - ADR	2.107.177	0,98	12.100	Disco Corp.	3.429.373	1,60
	Total de Islas Caimán	2.107.177	0,98	41.900	Rohm Company Limited	3.310.575	1,53
				237.800	Z Holdings Corp.	1.050.924	0,49
					Total de Japón	7.790.872	3,62
CHINA				PAÍSES BAJOS			
417.292	Ping An Insurance Group Company of China Limited	2.965.278	1,37	24.644	Akzo Nobel NV	2.144.804	0,99
	Total de China	2.965.278	1,37	44.613	Philips NV	1.376.480	0,64
					Total de Países Bajos	3.521.284	1,63
DINAMARCA				NORUEGA			
116.179	Tryg A/S	2.854.365	1,32	78.039	Equinor ASA	2.955.911	1,37
	Total de Dinamarca	2.854.365	1,32		Total de Noruega	2.955.911	1,37
FRANCIA				REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
40.592	BNP Paribas	2.345.402	1,09	99.088	Samsung Electronics Company Limited	5.689.978	2,64
66.723	Total SA	3.417.237	1,58		Total de República de Corea (Sur)	5.689.978	2,64
16.410	Vinci SA	1.697.866	0,79				
	Total de Francia	7.460.505	3,46				
ALEMANIA				SINGAPUR			
197.601	Deutsche Telekom AG - Reg	3.722.682	1,73	41.800	DBS Group Holdings Limited	1.106.657	0,51
187.583	E.ON AG	2.200.265	1,02		Total de Singapur	1.106.657	0,51
75.946	Evonik Industries AG	2.127.743	0,99				
4.901	Muenchener Rueckversicherungs AG - Reg	1.325.103	0,61				
14.609	SAP SE	1.643.676	0,76				
31.244	Siemens AG - Reg	4.368.399	2,02				
	Total de Alemania	15.387.868	7,13				
				ESPAÑA			
				121.825	Inditex SA	2.681.151	1,24
					Total de España	2.681.151	1,24
				SUECIA			
				83.562	Sandvik AB	1.802.257	0,83
					Total de Suecia	1.802.257	0,83

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

Estado de la cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)			
SUIZA				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
27.921	Novartis AG - Reg	2.465.179	1,14	22.208	Quest Diagnostics Inc.	3.039.387	1,41
	Total de Suiza	2.465.179	1,14	16.446	Stanley Works	2.298.986	1,06
TAIWÁN				55.764	State Street Corp.	4.858.160	2,25
74.000	MediaTek Inc.	2.337.387	1,08	54.839	Truist Financial Corp.	3.109.371	1,44
187.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	3.896.424	1,80	13.459	United Parcel Service Inc.	2.886.417	1,34
	Total de Taiwán	6.233.811	2,88	39.969	Valero Energy Corp.	4.058.453	1,88
REINO UNIDO				55.231	Xcel Energy Inc.	3.986.022	1,85
128.212	3i Group plc	2.343.931	1,09	Total de Estados Unidos			
92.083	Anglo American plc	4.816.302	2,23	97.657.567	45,24		
1.534.470	BT Group plc	3.681.096	1,70	Total de renta variable			
44.717	Diageo plc	2.274.699	1,05	212.306.235	98,33		
173.567	Glaxosmithkline plc	3.764.297	1,74	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
41.638	Reckitt Benckiser Group plc	3.197.258	1,48	212.306.235	98,33		
	Total de Reino Unido	20.077.583	9,29	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
ESTADOS UNIDOS				Fondos			
37.053	American Electric Power Company Inc.	3.696.778	1,71	IRLANDA			
8.984	American Tower Corp.	2.256.960	1,05	2.254.362	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.254.362	1,04
18.506	Analog Devices Inc.	3.056.821	1,42	Total de Irlanda			
8.464	Anthem Inc.	4.157.686	1,92	2.254.362	1,04		
7.680	Automatic Data Processing Inc.	1.747.507	0,81	Total de fondos			
63.313	Bristol-Myers Squibb Company	4.623.747	2,15	2.254.362	1,04		
60.287	Coca Cola Company	3.737.794	1,74	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
17.962	Crown Castle International Corp.	3.315.786	1,53	2.254.362	1,04		
57.115	Ebay Inc.	3.270.405	1,51	Valor total de las inversiones			
12.096	Eli Lilly & Company	3.463.932	1,60	214.560.597	99,37		
25.066	Fidelity National Information Services Inc.	2.517.128	1,17	(Coste total: 197.267.230 USD)			
93.624	General Motors Company	4.095.114	1,90	<i>* Pequeñas diferencias debido al redondeo.</i>			
4.943	Grainger (WWW) Inc.	2.549.550	1,18				
15.161	IBM Corp.	1.971.233	0,91				
32.445	IntercontinentalExchange Inc.	4.286.634	1,98				
14.260	Marsh & McLennan Companies Inc.	2.430.189	1,13				
13.511	McDonald's Corp.	3.341.000	1,55				
28.494	Microsoft Corp.	8.784.984	4,06				
13.296	NextEra Energy Inc.	1.126.304	0,52				
21.313	PepsiCo Inc.	3.567.370	1,65				
24.813	Procter & Gamble Company	3.791.426	1,76				
10.682	Qualcomm Inc.	1.632.423	0,76				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Select

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
ISLAS CAIMÁN				JAPÓN			
33.190	Sea Limited	3.975.830	0,65	15.700	Keyence Corp.	7.405.357	1,22
	Total de Islas Caimán	3.975.830	0,65	111.700	Recruit Holdings Company Limited	4.982.442	0,82
DINAMARCA				62.100	Sony Corp.	6.513.146	1,07
99.956	Novo Nordisk A/S	11.197.192	1,84	89.800	Yaskawa Electric Corp.	3.562.406	0,58
66.298	Orsted A/S	8.421.449	1,38		Total de Japón	22.463.351	3,69
240.223	Tryg A/S	5.901.962	0,97	PAÍSES BAJOS			
	Total de Dinamarca	25.520.603	4,19	29.548	Airbus SE	3.628.260	0,60
FINLANDIA				32.431	Koninklijke DSM NV	5.863.707	0,96
141.174	Upm-Kymmene Oyj	4.658.911	0,76		Total de Países Bajos	9.491.967	1,56
	Total de Finlandia	4.658.911	0,76	NORUEGA			
FRANCIA				197.661	Equinor ASA	7.486.876	1,23
44.806	Essilor International SA	8.290.620	1,36		Total de Noruega	7.486.876	1,23
73.137	Schneider Electric SE	12.382.154	2,03	REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
	Total de Francia	20.672.774	3,39	270.102	Samsung Electronics Company Limited	15.510.197	2,55
ALEMANIA				12.447	Samsung Sdi Company Limited	6.120.561	1,00
23.547	Adidas AG	5.551.689	0,91		Total de República de Corea (Sur)	21.630.758	3,55
	Total de Alemania	5.551.689	0,91	SUIZA			
HONG KONG				77.359	Nestle SA - Reg	10.104.374	1,66
430.000	AIA Group Limited	4.527.093	0,74	21.640	Roche Holding AG	8.617.198	1,41
	Total de Hong Kong	4.527.093	0,74		Total de Suiza	18.721.572	3,07
INDIA				TAIWÁN			
445.457	HDFC Bank Limited	8.643.741	1,42	822.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	17.127.598	2,81
	Total de India	8.643.741	1,42		Total de Taiwán	17.127.598	2,81
INDONESIA				REINO UNIDO			
26.084.574	Bank Rakyat Indonesia	8.463.813	1,39	148.676	Diageo plc	7.562.966	1,24
	Total de Indonesia	8.463.813	1,39	255.122	SSE PLC	5.873.323	0,96
IRLANDA					Total de Reino Unido	13.436.289	2,20
169.891	CRH plc	6.871.212	1,13	ESTADOS UNIDOS			
100.846	Medtronic Inc.	11.188.863	1,83	49.524	Abbott Laboratories	5.861.661	0,96
49.327	Trane Technologies plc	7.532.233	1,24	25.871	Adobe Systems Inc.	11.787.345	1,94
	Total de Irlanda	25.592.308	4,20	12.016	Alphabet Inc. - A	33.420.702	5,49

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Select

Estado de la cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Renta variable (continuación)				Fondos			
ESTADOS UNIDOS (continuación)				IRLANDA			
9.038	Amazon.com Inc.	29.463.428	4,84	10.502.135	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	10.502.135	1,72
25.098	American Tower Corp.	6.305.120	1,04		Total de Irlanda	10.502.135	1,72
34.886	Autodesk Inc.	7.477.814	1,23				
114.357	Centene Corp.	9.627.716	1,58		Total de fondos	10.502.135	1,72
17.304	Cooper Companies Inc.	7.225.977	1,19				
28.060	Deere & Company	11.657.808	1,91		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	10.502.135	1,72
48.223	Doximity Inc.	2.511.936	0,41				
31.775	Ecolab Inc.	5.610.194	0,92		Valor total de las inversiones	592.254.382	97,22
61.593	Electronic Arts Inc.	7.792.130	1,28				
29.260	Eli Lilly & Company	8.379.186	1,38		(Coste total: 484.642.700 USD)		
8.133	Equinix Inc.	6.031.595	0,99				
35.578	Fidelity National Information Services Inc.	3.572.743	0,59				
143.410	General Motors Company	6.272.753	1,03				
31.155	IntercontinentalExchange Inc.	4.116.199	0,68				
24.175	Intuit Inc.	11.624.307	1,91				
83.189	JPMorgan Chase & Company	11.340.324	1,86				
17.312	Lam Research Corp.	9.307.104	1,53				
48.428	Mastercard Inc. - A	17.307.199	2,84				
4.502	Mercadolibre Inc.	5.355.039	0,88				
122.738	Microsoft Corp.	37.841.354	6,20				
72.335	NextEra Energy Inc.	6.127.498	1,01				
42.721	Nvidia Corp.	11.656.852	1,91				
47.891	Paypal Holdings Inc.	5.538.594	0,91				
67.888	Qualcomm Inc.	10.374.644	1,70				
10.686	S&P Global Inc.	4.383.183	0,72				
31.893	Stryker Corp.	8.526.594	1,40				
16.560	Thermo Fisher Scientific Inc.	9.781.164	1,61				
107.208	T-Mobile USA Inc.	13.760.147	2,26				
51.769	Transunion	5.349.808	0,88				
63.445	Trimble Navigation Limited	4.576.922	0,75				
159.240	Uber Technologies Inc.	5.681.683	0,93				
30.538	Union Pacific Corp.	8.343.287	1,37				
71.428	Walt Disney Company	9.797.064	1,61				
	Total de Estados Unidos	363.787.074	59,74				
	Total de renta variable	581.752.247	95,50				
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	581.752.247	95,50				

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Renta variable				Renta variable (continuación)				
BÉLGICA				ITALIA (continuación)				
2.076	Lotus Bakeries NV	9.861.000	0,52	2.032.176	Stevanato Group SpA	36.747.747	1,94	
	Total de Bélgica	9.861.000	0,52		Total de Italia	48.816.768	2,58	
CANADÁ				JAPÓN				
312.250	Cargojet Inc.	42.707.114	2,26	1.322.700	Capcom Company Limited	29.069.495	1,54	
393.541	Dye & Durham Limited	7.274.706	0,38	106.095	Disco Corp.	27.024.994	1,43	
755.173	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	40.064.587	2,11	623.909	Giken Limited	17.162.965	0,91	
	Total de Canadá	90.046.407	4,75	316.735	Jtower Inc.	16.980.359	0,90	
				1.953.700	Mani Inc.	21.237.147	1,12	
ISLAS CAIMÁN					491.262	Menicon Company Limited	10.683.889	0,56
2.534.414	Diversey Holdings Limited	17.243.081	0,91	517.020	Shoei Company Limited	17.553.306	0,93	
	Total de Islas Caimán	17.243.081	0,91	882.400	SMS Company Limited	22.182.859	1,17	
DINAMARCA					752.010	Square Enix Holdings Company Limited	30.236.790	1,60
544.080	Alk-Abello A/S	10.930.688	0,58		Total de Japón	192.131.804	10,16	
152.619	Simcorp A/S	10.197.245	0,54	ESPAÑA				
	Total de Dinamarca	21.127.933	1,12	675.900	Fluidra SA	17.776.170	0,94	
FINLANDIA					Total de España	17.776.170	0,94	
318.336	Musti Group Oyj	7.627.331	0,40	SUECIA				
208.441	Revenio Group Oyj	9.967.649	0,53	674.903	Avanza Bank Holding AB	15.751.068	0,83	
	Total de Finlandia	17.594.980	0,93	2.077.540	Fortnox AB	10.408.502	0,55	
FRANCIA					781.923	Hemnet Group AB	10.715.473	0,57
335.964	Lectra	14.480.048	0,77	111.886	MIPS AB	9.495.366	0,50	
	Total de Francia	14.480.048	0,77	383.108	Thule Group AB	13.854.976	0,73	
ALEMANIA					Total de Suecia	60.225.385	3,18	
246.607	CompuGroup Medical SE & Company KgaA	13.662.028	0,72	SUIZA				
181.130	CTS Eventim AG	11.233.683	0,59	58.041	Belimo Holding AG	27.917.507	1,47	
35.692	Hypoport AG	12.292.325	0,65	17.159	Inficon Holding AG	17.830.729	0,94	
103.712	Stratec Biomedical AG	10.495.654	0,55	1.992	LEM Holding SA	4.357.856	0,23	
	Total de Alemania	47.683.690	2,51	1.778.354	SIG Combibloc Group AG	40.641.486	2,15	
ISLANDIA					53.653	Tecan Group AG - Reg	19.283.121	1,02
1.664.113	Marel HF	8.819.799	0,47		Total de Suiza	110.030.699	5,81	
	Total de Islandia	8.819.799	0,47	REINO UNIDO				
ITALIA				2.005.963	Abcam plc	32.876.416	1,74	
85.053	Diasorin SpA	12.069.021	0,64	1.071.359	Auction Technology Group plc	12.449.682	0,65	
				5.204.611	Dr. Martens plc	14.707.348	0,78	
				365.852	Future plc	11.264.826	0,60	
				290.029	Games Workshop Group plc	24.933.820	1,32	
				430.307	Genus plc	14.369.683	0,76	
				325.026	Keywords Studios plc	10.076.998	0,53	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

Estado de la cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)			
REINO UNIDO (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
405.354	Renishaw plc	18.563.386	0,98	428.203	Triumph Bancorp Inc.	36.183.567	1,91
1.380.472	Watches of Switzerland Group plc	18.622.768	0,98	702.658	Verra Mobility Corp.	10.281.106	0,54
	Total de Reino Unido	157.864.927	8,34	251.615	Visteon Corp.	24.678.690	1,30
				113.817	WD-40 Company	18.743.261	0,99
				1.275.232	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	44.847.731	2,37
				352.885	Workiva Inc.	37.424.555	1,98
				268.327	XPEL Inc.	12.687.443	0,67
				498.781	Yeti Holdings Inc.	26.887.956	1,43
					Total de Estados Unidos	1.025.345.332	54,17
					Total de renta variable	1.839.048.023	97,16
					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	1.839.048.023	97,16
					Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		
					Fondos		
					IRLANDA		
				42.329.206	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	38.043.595	2,01
					Total de Irlanda	38.043.595	2,01
					Total de fondos	38.043.595	2,01
					Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	38.043.595	2,01
					Valor total de las inversiones	1.877.091.618	99,17
					(Coste total: 1.879.484.054 EUR)		

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - American

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
CANADÁ				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
3.512	Shopify Inc. - A	2.373.972	0,19	206.404	Microsoft Corp.	63.636.416	5,13
	Total de Canadá	2.373.972	0,19	113.809	Mirati Therapeutics Inc.	9.357.376	0,75
				239.602	Northern Trust Corp.	27.901.653	2,25
				891.961	Nov Inc.	17.491.355	1,41
				43.831	Nvidia Corp.	11.959.727	0,96
				122.988	Qualcomm Inc.	18.795.026	1,51
				91.578	Republic Services Inc.	12.134.085	0,98
				93.392	Salesforce.com Inc.	19.828.989	1,60
				5.205	Servicenow Inc.	2.898.612	0,23
				349.536	State Street Corp.	30.451.576	2,45
				21.736	Svb Financial Group	12.160.205	0,98
				264.916	Take-Two Interactive Software Inc.	40.728.186	3,28
				180.488	Target Corp.	38.303.164	3,09
				166.663	Teradata Corp.	8.214.819	0,66
				27.609	Teradyne Inc.	3.264.212	0,26
				211.828	Tjx Companies Inc.	12.832.540	1,03
				83.052	Transunion	8.582.594	0,69
				45.459	Trimble Navigation Limited	3.279.412	0,26
				68.700	Union Pacific Corp.	18.769.527	1,51
				179.364	United Parcel Service Inc.	38.466.403	3,10
				155.949	Vertex Pharmaceuticals Inc.	40.698.011	3,28
				493.708	Virtu Financial Inc.	18.375.812	1,48
				419.223	Voya Financial Inc.	27.815.446	2,24
				12.292	Zebra Technologies Corp.	5.085.200	0,41
					Total de Estados Unidos	1.152.544.062	92,85
					Total de renta variable	1.199.288.793	96,61
					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	1.199.288.793	96,61
					Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		
					Fondos		
					IRLANDA		
				34.016.617	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	34.016.617	2,74
					Total de Irlanda	34.016.617	2,74
					Total de fondos	34.016.617	2,74
					Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	34.016.617	2,74
					Valor total de las inversiones	1.233.305.410	99,35
					(Coste total: 1.025.881.727 USD)		

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Select

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
CANADÁ				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
3.578	Shopify Inc. - A	2.418.585	0,58	102.475	United Parcel Service Inc.	21.976.788	5,31
	Total de Canadá	2.418.585	0,58	66.455	Vertex Pharmaceuticals Inc.	17.342.761	4,19
ISLAS CAIMÁN				Total de Estados Unidos			
84.752	Globalfoundries Inc.	5.290.220	1,28	398.297.568			
	Total de Islas Caimán	5.290.220	1,28	96,28			
ESTADOS UNIDOS				Total de renta variable			
35.287	Adobe Systems Inc.	16.077.463	3,89	406.006.373			
49.336	Agco Corp.	7.204.536	1,74	98,14			
9.070	Alphabet Inc. - A	25.226.845	6,10	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
79.432	American Electric Power Company Inc.	7.924.931	1,92	406.006.373			
9.593	Block Inc.	1.300.811	0,31	98,14			
359.939	Cisco Systems Inc.	20.070.199	4,85	Valor total de las inversiones			
312.934	Coca Cola Company	19.401.908	4,69	406.006.373			
45.356	Crowdstrike Holdings Inc. - A	10.299.440	2,49	98,14			
207.466	CVS Health Corp.	20.997.634	5,07	(Coste total: 381.355.682 USD)			
39.774	Darling International Inc.	3.197.034	0,77	<i>* Pequeñas diferencias debido al redondeo.</i>			
33.905	Doordash Inc. - A	3.973.327	0,96				
64.132	Doximity Inc.	3.340.636	0,81				
149.216	Electronic Arts Inc.	18.877.316	4,56				
53.261	Exact Sciences Corp.	3.724.009	0,90				
151.604	General Motors Company	6.631.159	1,60				
116.083	Hilton Worldwide Holdings Inc.	17.614.434	4,26				
185.602	Konotoor Brands Inc.	7.674.643	1,86				
31.384	Lam Research Corp.	16.872.352	4,08				
66.701	Lamb Weston Holding Inc.	3.996.057	0,97				
222.564	Livent Corp.	5.802.243	1,40				
20.941	Mastercard Inc. - A	7.483.894	1,81				
63.149	Microsoft Corp.	19.469.469	4,71				
40.561	Mirati Therapeutics Inc.	3.334.925	0,81				
112.303	Ncino Inc.	4.602.177	1,11				
87.521	Northern Trust Corp.	10.191.820	2,46				
439.259	Nov Inc.	8.613.869	2,08				
73.160	Salesforce.com Inc.	15.533.331	3,75				
97.693	Schnitzer Steel Industries Inc.	5.074.174	1,23				
43.396	Starbucks Corp.	3.947.734	0,95				
237.506	State Street Corp.	20.691.523	5,01				
78.417	Target Corp.	16.641.656	4,03				
101.855	Teradata Corp.	5.020.433	1,21				
70.899	Transunion	7.326.703	1,77				
39.674	Union Pacific Corp.	10.839.334	2,62				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BAHAMAS				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
233.174	OneSpaWorld Holdings Limited	2.378.375	0,71	39.950	Icf International Inc.	3.760.893	1,12
	Total de Bahamas	2.378.375	0,71	62.352	Insmed Inc.	1.465.272	0,44
BERMUDAS				197.164	Kontoor Brands Inc.	8.152.732	2,43
124.891	Axalta Coating System Limited	3.069.821	0,91	114.508	Lamb Weston Holding Inc.	6.860.174	2,04
141.735	Essent Group Limited	5.840.899	1,74	304.439	Livent Corp.	7.936.725	2,36
	Total de Bermudas	8.910.720	2,65	86.563	Madison Square Garden Entertainment Corp.	7.211.564	2,14
CANADÁ				224.212	Matthews International Corp. - A	7.255.500	2,15
90.057	Gildan Activewear Inc.	3.375.336	1,00	19.885	Medpace Holdings Inc.	3.252.987	0,97
60.996	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	3.600.594	1,07	42.565	Mirati Therapeutics Inc.	3.499.694	1,04
	Total de Canadá	6.975.930	2,07	156.646	Moelis & Company - A	7.354.530	2,18
IRLANDA				25.282	MSA Safety Inc.	3.354.921	1,00
64.037	Trinseo plc	3.068.653	0,91	261.206	Natus Medical Inc.	6.864.494	2,04
	Total de Irlanda	3.068.653	0,91	129.900	Ncino Inc.	5.323.302	1,58
ESTADOS UNIDOS				3.097.235	Newpark Resources	11.335.880	3,37
83.510	Acadia Pharmaceuticals Inc.	2.022.612	0,60	205.987	Nov Inc.	4.039.405	1,20
35.232	Acushnet Holdings Corp.	1.418.440	0,42	79.447	Patterson Companies Inc.	2.571.699	0,76
92.015	Aerie Pharmaceuticals Inc.	837.337	0,25	18.812	Qualys Inc.	2.679.017	0,80
62.262	Agco Corp.	9.092.120	2,71	202.301	Quanex Building Products Corp.	4.246.298	1,26
148.938	Allogene Therapeutics Inc.	1.356.825	0,40	39.672	Quanterix Corp.	1.158.026	0,34
48.946	Aspen Technology Inc.	8.094.200	2,41	130.484	Ranpak Holdings Corp.	2.665.788	0,79
369.133	Avaya Holdings Corp.	4.676.915	1,39	770.188	Regis Corp.	1.632.799	0,49
258.338	Avista Corp.	11.663.961	3,47	105.854	Revolution Medicines Inc.	2.700.336	0,81
119.339	Axos Financial Inc.	5.536.136	1,65	56.364	Sage Therapeutics Inc.	1.865.648	0,55
120.431	Bloom Energy Corp.	2.908.409	0,86	184.001	Schnitzer Steel Industries Inc.	9.557.012	2,84
36.512	Bright Horizons Family Solutions Inc.	4.844.777	1,44	210.226	Teradata Corp.	10.362.040	3,08
268.775	Carriage Services Inc.	14.333.771	4,27	7.880	Teradyne Inc.	931.652	0,28
39.971	Cirrus Logic Inc.	3.389.141	1,00	40.966	Toast Inc.	890.191	0,26
86.067	Conmed Corp.	12.785.253	3,81	195.773	Utz Brands Inc.	2.893.525	0,86
48.002	Darling International Inc.	3.858.401	1,15	403.266	Virtu Financial Inc.	15.009.560	4,47
31.754	Doximity Inc.	1.654.066	0,49	131.196	Voya Financial Inc.	8.704.855	2,58
354.892	Empire State Realty Trust Inc. - A	3.485.039	1,04	135.793	Wendy's Company	2.983.373	0,88
112.688	Endeavor Group Holdings Inc.	3.326.550	0,99	321.617	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	12.584.873	3,74
70.014	Envestnet Inc.	5.211.842	1,55	41.855	Wingstop Inc.	4.911.684	1,46
279.617	Evo Payments Inc.	6.456.357	1,92	209.733	Xponential Fitness Inc.	4.916.141	1,46
38.461	Fti Consulting Inc.	6.046.838	1,80	26.323	Zendesk Inc.	3.166.394	0,94
109.793	Gap Inc.	1.545.885	0,46		Total de Estados Unidos	309.663.708	92,06
15.158	Herc Holdings Inc.	2.532.750	0,75		Total de renta variable	330.997.386	98,40
96.664	Houlihan Lokey Inc.	8.487.099	2,52		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	330.997.386	98,40

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

Estado de la cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
3.515.198	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	3.515.198	1,05
	Total de Irlanda	3.515.198	1,05
	Total de fondos	3.515.198	1,05
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	3.515.198	1,05
	Valor total de las inversiones	334.512.584	99,45
	(Coste total: 291.630.422 USD)		

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

Estado de la cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
TAIWÁN			
491.000	Powertech Technology Inc.	1.628.004	1,70
422.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	8.793.001	9,20
118.000	Yageo Corp.	1.787.401	1,87
	Total de Taiwán	12.208.406	12,77
TAILANDIA			
2.421.500	Thai Beverage plc	1.279.323	1,34
	Total de Tailandia	1.279.323	1,34
	Total de renta variable	95.301.911	99,67
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	95.301.911	99,67
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
18.113	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	18.113	0,02
	Total de Irlanda	18.113	0,02
	Total de fondos	18.113	0,02
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	18.113	0,02
	Valor total de las inversiones	95.320.024	99,69
	(Coste total: 84.527.799 USD)		

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Asia Equities

Estado de la cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
SINGAPUR			
1.773.000	Digital Core REIT Management Pte Limited	1.968.030	1,38
672.600	Keppel Corp. Limited	3.190.668	2,24
149.100	United Overseas Bank Limited	3.527.677	2,48
	Total de Singapur	8.686.375	6,10
TAIWÁN			
13.000	Asmedia Technology Inc.	882.497	0,62
262.000	Chailease Holding Company Limited	2.318.086	1,63
291.000	Chroma ATE Inc.	1.828.167	1,28
30.000	MediaTek Inc.	947.589	0,67
586.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	12.210.184	8,57
	Total de Taiwán	18.186.523	12,77
	Total de renta variable	144.366.618	101,39
Derechos			
REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
155	Samsung Biologics Company Limited Right	25.449	0,02
	Total de República de Corea (Sur)	25.449	0,02
	Total de derechos	25.449	0,02
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	144.392.067	101,41
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
8.554	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	8.554	0,01
	Total de Irlanda	8.554	0,01
	Total de fondos	8.554	0,01
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	8.554	0,01
	Valor total de las inversiones	144.400.621	101,42
(Coste total: 126.422.983 USD)			

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
CANADÁ				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
59.462	Canadian Natural Resources Limited	3.685.455	0,97	48.687	Endeavor Group Holdings Inc.	1.437.240	0,38
				33.443	EOG Resources Inc.	3.987.409	1,05
	Total de Canadá	3.685.455	0,97	9.602	Fidelity National Information Services Inc.	964.233	0,25
ISLAS CAIMÁN				18.144	Global Payments Inc.	2.482.825	0,65
14.162	Globalfoundries Inc.	883.992	0,23	23.746	Honeywell International Inc.	4.620.497	1,22
	Total de Islas Caimán	883.992	0,23	17.594	IBM Corp.	2.287.572	0,60
IRLANDA				27.702	International Flavors & Fragrances Inc.	3.638.104	0,95
2.837	Aon plc	923.812	0,24	11.151	Intuit Inc.	5.361.846	1,42
56.435	Medtronic Inc.	6.261.463	1,65	60.297	Johnson & Johnson	10.686.437	2,82
12.244	Willis Towers Watson plc	2.892.278	0,76	31.070	JPMorgan Chase & Company	4.235.462	1,12
	Total de Irlanda	10.077.553	2,65	7.715	Lam Research Corp.	4.147.661	1,09
SUIZA				8.977	Lowe's Companies Inc.	1.815.060	0,48
41.266	TE Connectivity Limited	5.405.020	1,42	24.809	Marvell Technology Inc.	1.779.053	0,47
	Total de Suiza	5.405.020	1,42	17.355	Mastercard Inc. - A	6.202.330	1,64
ESTADOS UNIDOS				7.934	McDonald's Corp.	1.961.920	0,52
26.607	Abbott Laboratories	3.149.205	0,83	24.115	Meta Platforms Inc.	5.362.211	1,41
10.945	Adobe Systems Inc.	4.986.761	1,32	24.648	Micron Technology Inc.	1.919.833	0,51
19.369	Akamai Technologies Inc.	2.312.465	0,61	83.783	Microsoft Corp.	25.831.136	6,82
3.640	Alphabet Inc. - A	10.124.114	2,67	58.826	Mondelez International Inc.	3.693.096	0,97
3.861	Alphabet Inc. - C	10.783.734	2,84	21.634	Monster Beverage Corp.	1.728.557	0,46
5.626	Amazon.com Inc.	18.340.479	4,85	4.482	MSCI Inc. - A	2.253.908	0,59
52.741	American Electric Power Company Inc.	5.261.970	1,38	5.551	NetFlix Inc.	2.079.349	0,55
7.103	American Express Company	1.328.261	0,35	16.059	Newmont Mining Corp.	1.275.888	0,34
17.456	American Tower Corp.	4.385.296	1,16	18.892	Nutrien Limited	1.964.579	0,52
9.391	Anthem Inc.	4.613.047	1,22	18.758	Nvidia Corp.	5.118.308	1,35
142.637	Apple Inc.	24.905.846	6,57	10.441	Palo Alto Networks Inc.	6.499.627	1,71
166.692	Bank of America Corp.	6.871.045	1,81	25.379	Paypal Holdings Inc.	2.935.081	0,77
22.735	Baxter International Inc.	1.762.872	0,47	59.881	Public Service Enterprise Group Inc.	4.191.670	1,11
30.458	Berkshire Hathaway Inc.	10.748.933	2,84	122.032	Raytheon Technologies Corp.	12.089.710	3,19
19.307	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	1.488.570	0,39	9.649	Salesforce.com Inc.	2.048.676	0,54
4.690	BlackRock Inc.	3.583.957	0,95	33.815	Snap Inc. - A	1.217.002	0,32
23.258	Carrier Global Corp.	1.066.844	0,28	106.931	Southwest Airlines Company	4.897.440	1,30
46.688	Chevron Corp.	7.602.207	2,01	64.295	State Street Corp.	5.601.380	1,48
775	Chipotle Mexican Grill Inc.	1.226.073	0,32	83.082	Sysco Corp.	6.783.646	1,79
80.145	Comcast Corp.	3.752.389	0,99	30.828	Take-Two Interactive Software Inc.	4.739.497	1,25
65.548	Corteva Inc.	3.767.699	0,99	85.926	Tapestry Inc.	3.192.151	0,84
51.989	CVS Health Corp.	5.261.807	1,39	3.320	Tesla Motors Inc.	3.577.632	0,94
72.069	Ebay Inc.	4.126.671	1,09	41.134	T-Mobile USA Inc.	5.279.549	1,39
12.166	Ecolab Inc.	2.148.029	0,57	144.006	Uber Technologies Inc.	5.138.134	1,36
21.921	Eli Lilly & Company	6.277.517	1,66	88.627	Under Armour Inc.	1.508.432	0,40
				16.139	Union Pacific Corp.	4.409.336	1,16
				17.364	Vertex Pharmaceuticals Inc.	4.531.483	1,20
				16.182	Visa Inc. - A	3.588.683	0,95
				47.278	Walmart Inc.	7.040.639	1,85

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

Estado de la cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
ESTADOS UNIDOS (continuación)			
24.120	Walt Disney Company	3.308.299	0,87
26.039	Zillow Group - C	1.283.462	0,34
	Total de Estados Unidos	350.571.834	92,50
	Total de renta variable	370.623.854	97,77
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	370.623.854	97,77
	Valor total de las inversiones	370.623.854	97,77

(Coste total: 260.214.404 USD)

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
IRLANDA				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
2.308	Accenture plc	778.327	0,99	7.457	Metlife Inc.	524.078	0,67
591	Aon plc	192.447	0,24	16.269	Microsoft Corp.	5.015.896	6,38
	Total de Irlanda	970.774	1,23	790	Molina Healthcare Inc.	263.536	0,34
				8.227	Morgan Stanley	719.040	0,91
				2.153	Norfolk Southern Corp.	614.079	0,78
				19.418	NRG Energy Inc.	744.874	0,94
				5.721	Nucor Corp.	850.427	1,08
				1.623	O'Reilly Automotive Inc.	1.111.690	1,41
				5.521	Otis Worldwide Corp.	424.841	0,54
				37.752	Pfizer Inc.	1.954.421	2,47
				6.391	Philip Morris International Inc.	600.371	0,76
				9.359	Procter & Gamble Company	1.430.055	1,82
				2.017	Public Storage Inc.	787.195	1,00
				15.170	Pulte Homes Inc.	635.623	0,81
				9.113	Qualcomm Inc.	1.392.648	1,77
				975	Ralph Lauren Corp.	110.604	0,14
				426	Regeneron Pharmaceuticals Inc.	297.527	0,38
				999	Republic Services Inc.	132.368	0,17
				2.580	Robert Half International Inc.	294.584	0,37
				272	S&P Global Inc.	111.569	0,14
				1.644	Simon Property Group Inc.	216.285	0,27
				3.987	Snap-On Inc.	819.249	1,04
				1.753	Southwest Airlines Company	80.287	0,11
				2.139	Starbucks Corp.	194.585	0,25
				1.855	T Rowe Price Group Inc.	280.457	0,36
				9.933	Tapestry Inc.	369.011	0,47
				1.058	Target Corp.	224.529	0,29
				597	Tesla Motors Inc.	643.327	0,82
				13.934	Textron Inc.	1.036.411	1,32
				12.782	Tyson Foods Inc. - A	1.145.651	1,46
				53.844	Under Armour Inc.	916.425	1,17
				5.517	United Parcel Service Inc.	1.183.176	1,50
				2.521	VeriSign Inc.	560.822	0,71
				1.752	Vertex Pharmaceuticals Inc.	457.218	0,58
				3.058	Voya Financial Inc.	202.898	0,26
				28.702	Wells Fargo & Company	1.390.899	1,76
				36.993	Weyerhaeuser Company	1.402.034	1,79
					Total de Estados Unidos	77.107.363	98,02
					Total de renta variable	78.078.137	99,25
					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	78.078.137	99,25
					Valor total de las inversiones	78.078.137	99,25
					(Coste total: 71.570.889 USD)		

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BÉLGICA				ITALIA (continuación)			
87.604	KBC Group NV	5.727.550	1,21	365.112	UniCredit SpA	3.598.179	0,76
	Total de Bélgica	5.727.550	1,21		Total de Italia	13.497.429	2,84
DINAMARCA				PAÍSES BAJOS			
25.757	DSV A/S	4.503.223	0,95	17.130	ASM International NV	5.688.873	1,20
169.825	Novo Nordisk A/S	17.097.921	3,60	24.395	ASML Holding NV	14.880.950	3,13
250.929	Tryg A/S	5.540.821	1,17	604.145	ING Groep NV	5.746.023	1,21
	Total de Dinamarca	27.141.965	5,72	130.344	STMicronics NV	5.162.926	1,09
					Total de Países Bajos	31.478.772	6,63
FRANCIA				NORUEGA			
293.814	AXA SA	7.805.169	1,64	577.225	DNB Bank ASA	11.871.975	2,49
179.795	BNP Paribas	9.336.754	1,97	278.052	Equinor ASA	9.465.578	1,99
105.293	Compagnie de Saint-Gobain	5.714.251	1,20		Total de Noruega	21.337.553	4,48
107.511	Dassault Systemes SE	4.807.354	1,01				
7.964	Kering	4.584.875	0,97				
35.215	L'Oreal SA	12.812.978	2,70				
26.156	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	16.985.707	3,58				
144.728	Publicis Groupe SA	7.997.669	1,68				
49.396	Schneider Electric SE	7.516.095	1,58				
31.804	Teleperformance	11.013.725	2,32				
305.244	Total SA	14.050.381	2,96				
	Total de Francia	102.624.958	21,61				
ALEMANIA				SUECIA			
44.282	Allianz SE - Reg	9.589.267	2,02	130.193	Atlas Copco AB - A	6.173.638	1,30
104.244	Brenntag AG	7.645.255	1,61	458.939	Sandvik AB	8.896.195	1,88
148.459	Daimler Truck Holding AG	3.745.621	0,79		Total de Suecia	15.069.833	3,18
250.704	Infineon Technologies AG	7.768.063	1,64				
172.834	Mercedes-Benz Group AG - Reg	11.028.537	2,32				
94.669	Puma AG Rudolf Dassler Sport	7.331.167	1,54				
27.748	Volkswagen AG Pfd	4.356.436	0,92				
	Total de Alemania	51.464.346	10,84				
IRLANDA				SUIZA			
33.506	CRH plc	1.217.943	0,26	63.023	Compagnie Financiere RicheMont SA - Reg	7.263.009	1,53
224.304	CRH plc	8.153.987	1,72	9.499	Lonza Group AG - Reg	6.236.083	1,31
104.512	Kingspan Group plc	9.305.748	1,96	141.581	Nestle SA - Reg	16.620.533	3,50
	Total de Irlanda	18.677.678	3,94	3.094	Partners Group Holding AG - Reg	3.485.567	0,73
				54.878	Roche Holding AG	19.640.319	4,15
				212.300	SIG Combibloc Group AG	4.851.783	1,02
				57.164	Sika AG	17.161.766	3,61
				465.210	UBS Group AG	8.244.067	1,74
					Total de Suiza	83.503.127	17,59
ITALIA				REINO UNIDO			
918.393	Enel SpA	5.572.809	1,17	659.214	3i Group plc	10.831.387	2,28
412.042	Nexi SpA	4.326.441	0,91	215.369	Ashtead Group plc	12.317.194	2,60
				149.789	Astrazeneca plc	17.959.195	3,78
				4.365.231	JD Sports Fashion plc	7.657.971	1,61
				34.723	Linde plc	10.087.032	2,13
				148.439	Persimmon plc	3.778.333	0,80
				1.216.560	Rentokil Initial plc	7.572.356	1,59
				140.125	Rio Tinto plc	10.083.293	2,12
				516.854	St James's Place plc	8.859.274	1,87

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

Estado de la cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
REINO UNIDO (continuación)			
7.114.680	Vodafone Group plc	10.510.440	2,21
	Total de Reino Unido	99.656.475	20,99
	Total de renta variable	470.179.686	99,03
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	470.179.686	99,03
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
192	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	18.907	0,00
	Total de Irlanda	18.907	0,00
	Total de fondos	18.907	0,00
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	18.907	0,00
	Valor total de las inversiones	470.198.593	99,03
	(Coste total: 397.182.654 EUR)		

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BÉLGICA				ITALIA			
20.034	KBC Group NV	1.309.823	2,15	196.891	Enel SpA	1.194.735	1,96
17.360	Melexis NV	1.458.240	2,39	64.811	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	658.804	1,08
	Total de Bélgica	2.768.063	4,54	95.362	Nexi SpA	1.001.301	1,64
DINAMARCA				Total de Italia			
77.867	Tryg A/S	1.719.399	2,82			2.854.840	4,68
	Total de Dinamarca	1.719.399	2,82	JERSEY - ISLAS DEL CANAL			
FINLANDIA				158.000 WPP plc			
50.679	Upm-Kymmene Oyj	1.503.139	2,47			1.875.296	3,08
	Total de Finlandia	1.503.139	2,47	Total de Jersey - Islas del Canal			
FRANCIA				PAÍSES BAJOS			
5.429	Air Liquide SA	862.777	1,42	5.588	ASM International NV	1.855.775	3,05
80.387	AXA SA	2.135.480	3,51	112.143	ING Groep NV	1.066.592	1,75
13.122	BNP Paribas	681.425	1,12	5.738	Koninklijke DSM NV	932.425	1,53
21.807	Compagnie de Saint-Gobain	1.183.466	1,94		Total de Países Bajos	3.854.792	6,33
18.553	Edenred	833.401	1,37	ESPAÑA			
2.447	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	1.589.082	2,61	134.612	Iberdrola SA	1.335.351	2,19
23.457	Nexity SA	748.278	1,23	68.628	Inditex SA	1.357.462	2,23
6.785	Pernod-Ricard SA	1.352.251	2,22		Total de España	2.692.813	4,42
11.494	Schneider Electric SE	1.748.927	2,87	SUECIA			
32.484	Total SA	1.495.239	2,45	14.276	Atlas Copco AB	591.321	0,97
12.515	Vinci SA	1.163.770	1,91	50.008	Sandvik AB	969.368	1,59
	Total de Francia	13.794.096	22,65	56.429	Volvo AB - B	961.051	1,58
ALEMANIA				Total de Suecia			
15.629	Brenntag AG	1.146.231	1,88			2.521.740	4,14
25.814	Daimler Truck Holding AG	651.287	1,07	SUIZA			
21.353	Mercedes-Benz Group AG - Reg	1.362.535	2,23	10.307	Nestle SA - Reg	1.209.963	1,99
8.973	SAP SE	907.350	1,49	950	Partners Group Holding AG - Reg	1.070.229	1,76
14.526	Siemens AG - Reg	1.825.337	3,00		Total de Suiza	2.280.192	3,75
12.122	Siemens Healthineers AG	681.741	1,12	REINO UNIDO			
3.998	Volkswagen AG Pfd	627.686	1,03	133.982	3i Group plc	2.201.426	3,61
23.242	Vonovia SE	983.369	1,61	20.110	Anglo American plc	945.339	1,55
	Total de Alemania	8.185.536	13,43	18.841	Astrazeneca plc	2.258.972	3,70
IRLANDA				54.272	Glaxosmithkline plc	1.057.874	1,74
35.318	CRH plc	1.283.810	2,11	576.001	lbstock plc	1.195.541	1,96
11.166	Medtronic Inc.	1.113.439	1,83	14.229	London Stock Exchange Group plc	1.341.302	2,20
	Total de Irlanda	2.397.249	3,94	43.121	Persimmon plc	1.097.592	1,80
				91.077	St James's Place plc	1.561.129	2,56

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

Estado de la cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
REINO UNIDO (continuación)			
1.409.412	Vodafone Group plc	2.082.109	3,42
	Total de Reino Unido	13.741.284	22,54
	Total de renta variable	60.188.439	98,79
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	60.188.439	98,79
	Valor total de las inversiones	60.188.439	98,79
	(Coste total: 56.683.327 EUR)		

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BÉLGICA				IRLANDA			
185.649	Azelis Group NV	4.084.278	0,61	928.773	Dalata Hotel Group Limited	3.677.941	0,55
409.474	Fagron	6.764.510	1,01	1.114.891	Irish Continental Group plc	4.320.203	0,64
693	Lotus Bakeries NV	3.291.750	0,49				
152.203	Melexis NV	12.785.052	1,89		Total de Irlanda	7.998.144	1,19
	Total de Bélgica	26.925.590	4,00				
DINAMARCA				ISLA DE MAN			
178.480	Alk-Abello A/S	3.585.703	0,53	2.882.622	Strix Group plc	6.890.502	1,02
109.012	Simcorp A/S	7.283.641	1,08		Total de Isla de Man	6.890.502	1,02
	Total de Dinamarca	10.869.344	1,61				
FINLANDIA				ITALIA			
236.661	Huhtamaki Oyj	7.473.754	1,11	583.139	Carel Industries SpA	13.557.982	2,01
150.061	Musti Group Oyj	3.595.462	0,53	28.409	Diasorin SpA	4.031.237	0,60
100.721	Revenio Group Oyj	4.816.478	0,72	365.276	GVS SpA	3.009.874	0,45
195.503	Vaisala Oyj	8.435.954	1,25	410.948	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	4.177.286	0,62
	Total de Finlandia	24.321.648	3,61	324.247	Marr SpA	4.866.947	0,72
				410.014	Technoprobe SpA	2.730.693	0,41
					Total de Italia	32.374.019	4,81
FRANCIA				JERSEY - ISLAS DEL CANAL			
361.953	Elis SA	4.850.170	0,72	1.421.429	JTC plc	14.179.619	2,10
130.113	Korian-Medica	2.724.566	0,40		Total de Jersey - Islas del Canal	14.179.619	2,10
358.365	Lectra	15.445.533	2,30				
32.966	Remy Cointreau	6.164.642	0,92				
415.560	Verallia SA	8.951.163	1,33		PAÍSES BAJOS		
	Total de Francia	38.136.074	5,67	46.360	IMCD Group NV	7.197.390	1,07
				33.912	Shop Apotheke Europe NV	2.802.827	0,42
					Total de Países Bajos	10.000.217	1,49
ALEMANIA				ESPAÑA			
286.057	Cancom AG	16.162.221	2,40	227.683	Applus Services SA	1.704.207	0,25
138.526	Cherry AG	2.147.153	0,32	583.556	Fluidra SA	15.347.523	2,28
232.078	CompuGroup Medical SE & Company KgaA	12.857.122	1,90		Total de España	17.051.730	2,53
229.852	CTS Eventim AG	14.255.421	2,12				
82.188	Gerresheimer AG	5.449.064	0,81				
17.873	Hypoport AG	6.155.461	0,91		SUECIA		
100.638	Nemetschek SE	8.836.016	1,31	604.863	Avanza Bank Holding AB	14.116.456	2,10
164.827	Norma Group SE	4.295.392	0,64	469.074	Cint Group AB	4.168.145	0,62
175.624	Stabilus GmbH	7.906.592	1,17	885.554	Elekta AB - B	6.338.540	0,94
78.490	Stratec Biomedical AG	7.943.188	1,18	1.161.698	Fortnox AB	5.820.122	0,86
	Total de Alemania	86.007.630	12,76	2.159.969	Karnov Group AB	12.456.670	1,86
				192.523	MIPS AB	16.338.740	2,42
				1.546.878	Munters Group AB	8.682.251	1,29
				416.620	Nordnet AB	6.830.340	1,01
				1.467.333	Stillfront Group AB	3.789.593	0,56
ISLANDIA							
1.872.455	Marel HF	9.924.012	1,48				
	Total de Islandia	9.924.012	1,48				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

Estado de la cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)			
SUECIA (continuación)				REINO UNIDO (continuación)			
270.506	Thule Group AB	9.782.761	1,45	1.195.848	Watches of Switzerland Group plc	16.132.163	2,40
	Total de Suecia	88.323.618	13,11		Total de Reino Unido	217.916.525	32,35
SUIZA				Total de renta variable			
28.488	Belimo Holding AG	13.702.622	2,04			673.157.766	99,94
6.309	Inficon Holding AG	6.555.981	0,97	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
4.604	LEM Holding SA	10.072.073	1,50			673.157.766	99,94
834.500	SIG Combibloc Group AG	19.071.186	2,83	Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
15.525	Tecan Group AG - Reg	5.579.753	0,83	Renta variable			
38.206	Vat Group AG	13.223.938	1,96	DINAMARCA			
138.324	VZ Holding AG	11.820.643	1,75	49.761	Ow Bunker A/S**	0	0,00
16.685	Zur Rose Group AG	2.212.898	0,33		Total de Dinamarca	0	0,00
	Total de Suiza	82.239.094	12,21		Total de renta variable	0	0,00
REINO UNIDO					Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	0	0,00
288.437	Abcam plc	4.727.293	0,70	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
2.857.852	Ascential plc	11.721.416	1,74	Fondos			
601.018	Auction Technology Group plc	6.984.105	1,03	IRLANDA			
1.169.486	Biffa plc	4.428.501	0,66	34	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	3.317	0,00
698.470	Big Yellow Group plc	12.695.528	1,89		Total de Irlanda	3.317	0,00
725.341	CVS Group plc	15.381.263	2,28		Total de fondos	3.317	0,00
2.377.520	Dr. Martens plc	6.718.468	1,00	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
290.675	FD Technologies plc	6.638.604	0,99			3.317	0,00
439.692	Future plc	13.538.409	2,01	Valor total de las inversiones			
43.191	Games Workshop Group plc	3.713.134	0,55			673.161.083	99,94
339.674	Genus plc	11.343.082	1,68	(Coste total: 548.825.583 EUR)			
589.672	GlobalData plc	8.739.770	1,30	<i>* Pequeñas diferencias debido al redondeo.</i>			
1.520.772	Howden Joinery Group plc	13.817.325	2,05	<i>** Titulo a su valor razonable.</i>			
3.219.543	Ibstock plc	6.682.448	0,99				
7.361.532	Johnson Service Group plc	10.261.841	1,52				
148.528	Keywords Studios plc	4.604.913	0,68				
1.018.461	Moonpig Group plc	2.699.630	0,40				
103.267	Renishaw plc	4.729.163	0,70				
886.815	Rightmove plc	6.640.660	0,99				
699.097	RWS Holdings plc	3.060.913	0,45				
712.140	Shaftesbury plc	5.203.722	0,77				
553.047	St James's Place plc	9.479.650	1,41				
1.563.476	Synthomer plc	5.654.007	0,84				
828.561	Victoria plc	8.883.098	1,32				
313.497	Victrex plc	6.788.851	1,01				
1.339.320	Volution Group plc	6.648.568	0,99				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

Estado de la cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)			
SUECIA				REINO UNIDO (continuación)			
1.171.181	Avanza Bank Holding AB	27.333.337	2,21	2.058.905	Watches of Switzerland Group plc	27.774.928	2,24
1.658.962	Elektta AB - B	11.874.373	0,96				
2.486.044	Fortnox AB	12.455.113	1,01		Total de Reino Unido	402.976.944	32,56
613.690	Nordnet AB	10.061.234	0,81				
1.476.535	Stillfront Group AB	3.813.358	0,31		Total de renta variable	1.233.550.937	99,77
447.776	Thule Group AB	16.193.673	1,31				
	Total de Suecia	81.731.088	6,61		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	1.233.550.937	99,77
SUIZA				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
57.582	Belimo Holding AG	27.696.730	2,24	Fondos			
10.253	Inficon Holding AG	10.654.378	0,86	IRLANDA			
1.512.816	SIG Combibloc Group AG	34.573.033	2,80	33.232	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	3.264.252	0,26
29.329	Tecan Group AG - Reg	10.540.970	0,85		Total de Irlanda	3.264.252	0,26
79.329	Vat Group AG	27.457.513	2,22				
28.496	Zur Rose Group AG	3.779.368	0,31		Total de fondos	3.264.252	0,26
	Total de Suiza	114.701.992	9,28		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	3.264.252	0,26
REINO UNIDO					Valor total de las inversiones	1.236.815.189	100,03
546.894	Abcam plc	8.963.233	0,72		(Coste total: 1.124.433.334 EUR)		
1.403.320	Allfunds Group plc	14.650.661	1,18				
5.347.541	Ascential plc	21.932.819	1,77				
1.147.295	Auction Technology Group plc	13.332.094	1,08				
536.116	Aveva Group plc	15.543.064	1,26				
2.055.814	Biffa plc	7.784.766	0,63				
1.494.773	Big Yellow Group plc	27.169.286	2,19				
1.418.154	CVS Group plc	30.072.752	2,43				
4.300.548	Dr. Martens plc	12.152.619	0,98				
4.382.881	Elementis plc	6.171.893	0,50				
536.463	FD Technologies plc	12.252.053	0,99				
851.432	Future plc	26.216.157	2,12				
69.122	Games Workshop Group plc	5.942.425	0,48				
650.890	Genus plc	21.735.838	1,76				
788.051	GlobalData plc	11.680.027	0,94				
2.881.714	Howden Joinery Group plc	26.182.479	2,12				
6.120.606	Ibstock plc	12.703.862	1,03				
1.965.615	Moonpig Group plc	5.210.246	0,42				
311.086	Renishaw plc	14.246.337	1,15				
971.312	Rentokil Initial plc	6.045.835	0,49				
1.477.144	RWS Holdings plc	6.467.498	0,52				
1.415.422	Shaftesbury plc	10.342.718	0,84				
1.535.458	St James's Place plc	26.318.929	2,13				
2.925.749	Synthomer plc	10.580.402	0,86				
1.012.124	Victoria plc	10.851.098	0,88				
491.933	Victrex plc	10.652.925	0,85				

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Select

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BÉLGICA				ESPAÑA			
137.035	Azelis Group NV	3.014.770	0,19	511.775	Amadeus IT Holding SA - A	30.286.845	1,87
	Total de Bélgica	3.014.770	0,19	2.221.525	Inditex SA	43.941.765	2,71
DINAMARCA				SUECIA			
196.976	DSV A/S	34.438.286	2,12	720.628	Atlas Copco AB - A	34.171.546	2,10
635.702	Novo Nordisk A/S	64.002.254	3,94	842.913	Epiroc AB	16.436.797	1,01
3.049.998	Tryg A/S	67.347.704	4,15	1.334.256	Sandvik AB	25.863.573	1,60
	Total de Dinamarca	165.788.244	10,21		Total de Suecia	76.471.916	4,71
FRANCIA				SUIZA			
113.492	Air Liquide SA	18.036.149	1,11	87.212	Lonza Group AG - Reg	57.254.584	3,53
856.465	Dassault Systemes SE	38.296.832	2,36	835.116	Nestle SA - Reg	98.036.270	6,04
20.186	Hermes International	26.070.219	1,61	8.109	Partners Group Holding AG - Reg	9.135.249	0,56
214.676	Legrand SA	18.543.713	1,14	99.186	Roche Holding AG	35.497.732	2,19
179.773	L'Oreal SA	65.410.406	4,03	37.729	Schindler Holding AG	7.332.699	0,45
138.921	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	90.215.297	5,55	205.463	Sika AG	61.684.066	3,80
302.005	Pernod-Ricard SA	60.189.597	3,71	97.587	Vat Group AG	33.777.009	2,08
469.955	Schneider Electric SE	71.508.353	4,41		Total de Suiza	302.717.609	18,65
	Total de Francia	388.270.566	23,92	REINO UNIDO			
ALEMANIA				1.769.725	Allfunds Group plc	18.475.929	1,14
847.655	Brenntag AG	62.167.018	3,83		Total de Reino Unido	18.475.929	1,14
669.236	SAP SE	67.673.144	4,17	Total de renta variable			
39.143	Sartorius AG	15.723.743	0,97	1.591.351.001			
688.008	Siemens Healthineers AG	38.693.570	2,38	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
727.010	Zalando SE	33.442.460	2,06	1.591.351.001			
	Total de Alemania	217.699.935	13,41	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
ITALIA				Fondos			
2.353.841	Fincobank Banca Fineco SpA	32.541.852	2,00	IRLANDA			
1.487.170	Nexi SpA	15.615.285	0,96	281.536	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	27.654.165	1,70
	Total de Italia	48.157.137	2,96	Total de Países Bajos			
PAÍSES BAJOS				16.825	Adyen NV	30.436.425	1,87
160.083	ASML Holding NV	97.650.630	6,02	5.367.143	Davide Campari-Milano NV	56.650.194	3,49
265.399	IMCD Group NV	41.203.195	2,54	251.238	Koninklijke DSM NV	40.826.175	2,51
751.317	STMicroelectronics NV	29.759.666	1,83		Total de Países Bajos	296.526.285	18,26

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Select

Estado de la cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios (continuación)			
Fondos (continuación)			
IRLANDA (continuación)			
1.020.408	Insight Liquidity Funds plc	985.714	0,06
	Total de Irlanda	28.639.879	1,76
	Total de fondos	28.639.879	1,76
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	28.639.879	1,76
	Valor total de las inversiones	1.619.990.880	99,79
(Coste total: 1.264.696.063 EUR)			

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BÉLGICA				ALEMANIA (continuación)			
869.837	Azelis Group NV	19.136.414	1,08	44.213	Hypoport AG	15.226.957	0,86
1.806	Lotus Bakeries NV	8.578.500	0,48	217.008	Knorr-Bremse AG	15.112.437	0,85
495.413	Melexis NV	41.614.692	2,35	362.355	Nemetschek SE	31.814.769	1,79
534.368	Umicore SA	21.032.724	1,19	477.684	Norma Group SE	12.448.445	0,70
	Total de Bélgica	90.362.330	5,10	264.828	Puma AG Rudolf Dassler Sport	20.508.280	1,16
				70.730	Sartorius AG	28.412.241	1,60
				333.771	Stabilus GmbH	15.026.370	0,85
				258.356	Stratec Biomedical AG	26.145.627	1,47
					Total de Alemania	362.247.036	20,43
DINAMARCA				ISLANDIA			
996.460	Alk-Abello A/S	20.019.101	1,12	5.128.285	Marel HF	27.179.911	1,53
388.380	Simcorp A/S	25.949.626	1,46		Total de Islandia	27.179.911	1,53
2.019.489	Tryg A/S	44.592.799	2,52				
	Total de Dinamarca	90.561.526	5,10				
FINLANDIA				IRLANDA			
355.563	Cargotec Corp.	12.281.146	0,69	3.031.829	Dalata Hotel Group Limited	12.006.043	0,68
843.222	Huhtamaki Oyj	26.628.951	1,50	5.240.436	Irish Continental Group plc	20.306.690	1,15
635.195	Konecranes Oyj	17.766.404	1,00	415.331	Kingspan Group plc	36.981.072	2,09
439.431	Musti Group Oyj	10.528.767	0,60		Total de Irlanda	69.293.805	3,92
225.168	Revenio Group Oyj	10.767.534	0,61				
473.525	Vaisala Oyj	20.432.604	1,15				
	Total de Finlandia	98.405.406	5,55				
FRANCIA				ITALIA			
1.530.519	Bureau Veritas SA	39.701.662	2,24	188.166	Diasorin SpA	26.700.755	1,51
332.614	Edenred	14.941.021	0,84	2.765.777	Fincobank Banca Fineco SpA	38.236.867	2,16
1.607.496	Elis SA	21.540.445	1,22	1.275.584	GVS SpA	10.510.812	0,59
333.531	Korian-Medica	6.984.139	0,39	2.703.878	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	27.484.920	1,55
332.636	Nexity SA	10.611.088	0,60	1.193.762	Marr SpA	17.918.368	1,01
147.218	Remy Cointreau	27.529.766	1,55	1.661.425	Nexi SpA	17.444.963	0,98
113.025	SEB SA	14.308.965	0,81	1.009.776	Technoprobe SpA	6.725.108	0,38
29.748	Somfy SA	4.349.158	0,25		Total de Italia	145.021.793	8,18
28.662	Teleperformance	9.925.651	0,56				
1.087.925	Verallia SA	23.433.905	1,32				
114.694	Worldline SA	4.528.693	0,26				
	Total de Francia	177.854.493	10,04				
ALEMANIA				LUXEMBURGO			
53.680	Atoss Software AG	9.630.192	0,54	383.196	Eurofins Scientific SE	34.453.153	1,95
507.247	Brenntag AG	37.201.495	2,10		Total de Luxemburgo	34.453.153	1,95
551.524	Cancom AG	31.161.106	1,76				
120.488	Carl Zeiss Meditec AG	17.705.712	1,00				
587.350	CompuGroup Medical SE & Company KgaA	32.539.190	1,84				
798.745	CTS Eventim AG	49.538.165	2,79				
96.788	Dermapharm Holding SE	5.584.668	0,32				
214.048	Gerresheimer AG	14.191.382	0,80				
				PAÍSES BAJOS			
				136.589	ASM International NV	45.361.207	2,56
				2.530.979	Davide Campari-Milano NV	26.714.483	1,51
				275.640	IMCD Group NV	42.793.110	2,41
				77.224	Shop Apotheke Europe NV	6.382.564	0,36
					Total de Países Bajos	121.251.364	6,84

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

Estado de la cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				
Renta variable (continuación)				Renta variable				
ESPAÑA				DINAMARCA				
1.537.498	Applus Services SA	11.508.173	0,65	280.528	Ow Bunker A/S**	0	0,00	
1.584.055	Fluidra SA	41.660.647	2,35	Total de Dinamarca			0	0,00
Total de España		53.168.820	3,00	Total de renta variable			0	0,00
SUECIA				Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				
1.525.354	Avanza Bank Holding AB	35.599.123	2,01	0				0,00
1.167.144	Cint Group AB	10.371.127	0,59	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				
2.251.701	Elekta AB - B	16.117.028	0,91	Fondos				
3.120.200	Fortnox AB	15.632.242	0,88	IRLANDA				
749.099	Hemnet Group AB	10.265.653	0,58	207.172	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	20.349.761	1,15	
136.990	MIPS AB	11.625.853	0,66	Total de Irlanda			20.349.761	1,15
1.313.431	Nordnet AB	21.533.245	1,21	Total de fondos			20.349.761	1,15
1.502.529	Stillfront Group AB	3.880.491	0,22	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				
657.228	Thule Group AB	23.768.437	1,34	20.349.761				1,15
150.041	Vitrolife AB	4.508.797	0,25	Valor total de las inversiones				
Total de Suecia		153.301.996	8,65	(Coste total: 1.312.756.612 EUR)				
SUIZA				* Pequeñas diferencias debido al redondeo.				
102.547	Belimo Holding AG	49.324.729	2,78	** Título a su valor razonable.				
61.346	Burckhardt Compression Holding AG	29.297.504	1,65					
19.275	Inficon Holding AG	20.029.565	1,13					
15.321	LEM Holding SA	33.517.424	1,90					
2.167.726	SIG Combibloc Group AG	49.539.972	2,79					
132.156	Sika AG	39.675.852	2,24					
172.084	Skan Group AG	10.756.128	0,61					
64.694	Tecan Group AG - Reg	23.251.305	1,31					
137.248	Vat Group AG	47.504.554	2,68					
35.412	Zur Rose Group AG	4.696.623	0,26					
Total de Suiza		307.593.656	17,35					
REINO UNIDO								
1.791.255	Allfunds Group plc	18.700.702	1,05					
Total de Reino Unido		18.700.702	1,05					
Total de renta variable		1.749.395.991	98,69					
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		1.749.395.991	98,69					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
AUSTRALIA				INDIA			
20.365	Aristocrat Leisure Limited	561.257	1,08	224.465	Embassy Office Parks REIT	1.101.222	2,11
75.754	Australia & New Zealand Banking Group Limited	1.570.094	3,01	43.036	HDFC Bank Limited	835.080	1,60
410.033	Deterra Royalties Limited	1.487.226	2,85	120.293	Hindalco Industries Limited	904.085	1,73
150.606	Dexus Property Group	1.238.418	2,38	188.977	Petronet Lng Limited	483.199	0,93
12.337	Macquarie Group Limited	1.883.189	3,61	61.076	Tech Mahindra Limited	1.208.587	2,31
45.478	Oz Minerals Limited	910.826	1,75		Total de India	4.532.173	8,68
152.352	Transurban Group	1.550.238	2,97				
	Total de Australia	9.201.248	17,65				
ISLAS CAIMÁN				INDONESIA			
182.000	China Mengniu Dairy Company Limited	980.718	1,88	3.431.878	Bank Rakyat Indonesia	1.113.561	2,13
270.000	China Resources Land Limited	1.258.394	2,41	3.682.200	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	1.174.273	2,25
595	JD.com Inc. - A	17.778	0,03		Total de Indonesia	2.287.834	4,38
65.485	NetEase Inc.	1.202.433	2,31				
18.400	Tencent Holdings Limited	879.189	1,69				
	Total de Islas Caimán	4.338.512	8,32				
CHINA				REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
582.000	Baoshan Iron & Steel Company Limited - A	618.845	1,19	33.630	Hanon Systems	327.408	0,63
1.189.000	China Construction Bank Corp.	894.247	1,71	23.397	KB Financial Group Inc.	1.183.317	2,27
192.500	China Merchants Bank Company Limited - H	1.512.931	2,90	9.230	Kia Corp.	563.526	1,08
140.042	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	813.808	1,56	41.204	Kt Corp.	1.213.635	2,33
117.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	834.955	1,60	3.217	Posco Holdings Inc.	777.676	1,49
14.900	Wuliangye Yibin Company Limited - A	363.949	0,70	42.894	Samsung Electronics Company Limited Pfd	2.229.551	4,27
	Total de China	5.038.735	9,66	13.573	SK Telecom Company Limited	637.189	1,22
					Total de República de Corea (Sur)	6.932.302	13,29
HONG KONG				SINGAPUR			
151.800	AIA Group Limited	1.598.170	3,06	704.000	Capitamall Trust	1.170.429	2,24
128.000	Galaxy Entertainment Group Limited	768.189	1,47	813.200	Digital Core REIT Management Pte Limited	902.652	1,73
20.322	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	963.759	1,85	287.900	Keppel Corp. Limited	1.365.735	2,62
85.500	Sun Hung Kai Properties Limited	1.021.886	1,96	68.300	United Overseas Bank Limited	1.615.964	3,10
376.000	Xinyi Glass Holdings Limited	912.224	1,75		Total de Singapur	5.054.780	9,69
	Total de Hong Kong	5.264.228	10,09				
TAIWÁN							
				88.000	Chailease Holding Company Limited	778.594	1,49
				137.000	Chroma ATE Inc.	860.683	1,65
				11.000	MediaTek Inc.	347.449	0,67
				218.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	4.542.356	8,71
				53.000	Yageo Corp.	802.816	1,54
					Total de Taiwán	7.331.898	14,06

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

Estado de la cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
TAILANDIA			
315.200	PTT Exploration & Production pcl	1.365.068	2,62
2.208.300	Thai Beverage pcl	1.166.686	2,23
	Total de Tailandia	2.531.754	4,85
	Total de renta variable	52.513.464	100,67
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	52.513.464	100,67
	Valor total de las inversiones	52.513.464	100,67
	(Coste total: 44.244.501 USD)		

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Global Technology

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
CANADÁ				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
86.300	Shaw Communications Inc.	2.680.788	0,41	41.053	Broadcom Inc.	25.850.253	3,97
	Total de Canadá	2.680.788	0,41	84.629	Cerence Inc.	3.055.107	0,47
ISLAS CAIMÁN				65.800	Cisco Systems Inc.	3.669.008	0,56
72.106	Globalfoundries Inc.	4.500.857	0,69	62.600	Comcast Corp.	2.930.932	0,45
105.151	Pagseguro Digital Limited	2.108.278	0,32	105.992	Dell Technologies Inc. - C	5.319.738	0,82
203.876	Smart Global Holdings Inc.	5.266.117	0,81	543.048	Dropbox Inc. - A	12.625.866	1,94
	Total de Islas Caimán	11.875.252	1,82	83.109	Dxc Technology Company	2.711.847	0,42
ALEMANIA				245.706	Ebay Inc.	14.069.125	2,16
77.200	TeamViewer AG	1.156.597	0,18	363.353	Eiger Biopharmaceuticals Inc.	3.015.830	0,46
	Total de Alemania	1.156.597	0,18	46.804	F5 Inc.	9.779.696	1,50
ISRAEL				46.708	Fidelity National Information Services Inc.	4.690.417	0,72
12.700	Cyberark Software Limited	2.143.125	0,33	61.123	Fiserv Inc.	6.197.872	0,95
6.536	Kornit Digital Limited	540.462	0,08	35.723	Fortinet Inc.	12.207.978	1,87
	Total de Israel	2.683.587	0,41	155.852	GoDaddy Inc. - A	13.044.812	2,00
JAPÓN				94.942	Hireright Holdings Corp.	1.623.508	0,25
906.500	Renesas Electronics Corp.	10.695.021	1,64	380.692	HP inc.	13.819.120	2,12
70.900	Sumco Corp.	1.184.052	0,18	24.964	Intapp Inc.	599.386	0,09
	Total de Japón	11.879.073	1,82	108.450	Intel Corp.	5.374.782	0,82
PAÍSES BAJOS				68.946	Lam Research Corp.	37.066.060	5,70
42.309	NXP Semiconductor NV	7.830.550	1,20	99.844	Lumentum Holdings Lite US	9.744.774	1,50
	Total de Países Bajos	7.830.550	1,20	236.615	Marvell Technology Inc.	16.967.662	2,60
SUECIA				95.000	Microchip Technology Inc.	7.138.300	1,10
497.300	Telefonaktiebolaget LM Ericsson - ADR	4.545.322	0,70	170.162	Micron Technology Inc.	13.253.918	2,03
	Total de Suecia	4.545.322	0,70	74.816	Microsoft Corp.	23.066.521	3,54
ESTADOS UNIDOS				138.760	NetApp Inc.	11.517.080	1,77
96.758	Activision Blizzard Inc.	7.751.283	1,19	425.586	Nortonlifelock Inc.	11.286.541	1,73
106.966	Advanced Energy Industries Inc.	9.207.633	1,41	68.900	Oracle Corp.	5.700.097	0,87
10.301	Alphabet Inc. - A	28.650.686	4,40	19.897	Palo Alto Networks Inc.	12.386.081	1,90
4.813	Alphabet Inc. - C	13.442.661	2,06	38.671	PowerSchool Holdings Inc.	638.458	0,10
95.768	Analog Devices Inc.	15.818.958	2,43	85.750	Qorvo Inc.	10.641.575	1,63
214.660	Apple Inc.	37.481.782	5,75	133.307	Rambus Inc.	4.251.160	0,65
169.129	Applied Materials Inc.	22.291.202	3,42	43.890	Sailpoint Technologies Holding Inc.	2.246.290	0,34
32.972	Arista Networks Inc.	4.582.449	0,70	23.977	Salesforce.com Inc.	5.090.797	0,78
609.625	Bloom Energy Corp.	14.722.444	2,26	234.733	Samsara Inc.	3.760.423	0,58
				8.800	Splunk Inc.	1.307.768	0,20
				122.566	Synaptics Inc.	24.451.917	3,75
				66.781	Synopsys Inc.	22.256.104	3,42
				33.888	Tenable Holdings Inc.	1.958.388	0,30
				203.018	Teradyne Inc.	24.002.818	3,68
				125.774	Thoughtworks Holding Inc.	2.617.357	0,40
				1.900	T-Mobile USA Inc.	243.865	0,04
				15.300	Twitter Inc.	591.957	0,09
				24.188	Verint Systems Inc.	1.250.520	0,19
				148.600	Viavi Solutions Inc.	2.389.488	0,37
				70.514	Visa Inc. - A	15.637.889	2,40
				39.329	VMware Inc. - A	4.478.393	0,69

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Technology

Estado de la cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
ESTADOS UNIDOS (continuación)			
291.347	Western Digital Corp.	14.465.379	2,22
413.561	Xperi Holding Corp.	7.162.877	1,10
25.300	Zendesk Inc.	3.043.337	0,47
	Total de Estados Unidos	595.148.169	91,33
	Total de renta variable	637.799.338	97,87
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	637.799.338	97,87
	Valor total de las inversiones	637.799.338	97,87
	(Coste total: 463.333.314 USD)		

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - UK Equities

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado GBP	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado GBP	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
IRLANDA				REINO UNIDO (continuación)			
220.005	CRH plc	6.758.553	2,47	421.251	Smith & Nephew plc	5.139.263	1,87
204.319	Experian plc	6.029.454	2,20	313.482	Smiths Group plc	4.553.326	1,66
	Total de Irlanda	12.788.007	4,67	1.224.250	SSP Group plc	2.781.496	1,01
				390.081	St James's Place plc	5.650.323	2,06
				822.690	Standard Chartered plc	4.197.364	1,53
				667.969	Synthomer plc	2.041.313	0,74
				541.336	Tate & Lyle plc	3.963.662	1,44
				2.454.856	Tesco plc	6.775.403	2,47
				344.625	Unilever plc	11.906.794	4,33
				322.550	Weir Group plc	5.293.046	1,93
				201.716	Whitbread plc	5.763.026	2,10
					Total de Reino Unido	252.178.515	91,87
					Total de renta variable	268.738.292	97,91
					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	268.738.292	97,91
					Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		
					Fondos		
					IRLANDA		
				3.642.312	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	3.642.312	1,33
					Total de Irlanda	3.642.312	1,33
					Total de fondos	3.642.312	1,33
					Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	3.642.312	1,33
					Valor total de las inversiones	272.380.604	99,24
					(Coste total: 274.885.441 GBP)		

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado GBP	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado GBP	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
GUERNSEY - ISLAS DEL CANAL				REINO UNIDO (continuación)			
2.895.980	Sherborne Investors Guernsey	1.349.527	0,58	204.941	United Utilities Group plc	2.304.561	0,99
	Total de Guernsey - Islas del Canal	1.349.527	0,58	1.016.474	Wincanton plc	3.923.590	1,69
REINO UNIDO				Total de Reino Unido			
654.679	3i Group plc	9.090.218	3,91			225.184.338	96,80
232.713	Astrazeneca plc	23.578.480	10,14	Total de renta variable			
1.027.578	BAE Systems plc	7.371.845	3,17	226.533.865			
3.756.140	BT Group plc	6.843.687	2,94	97,38			
4.601.202	Centrica plc	3.684.643	1,58	Fondos			
820.300	Chesnara plc	2.489.611	1,07	REINO UNIDO			
308.877	Compass Group	5.096.471	2,19	39.794	Unbound Group plc	14.127	0,00
2.147.684	Direct Line Insurance Group plc	5.908.279	2,54	Total de Reino Unido			
1.135.398	DS Smith plc	3.657.117	1,57	14.127			
1.624.605	Electrocomponents plc	17.610.718	7,57	0,00			
892.941	Elementis plc	1.062.600	0,46	Total de fondos			
68.171	Ferguson plc	7.076.150	3,04	14.127			
864.370	Glaxosmithkline plc	14.237.903	6,12	0,00			
87.682	Go-Ahead Group plc	722.500	0,31	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
3.623.263	Hays plc	4.449.367	1,91	226.547.992			
119.309	Hostmore plc	79.340	0,03	97,38			
213.852	Imi plc	2.914.803	1,25	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
670.518	Imperial Brands plc	10.798.692	4,64	Fondos			
4.323.223	ITV plc	3.541.584	1,52	IRLANDA			
304.467	JD Wetherspoon plc	2.379.410	1,02	2.810.958	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	2.810.958	1,21
174.691	Johnson Matthey plc	3.281.570	1,41	Total de Irlanda			
2.285.276	Legal & General Group plc	6.215.951	2,67	2.810.958			
2.862.131	Marks & Spencer Group plc	4.427.716	1,91	1,21			
1.771.758	Melrose Industries plc	2.212.040	0,95	Total de fondos			
506.146	Morgan Crucible Company	1.569.053	0,67	2.810.958			
138.082	Morgan Sindall plc	3.334.680	1,43	1,21			
199.796	Oxford Instruments plc	4.215.696	1,81	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
970.889	Pearson plc	7.287.493	3,14	2.810.958			
157.333	Pennon Group plc	1.691.330	0,73	1,21			
1.335.337	Phoenix Group Holdings plc	8.198.968	3,53	Total de inversiones			
1.256.330	Rank Group plc	1.691.020	0,73	229.358.950			
310.347	RELX plc	7.395.569	3,18	98,59			
2.232.995	Rentokil Initial plc	11.745.554	5,05	(Coste total: 217.491.065 GBP)			
354.824	Smiths Group plc	5.153.818	2,22	<i>* Pequeñas diferencias debido al redondeo.</i>			
824.213	Tate & Lyle plc	6.034.888	2,59				
2.085.884	Tesco plc	5.757.040	2,47				
178.014	Unilever plc	6.150.383	2,65				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
CANADÁ				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
219	Shopify Inc. - A	148.035	0,60	2.084	Union Pacific Corp.	569.370	2,30
	Total de Canadá	148.035	0,60	4.652	United Parcel Service Inc.	997.668	4,03
				3.205	Vertex Pharmaceuticals Inc.	836.409	3,38
				2.844	Voya Financial Inc.	188.699	0,76
					Total de Estados Unidos	22.046.953	89,11
ISLAS CAIMÁN				Total de renta variable			
4.824	Globalfoundries Inc.	301.114	1,22			22.496.102	90,93
	Total de Islas Caimán	301.114	1,22	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
						22.496.102	90,93
ESTADOS UNIDOS				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
1.611	Adobe Systems Inc.	734.004	2,97	Fondos			
2.379	Agco Corp.	347.405	1,41	IRLANDA			
460	Alphabet Inc. - A	1.279.421	5,17	775.566	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	775.566	3,13
6.160	American Electric Power Company Inc.	614.583	2,48		Total de Irlanda	775.566	3,13
1.470	Block Inc.	199.332	0,81	Total de fondos			
1.992	Cirrus Logic Inc.	168.902	0,68			775.566	3,13
22.779	Cisco Systems Inc.	1.270.157	5,13	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
13.223	Coca Cola Company	819.826	3,31			775.566	3,13
2.695	CrowdStrike Holdings Inc. - A	611.981	2,47	Valor total de las inversiones			
11.243	CVS Health Corp.	1.137.904	4,60			23.271.668	94,06
5.035	Darling International Inc.	404.713	1,64	(Coste total: 21.877.783 USD)			
2.920	Doordash Inc. - A	342.195	1,38	<i>* Pequeñas diferencias debido al redondeo.</i>			
2.541	Doximity Inc.	132.361	0,53				
10.172	Electronic Arts Inc.	1.286.860	5,21				
2.747	Exact Sciences Corp.	192.070	0,78				
3.767	Gap Inc.	53.039	0,21				
7.900	General Motors Company	345.546	1,40				
1.080	Herc Holdings Inc.	180.457	0,73				
4.340	Hilton Worldwide Holdings Inc.	658.552	2,66				
8.686	Konтоor Brands Inc.	359.166	1,45				
1.554	Lam Research Corp.	835.446	3,38				
11.980	Livent Corp.	312.319	1,26				
690	Mastercard Inc. - A	246.592	1,00				
3.958	Microsoft Corp.	1.220.291	4,94				
2.150	Mirati Therapeutics Inc.	176.773	0,71				
2.619	Ncino Inc.	107.327	0,43				
5.280	Northern Trust Corp.	614.856	2,49				
28.394	Nov Inc.	556.806	2,25				
7.897	Ranpak Holdings Corp.	161.336	0,65				
3.859	Salesforce.com Inc.	819.343	3,31				
4.112	Schnitzer Steel Industries Inc.	213.577	0,86				
2.967	Starbucks Corp.	269.908	1,09				
7.392	State Street Corp.	643.991	2,61				
727	Svb Financial Group	406.720	1,64				
4.273	Target Corp.	906.816	3,68				
5.974	Teradata Corp.	294.458	1,19				
531	Teradyne Inc.	62.780	0,25				
4.519	Transunion	466.994	1,88				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
AUSTRALIA				FRANCIA					
EUR	1.648.000	APT Pipelines Limited 1.25% 15/03/2033	1.449.061	0,15	EUR	1.209.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	1.165.583	0,12
EUR	1.098.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	967.762	0,10	EUR	1.171.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	1.065.409	0,11
EUR	2.580.000	Ausgrid Finance Pty Limited 1.25% 30/07/2025	2.573.353	0,26	EUR	7.300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.25% 29/06/2028	6.743.982	0,69
EUR	2.220.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd 0.63% 25/08/2030	1.982.132	0,20	EUR	2.600.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	2.253.955	0,23
EUR	2.683.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	2.681.887	0,27	EUR	500.000	Casino Guichard Perrachon SA 1.87% 13/06/2022	500.735	0,05
USD	7.782.000	SGSP Australia Assets Pty Limited 3.25% 29/07/2026	6.936.191	0,71	EUR	2.055.000	Casino Guichard Perrachon SA 5.25% 15/04/2027	1.757.782	0,18
		Total de Australia	16.590.386	1,69	EUR	2.717.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	2.483.501	0,25
					EUR	1.088.000	Constellium SE 3.13% 15/07/2029	1.002.199	0,10
					EUR	5.200.000	Electricite de France SA Perp FRN	4.671.202	0,48
BÉLGICA					EUR	1.400.000	Electricite de France SA Perp FRN	1.261.794	0,13
EUR	1.162.000	Anheuser-Busch InBev SA 3.70% 02/04/2040	1.400.960	0,14	EUR	1.565.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	1.431.364	0,15
EUR	6.700.000	Belfius Bank SA Perp FRN	6.733.500	0,69	EUR	3.668.000	Faurecia SE 2.75% 15/02/2027	3.361.456	0,34
EUR	1.500.000	Belfius Bank SA/ NV 0.13% 08/02/2028	1.379.334	0,14	EUR	6.333.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	6.487.631	0,66
EUR	2.800.000	Kbc Group NV Perp FRN	2.762.842	0,28	EUR	3.300.000	Holding d'infrastructures de Transport SASU 1.48% 18/01/2031	3.122.704	0,32
		Total de Bélgica	12.276.636	1,25	EUR	5.754.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	5.833.819	0,59
ISLAS CAIMÁN					EUR	1.100.000	Iliad SA 0.75% 11/02/2024	1.066.136	0,11
GBP	12.010.000	Southern Water Services Limited 2.38% 28/05/2028	13.892.705	1,41	EUR	1.100.000	Iliad SA 1.50% 14/10/2024	1.072.168	0,11
USD	742.000	Tencent Holdings Limited 3.24% 03/06/2050	522.008	0,05	EUR	4.645.000	Iqera Group SAS 6.50% 30/09/2024	4.674.931	0,48
USD	1.333.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	1.173.003	0,12	EUR	5.235.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	5.280.850	0,53
USD	1.800.000	Tencent Holdings Limited 3.93% 19/01/2038	1.500.426	0,15	EUR	2.327.000	Picard Groupe SAS 3.88% 01/07/2026	2.265.229	0,23
GBP	5.506.000	Thames Water Utilities Cayman 2.88% 03/05/2027	6.326.569	0,64			Total de Francia	57.502.430	5,86
		Total de Islas Caimán	23.414.711	2,37					
DINAMARCA				ALEMANIA					
EUR	575.000	Danske Bank AS FRN 15/05/2031	542.526	0,06	EUR	2.500.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	2.376.956	0,24
		Total de Dinamarca	542.526	0,06	EUR	2.300.000	Adler Real Estate AG 2.13% 06/02/2024	2.112.588	0,22
FINLANDIA				EUR	4.200.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	3.946.313	0,40	
EUR	2.624.000	Nordea Bank Abp 0.50% 14/05/2027	2.527.921	0,26	EUR	4.700.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	3.954.273	0,40
		Total de Finlandia	2.527.921	0,26	EUR	2.700.000	Bayer AG 1.00% 12/01/2036	2.238.555	0,23
					EUR	3.590.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	3.491.531	0,36

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ALEMANIA (continuación)				IRLANDA					
EUR	6.969.000	Commerzbank AG 0.50% 04/12/2026	6.713.559	0,68	EUR	4.767.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	4.662.264	0,48
EUR	1.508.000	Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	1.491.061	0,15	EUR	1.275.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	1.259.921	0,13
EUR	5.600.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	5.739.064	0,59	EUR	1.181.000	AIB Group plc Perp FRN	1.225.161	0,12
EUR	2.300.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	2.152.891	0,22	EUR	3.710.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	3.445.430	0,35
EUR	4.400.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	4.100.581	0,42	EUR	1.793.000	Eaton Capital Unlimi 0.58% 08/03/2030	1.646.660	0,17
EUR	1.800.000	Deutsche Lufthansa AG 3.75% 11/02/2028	1.736.670	0,18	EUR	4.533.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	4.476.904	0,46
EUR	1.381.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	1.372.268	0,14	EUR	2.347.000	Experian Europe DAC 1.56% 16/05/2031	2.307.187	0,24
EUR	1.215.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	1.184.646	0,12			Total de Irlanda	19.023.527	1,95
EUR	1.327.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	1.293.848	0,13			ISLA DE MAN		
EUR	7.787.000	HT Troplast AG 9.25% 15/07/2025	7.800.141	0,80	EUR	3.200.000	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	3.217.600	0,33
EUR	1.308.000	Ineos Styrolution Group GmbH 2.25% 16/01/2027	1.191.757	0,12			Total de Isla de Man	3.217.600	0,33
EUR	1.800.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	1.536.789	0,16			ITALIA		
EUR	3.000.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	2.861.667	0,29	EUR	932.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	854.648	0,09
EUR	3.555.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	3.427.953	0,35	EUR	815.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	793.445	0,08
EUR	2.610.000	Peach Property Finance GmbH 3.50% 15/02/2023	2.595.921	0,26	EUR	3.000.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	2.820.618	0,29
EUR	3.240.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	3.212.832	0,33	EUR	1.444.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	1.314.666	0,13
EUR	3.100.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	3.118.459	0,32	EUR	3.870.000	Banco BPM SpA 1.75% 24/04/2023	3.918.030	0,40
EUR	3.000.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	2.943.960	0,30	EUR	3.261.000	Fis Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	3.106.280	0,32
EUR	4.112.000	Schenck Process Holding GmbH 5.38% 15/06/2023	4.079.521	0,42	EUR	1.673.000	Lkq Italia Bondco 3.88% 01/04/2024	1.731.351	0,18
EUR	4.140.000	SGL Carbon SE 4.63% 30/09/2024	4.096.875	0,42	EUR	3.342.000	Nexi SpA 1.75% 31/10/2024	3.358.839	0,34
EUR	2.288.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 2.00% 15/07/2025	2.204.978	0,22	EUR	2.000.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	2.054.208	0,21
		Total de Alemania	82.975.657	8,47			Total de Italia	19.952.085	2,04
INDIA				JERSEY - ISLAS DEL CANAL					
USD	3.630.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	3.146.318	0,32	EUR	5.384.000	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	5.298.445	0,54
USD	8.251.000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	6.800.672	0,69	EUR	8.100.000	Avis Budget Finance plc 4.13% 15/11/2024	8.157.173	0,84
		Total de India	9.946.990	1,01	USD	5.340.682	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.16% 31/03/2034	4.435.740	0,45
					GBP	1.855.000	Hastings Group Finance plc 3.00% 24/05/2025	2.235.447	0,23

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
JERSEY - ISLAS DEL CANAL (continuación)				PAÍSES BAJOS (continuación)					
EUR	1.542.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	1.401.457	0,14	EUR	4.300.000	Constellium SE 4.25% 15/02/2026	4.311.408	0,44
		Total de Jersey - Islas del Canal	21.528.262	2,20	EUR	3.200.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/06/2170	3.200.000	0,33
LUXEMBURGO				PAÍSES BAJOS (continuación)					
EUR	1.600.000	Adler Group SA 3.25% 05/08/2025	1.414.190	0,14	EUR	4.400.000	Cooperatieve Rabobank UA Perp FRN	4.440.709	0,45
EUR	2.295.000	Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	2.028.983	0,21	EUR	6.028.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	6.080.754	0,62
EUR	1.236.000	Altice Financing SA 4.25% 15/08/2029	1.106.653	0,11	EUR	2.544.000	Diebold Nixdorf Dutch Holding BV 9.00% 15/07/2025	2.632.961	0,27
EUR	4.959.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	5.128.287	0,52	GBP	2.900.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	4.275.298	0,44
EUR	3.300.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	3.014.090	0,31	EUR	2.100.000	Iberdrola International BV Perp FRN	1.912.576	0,19
EUR	3.900.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	3.641.955	0,38	USD	4.600.000	ING Groep NV Perp FRN	3.609.834	0,37
GBP	1.855.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	2.110.726	0,22	EUR	1.971.000	Lkq European Holdings BV 4.13% 01/04/2028	2.044.691	0,21
EUR	1.138.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 12/02/2036	1.004.539	0,10	EUR	2.010.000	Sagax Euro MTN BV 0.75% 26/01/2028	1.766.337	0,18
EUR	1.150.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	947.695	0,10	EUR	3.020.000	Stedin Holding NV Perp FRN	2.912.284	0,30
EUR	4.249.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	3.921.538	0,40	EUR	3.140.000	Stichting Ak Rabobank Perp 6.50%	3.670.764	0,37
EUR	1.704.000	Cirsa Finance International Sarl 4.50% 15/03/2027	1.617.040	0,16	EUR	4.646.324	Summer Bidco BV 9.00% 15/11/2025	4.638.645	0,47
EUR	2.673.189	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	2.690.352	0,27	EUR	3.300.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	3.056.081	0,31
EUR	1.613.000	Gamma Bondco Sarl 8.13% 15/11/2026	1.583.008	0,16	EUR	5.700.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	5.913.992	0,60
EUR	1.331.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 6.75% 01/11/2025	1.328.398	0,14	EUR	3.758.000	Tennet Holding BV Perp FRN	3.773.133	0,38
GBP	2.120.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	2.497.379	0,25	EUR	5.221.000	Tennet Holding BV Perp FRN	5.342.829	0,54
EUR	2.100.000	Grand City Properties SA Perp FRN	1.870.561	0,19	EUR	1.733.000	Thermo Fisher Scientific Finance BV 1.63% 18/10/2041	1.561.629	0,16
EUR	7.243.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	6.667.305	0,68	EUR	4.200.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	3.967.716	0,40
EUR	2.000.000	Matterhorn Telecom SA 2.63% 15/09/2024	2.008.133	0,20	EUR	4.873.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	4.874.598	0,50
EUR	3.835.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	3.515.074	0,36	EUR	1.000.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	1.199.049	0,12
EUR	2.394.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	2.353.198	0,24			Total de Países Bajos	77.820.108	7,92
		Total de Luxemburgo	50.449.104	5,14	NORUEGA				
PAÍSES BAJOS				ESPAÑA					
EUR	2.848.000	Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	2.634.820	0,27	EUR	4.349.000	Grifols Escrow Issuer SA 3.88% 15/10/2028	4.146.139	0,43
					EUR	3.531.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	3.411.594	0,35

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESPAÑA (continuación)				REINO UNIDO (continuación)					
EUR	2.000.000	Merlin Properties Socimi SA 1.38% 01/06/2030	1.763.470	0,18	GBP	3.028.000	Co-Operative Bank Finance FRN 06/04/2027	3.583.172	0,36
EUR	1.242.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	1.238.380	0,13	GBP	3.679.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	4.167.944	0,42
		Total de España	10.559.583	1,09	EUR	3.308.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	3.258.391	0,33
					USD	4.639.224	Enquest plc 7.00% 15/10/2023	4.105.525	0,42
SUECIA					GBP	3.919.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	4.696.732	0,47
EUR	4.200.000	Intrum AB 3.13% 15/07/2024	4.179.735	0,43	EUR	6.500.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	6.893.141	0,70
EUR	1.704.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	1.599.419	0,16	GBP	2.920.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	4.076.708	0,42
EUR	2.449.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	2.305.480	0,24	EUR	10.300.000	HSBC Holdings plc Perp FRN	10.371.733	1,06
EUR	1.270.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	1.195.574	0,12	GBP	3.848.000	Iceland Bondco plc 4.63% 15/03/2025	4.097.367	0,42
EUR	7.682.000	Verisure Holding AB 3.50% 15/05/2023	7.687.533	0,78	EUR	1.840.000	Imperial Brands Finance plc 3.38% 26/02/2026	1.934.196	0,20
		Total de Suecia	16.967.741	1,73	EUR	4.600.000	Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	4.523.057	0,45
SUIZA					EUR	1.537.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	1.456.160	0,15
EUR	2.571.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	2.314.160	0,24	EUR	3.189.000	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	3.264.424	0,33
EUR	3.200.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	2.601.190	0,27	EUR	2.200.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	2.220.675	0,23
USD	4.500.000	Credit Suisse Group AG Perp FRN	4.196.707	0,43	GBP	500.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 3.88% 01/03/2023	587.470	0,06
EUR	3.238.000	UBS AG 0.50% 31/03/2031	2.950.222	0,30	GBP	3.100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 3.88% 01/03/2023	3.642.316	0,37
USD	6.600.000	UBS Group AG Perp FRN	6.307.085	0,64	EUR	2.000.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	2.040.426	0,21
USD	3.906.000	UBS Group Funding Switzerland AG Perp FRN	3.672.469	0,37	GBP	4.876.000	Jerrold Finco plc 4.88% 15/01/2026	5.574.162	0,56
		Total de Suiza	22.041.833	2,25	GBP	2.344.000	Ladbrokes Group Finance plc 5.13% 16/09/2022	2.800.522	0,29
REINO UNIDO					GBP	2.166.000	Legal & General Group plc FRN 26/11/2049	2.501.834	0,25
GBP	6.845.000	Barclays Bank plc 5.75% 14/09/2026	8.995.384	0,92	GBP	836.000	Legal & General Group plc FRN 01/11/2050	1.016.763	0,10
EUR	2.300.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	2.102.660	0,21	GBP	7.133.000	Lloyds Banking Group PI Perp FRN	8.415.184	0,86
GBP	3.478.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	3.356.850	0,34	GBP	9.360.000	Lloyds TSB Bank plc 7.63% 22/04/2025	12.499.494	1,28
USD	4.988.000	Bp Capital Markets plc Perp FRN	4.519.338	0,46	GBP	1.100.000	M&G plc FRN 20/10/2051	1.422.717	0,15
EUR	2.968.000	British American Tobacco plc Perp FRN	2.709.040	0,27	GBP	1.020.005	Marston's Issuer plc FRN 15/10/2027	1.121.779	0,11
GBP	403.500	Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	530.918	0,05	GBP	1.440.397	Mitchells & Butlers Finance plc 5.57% 15/12/2030	1.862.409	0,19
EUR	5.038.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	4.563.516	0,47					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
REINO UNIDO (continuación)				REINO UNIDO (continuación)					
GBP	113.990	Mitchells & Butlers Finance plc 5.97% 15/12/2023	137.939	0,01	GBP	2.767.000	Vmed O2 UK Financing 4.00% 31/01/2029	3.002.900	0,31
GBP	2.156.277	Mitchells & Butlers Finance plc 6.01% 15/12/2028	2.686.001	0,27	EUR	2.698.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	2.625.813	0,27
GBP	7.100.000	National Grid plc 3.50% 16/10/2026	8.705.403	0,88	USD	3.500.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	3.247.098	0,33
EUR	5.733.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	5.209.124	0,53	GBP	1.444.000	WM Morrison Supermarkets plc 4.63% 08/12/2023	1.743.207	0,17
EUR	2.223.000	Natwest Group plc FRN 26/02/2030	2.050.919	0,21	GBP	6.766.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	7.372.253	0,75
EUR	1.856.000	NatWest Group plc FRN 14/09/2032	1.704.533	0,17			Total de Reino Unido	245.170.858	24,96
GBP	1.639.000	NatWest Group plc FRN 28/11/2031	1.808.008	0,18	ESTADOS UNIDOS				
GBP	3.355.000	NatWest Group plc FRN 19/09/2026	3.941.078	0,40	USD	4.056.000	AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	3.827.534	0,39
GBP	3.901.000	Natwest Group plc Perp FRN	4.570.296	0,47	USD	2.928.000	Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	2.584.722	0,26
EUR	4.686.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	4.385.133	0,45	USD	2.140.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	2.249.046	0,23
EUR	2.140.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	2.153.792	0,22	EUR	3.336.000	Ardagh Metal Packaging 2.00% 01/09/2028	3.082.899	0,31
GBP	3.864.000	Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	4.509.715	0,47	EUR	719.000	Ardagh Metal Packaging 3.00% 01/09/2029	642.906	0,07
GBP	3.100.000	Santander UK plc Perp 10.06%	6.451.531	0,66	USD	3.073.000	AT&T Inc. 2.55% 01/12/2033	2.453.442	0,25
EUR	3.787.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	3.621.474	0,37	USD	1.375.000	AT&T Inc. 4.30% 15/12/2042	1.249.680	0,13
USD	12.875.000	SSE plc FRN 16/09/2077	11.638.458	1,19	EUR	2.420.000	Bank of America Corp. FRN 24/05/2032	2.250.711	0,23
EUR	2.047.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	2.056.551	0,21	USD	6.417.000	Bank of America Corp. FRN 22/04/2032	5.302.304	0,54
GBP	2.864.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	3.225.839	0,33	EUR	2.453.000	Berkshire Hathaway Finance 1.50% 18/03/2030	2.444.846	0,25
GBP	1.749.615	Telereal Securitisation plc 5.43% 10/12/2031	2.271.098	0,23	EUR	2.845.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	2.670.391	0,27
GBP	5.599.695	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	7.856.899	0,80	EUR	4.300.000	Coty Inc. 4.00% 15/04/2023	4.307.131	0,44
GBP	2.010.256	Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	2.806.653	0,29	EUR	5.214.000	Digital Euro Finco LLC 1.13% 09/04/2028	4.879.797	0,49
GBP	1.940.000	Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	2.217.741	0,23	EUR	1.233.000	Eli Lilly & Company 1.38% 14/09/2061	962.224	0,10
GBP	2.500.000	Thames Water Utilities Finance FRN 13/09/2030	3.001.815	0,31	EUR	3.943.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.00% 03/12/2028	3.761.002	0,38
EUR	3.674.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	3.492.190	0,36	EUR	5.496.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	5.570.801	0,57
GBP	1.320.000	Travis Perkins 4.50% 07/09/2023	1.587.091	0,16	EUR	3.073.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	3.124.382	0,32
GBP	2.071.000	Travis Perkins plc 3.75% 17/02/2026	2.434.484	0,24	USD	1.179.000	Goodman USA Finance Three 3.70% 15/03/2028	1.060.566	0,11
EUR	2.040.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	1.966.829	0,20	EUR	3.763.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/01/2028	3.582.188	0,37
EUR	1.922.000	Vmed O2 UK Financing 3.25% 31/01/2031	1.776.986	0,18	EUR	3.334.000	Iqvia Inc. 2.88% 15/06/2028	3.224.229	0,33

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ALEMANIA					
USD	1.840.000	JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	1.508.778	0,15	GBP	11.400.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.88% 15/09/2026	12.965.035	1,32
USD	4.829.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	3.979.628	0,41	Total de Alemania			12.965.035	1,32
EUR	1.432.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	1.465.313	0,15	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
GBP	5.498.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	6.832.982	0,70	12.965.035				1,32
USD	2.929.000	Lowe's Cos Inc. 3.75% 01/04/2032	2.662.337	0,27	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				
GBP	325.000	MPT Operating Partnership 2.55% 05/12/2023	380.813	0,04	820.491.945				83,64
EUR	1.242.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	1.317.408	0,13	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
EUR	4.000.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	4.356.755	0,45	Bonos				
EUR	640.000	Netflix Inc. 4.63% 15/05/2029	724.326	0,07	AUSTRALIA				
USD	1.330.000	Occidental Petroleum Corp. 5.88% 01/09/2025	1.271.100	0,13	USD	9.082.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	8.383.292	0,86
USD	1.195.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	1.233.772	0,13	USD	3.640.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	3.379.704	0,34
USD	1.230.000	Occidental Petroleum Corp. 8.00% 15/07/2025	1.241.967	0,13	Total de Australia			11.762.996	1,20
USD	775.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	827.027	0,08	BERMUDAS				
USD	1.430.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	1.656.241	0,17	USD	3.251.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	2.988.073	0,30
EUR	1.278.000	Olympus Water USA 5.38% 01/10/2029	1.122.566	0,11	USD	11.721.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	11.001.474	1,13
USD	2.478.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	2.155.198	0,22	Total de Bermudas			13.989.547	1,43
EUR	1.710.000	Prologis Euro Finance LLC 1.00% 08/02/2029	1.622.151	0,17	CANADÁ				
EUR	2.176.000	Scientific Games International Inc. 5.50% 15/02/2026	2.238.560	0,23	USD	2.062.000	Rogers Communications 3.80% 15/03/2032	1.839.391	0,19
EUR	1.095.000	Silgan Holdings Inc. 2.25% 01/06/2028	999.413	0,10	Total de Canadá			1.839.391	0,19
EUR	8.555.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	8.525.058	0,87	DINAMARCA				
EUR	1.375.000	Southern Company FRN 15/09/2081	1.227.524	0,13	USD	2.205.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	1.805.197	0,18
GBP	3.925.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	5.270.130	0,54	Total de Dinamarca			1.805.197	0,18
Total de Estados Unidos		111.849.848	11,42	FRANCIA					
Total de bonos		807.526.910	82,32	USD	6.211.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	5.309.184	0,54	
				USD	3.516.000	Credit Agricole SA Perp FRN	2.871.450	0,29	
				Total de Francia			8.180.634	0,83	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios					
Bonos (continuación)				Fondos					
PAÍSES BAJOS				IRLANDA					
USD	3.856.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	3.556.276	0,36	1.028.076	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	1.216.570	0,13	
		Total de Países Bajos	3.556.276	0,36	10.772	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	9.681	0,00	
ESTADOS UNIDOS				330.540 BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier				32.467.733	3,31
USD	4.470.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	3.779.760	0,39	32.446	Insight Liquidity Funds plc	38.395	0,00	
USD	2.819.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	2.364.029	0,24	Total de Irlanda			33.732.379	3,44
USD	6.619.000	Magallanes Inc. 4.28% 15/03/2032	5.980.903	0,61	Total de fondos			33.732.379	3,44
USD	6.443.000	Magallanes Inc. 5.14% 15/03/2052	5.939.983	0,61	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			33.732.379	3,44
USD	1.160.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	1.303.195	0,13	Valor total de las inversiones			927.040.046	94,51
		Total de Estados Unidos	19.367.870	1,98	(Coste total: 952.520.070 EUR)				
Total de bonos				60.501.911	6,17	* Pequeñas diferencias debido al redondeo.			
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				60.501.911	6,17	** Título a su valor razonable.			
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario									
Bonos									
PORTUGAL									
EUR	17.100.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2099**	1.881.000	0,19					
		Total de Portugal	1.881.000	0,19					
REINO UNIDO									
EUR	2.527.000	BCP V Modular Services Finance II plc 6.75% 30/11/2029	2.305.374	0,24					
GBP	5.119.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	5.868.629	0,60					
GBP	2.009.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	2.258.808	0,23					
		Total de Reino Unido	10.432.811	1,07					
Total de bonos				12.313.811	1,26				
Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				12.313.811	1,26				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
AUSTRALIA				DINAMARCA (continuación)					
EUR	274.000	APT Pipelines Limited 1.25% 15/03/2033	240.924	0,54	EUR	100.000	Danske Bank AS FRN 15/05/2031	94.352	0,21
USD	144.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	132.922	0,30			Total de Dinamarca	528.883	1,18
EUR	100.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	88.139	0,20	FINLANDIA				
EUR	220.000	Ausgrid Finance Pty Limited 1.25% 30/07/2025	219.433	0,49	EUR	243.000	Nordea Bank Abp 0.50% 14/05/2027	234.102	0,52
EUR	228.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd 0.63% 25/08/2030	203.570	0,46	EUR	643.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	596.397	1,34
EUR	196.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	195.919	0,44			Total de Finlandia	830.499	1,86
GBP	210.000	Pacific National Finance Pty Limited 5.00% 19/09/2023	256.331	0,57	FRANCIA				
USD	400.000	SGSP Australia Assets Pty Limited 3.25% 29/07/2026	356.525	0,80	EUR	600.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.25% 29/06/2028	554.300	1,24
		Total de Australia	1.693.763	3,80	GBP	200.000	BNP Paribas SA FRN 24/05/2031	221.871	0,50
BÉLGICA				FRANCIA (continuación)					
EUR	188.000	Anheuser-Busch InBev SA 3.70% 02/04/2040	226.661	0,51	EUR	200.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	173.381	0,39
EUR	300.000	Belfius Bank SA 0.00% 28/08/2026	284.196	0,64	EUR	500.000	Credit Agricole SA 1.00% 03/07/2029	482.365	1,08
EUR	200.000	Belfius Bank SA/ NV 0.13% 08/02/2028	183.911	0,41	EUR	200.000	Electricite de France SA Perp FRN	180.256	0,40
EUR	200.000	Kbc Group NV Perp FRN	197.346	0,44	EUR	141.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	122.087	0,27
		Total de Bélgica	892.114	2,00	EUR	100.000	Holding d'infrastructures de Transport SASU 1.48% 18/01/2031	94.627	0,21
BERMUDAS				FRANCIA (continuación)					
EUR	522.000	Bacardi Limited 2.75% 03/07/2023	534.806	1,19	EUR	144.000	RCI Banque SA 2.00% 11/07/2024	144.838	0,32
		Total de Bermudas	534.806	1,19	EUR	500.000	Sanef SA 1.88% 16/03/2026	502.451	1,14
ISLAS CAIMÁN				FRANCIA (continuación)					
GBP	730.000	Southern Water Services Limited 2.38% 28/05/2028	844.436	1,88			Total de Francia	2.476.176	5,55
USD	210.000	Tencent Holdings Limited 3.24% 03/06/2050	147.738	0,33	ALEMANIA				
GBP	200.000	Thames Water Utilities Cayman Finance Limited 2.38% 03/05/2023	235.628	0,53	EUR	300.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	281.879	0,62
		Total de Islas Caimán	1.227.802	2,74	EUR	400.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	336.534	0,75
DINAMARCA				ALEMANIA (continuación)					
EUR	441.000	Danske Bank AS 0.63% 26/05/2025	434.531	0,97	EUR	200.000	Bayer AG 1.00% 12/01/2036	165.819	0,37
					EUR	298.000	Commerzbank AG 0.50% 04/12/2026	287.077	0,64
					EUR	181.000	Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	178.967	0,40
					EUR	400.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	409.933	0,92
					EUR	200.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	187.208	0,42
					EUR	200.000	Deutsche Bank AG Perp FRN	204.764	0,46
					EUR	400.000	Hamburg Commercial Bank AG 0.38% 09/03/2026	387.022	0,87

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)						
ALEMANIA (continuación)				LUXEMBURGO (continuación)						
EUR	160.000	Volkswagen Financial Services AG 0.13% 12/02/2027	147.086	0,33	EUR	300.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	280.150	0,63	
EUR	250.000	Volkswagen Leasing GmbH 0.38% 20/07/2026	235.257	0,52	GBP	100.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	113.786	0,25	
Total de Alemania		2.821.546	6,30	EUR	456.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	452.639	1,01		
INDIA				EUR	200.000	Grand City Properties SA Perp FRN	178.149	0,40		
USD	334.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	289.496	0,65	EUR	368.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	337.301	0,76	
Total de India		289.496	0,65	Total de Luxemburgo				1.636.033	3,66	
IRLANDA				MÉXICO						
EUR	396.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	387.299	0,87	EUR	125.000	America Movil SAB de CV FRN 06/09/2073	133.007	0,30	
EUR	125.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	123.522	0,28	EUR	200.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 16/04/2026	191.103	0,43	
EUR	290.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	269.319	0,60	Total de México				324.110	0,73
EUR	163.000	Eaton Capital Unlimi 0.58% 08/03/2030	149.696	0,34	PAÍSES BAJOS					
Total de Irlanda		929.836	2,09	EUR	200.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/06/2170	200.000	0,45		
ITALIA				EUR	400.000	Cooperatieve Rabobank UA Perp FRN	403.701	0,90		
EUR	100.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	91.700	0,21	EUR	240.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	221.314	0,50	
EUR	100.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	97.355	0,22	GBP	213.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	314.013	0,70	
EUR	140.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	131.629	0,29	EUR	200.000	ING Groep NV FRN 29/09/2028	185.642	0,42	
EUR	220.000	Banco BPM SpA 2.50% 21/06/2024	224.825	0,50	EUR	200.000	ING Groep NV FRN 16/02/2031	196.679	0,44	
Total de Italia		545.509	1,22	USD	400.000	ING Groep NV Perp FRN	313.899	0,70		
JERSEY - ISLAS DEL CANAL				EUR	100.000	Sagax Euro MTN BV 0.75% 26/01/2028	87.877	0,20		
USD	535.221	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.16% 31/03/2034	444.531	0,99	EUR	287.000	Stedin Holding NV Perp FRN	276.763	0,62	
GBP	124.000	Hastings Group Finance plc 3.00% 24/05/2025	149.431	0,33	EUR	169.000	Tennet Holding BV Perp FRN	169.681	0,38	
EUR	136.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	123.605	0,27	EUR	220.000	Thermo Fisher Scientific Finance BV 1.63% 18/10/2041	198.245	0,45	
Total de Jersey - Islas del Canal		717.567	1,59	EUR	300.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	283.408	0,64		
LUXEMBURGO				EUR	100.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	119.905	0,27		
EUR	300.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	274.008	0,61	EUR	200.000	Volkswagen International Finance NV Perp 4.38%	199.483	0,45	
				Total de Países Bajos				3.170.610	7,12	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
NORUEGA				REINO UNIDO (continuación)					
EUR	325.000	DNB Bank ASA FRN 23/02/2029	296.391	0,66	EUR	233.000	Cadent Finance plc 0.75% 11/03/2032	206.943	0,46
		Total de Noruega	296.391	0,66	GBP	100.000	Co-Operative Bank Finance FRN 06/04/2027	118.335	0,26
ESPAÑA				GBP 130.000 GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022				155.798	0,35
EUR	200.000	Merlin Properties Socimi SA 1.38% 01/06/2030	176.347	0,40	EUR	648.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	687.193	1,54
EUR	100.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	99.709	0,22	EUR	152.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	161.193	0,36
		Total de España	276.056	0,62	GBP	500.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	698.066	1,56
SUECIA				EUR 700.000 HSBC Holdings plc Perp FRN 704.875				1,58	
EUR	358.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	336.028	0,75	USD	380.000	Imperial Brands Finance plc 3.50% 26/07/2026	334.252	0,75
EUR	100.000	Sagax AB 2.00% 17/01/2024	101.105	0,23	GBP	100.000	Imperial Brands Finance plc 5.50% 28/09/2026	128.278	0,29
		Total de Suecia	437.133	0,98	GBP	126.000	Legal & General Group plc FRN 26/11/2049	145.536	0,33
SUIZA				GBP 100.000 Legal & General Group plc FRN 01/11/2050				121.622	0,27
EUR	257.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	231.326	0,52	GBP	767.000	Lloyds Banking Group PI Perp FRN	904.872	2,03
EUR	260.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	211.347	0,47	GBP	250.000	Lloyds TSB Bank plc 7.63% 22/04/2025	333.854	0,75
USD	400.000	Credit Suisse Group AG Perp FRN	373.041	0,84	GBP	47.850	Marston's Issuer plc FRN 15/10/2027	52.625	0,12
EUR	308.000	UBS AG 0.50% 31/03/2031	280.626	0,63	GBP	300.000	National Grid plc 3.50% 16/10/2026	367.834	0,83
USD	200.000	UBS Group AG Perp FRN	181.103	0,41	EUR	500.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	454.311	1,02
USD	200.000	UBS Group Funding Switzerland AG Perp FRN	188.042	0,42	EUR	226.000	Natwest Group plc FRN 26/02/2030	208.506	0,47
		Total de Suiza	1.465.485	3,29	EUR	149.000	NatWest Group plc FRN 14/09/2032	136.840	0,31
REINO UNIDO				GBP 130.000 NatWest Group plc FRN 28/11/2031				143.405	0,32
GBP	149.000	Anglian Water Osprey Financing plc 2.00% 31/07/2028	163.999	0,37	GBP	420.000	Natwest Group plc Perp FRN	492.060	1,10
GBP	225.000	Barclays Bank plc 5.75% 14/09/2026	295.685	0,66	EUR	313.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	292.904	0,66
EUR	100.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	91.420	0,20	GBP	100.000	RI Finance FRN 30/11/2043	124.261	0,28
GBP	300.000	BAT International Finance plc 2.25% 26/06/2028	320.718	0,72	GBP	150.000	Santander UK plc Perp 10.06%	312.171	0,70
USD	279.000	Bp Capital Markets plc Perp FRN	252.786	0,57	USD	940.000	SSE plc FRN 16/09/2077	849.720	1,90
GBP	44.833	Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	58.991	0,13	GBP	88.634	Telereal Securitisation plc 1.37% 10/12/2031	99.685	0,22
GBP	246.000	Bupa Finance plc 5.00% 25/04/2023	299.098	0,67	GBP	100.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	112.634	0,26
GBP	224.000	BUPA Finance plc Perp FRN	224.496	0,50	GBP	137.689	Telereal Securitisation plc 5.43% 10/12/2031	178.728	0,40
EUR	196.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	177.541	0,40	GBP	273.053	Tesco Property Finance 7.62% 13/07/2039	431.508	0,97

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
REINO UNIDO (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
GBP	97.161	Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	135.652	0,30	EUR	134.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	121.252	0,27
EUR	200.000	Thames Water Utilities Finance 0.19% 23/10/2023	198.683	0,45	GBP	295.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	396.099	0,89
EUR	376.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	357.393	0,80			Total de Estados Unidos	5.111.214	11,46
GBP	128.000	Virgin Money UK plc FRN 19/08/2031	142.893	0,32	Total de bonos			37.882.393	84,87
		Total de Reino Unido	11.677.364	26,18	Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
ESTADOS UNIDOS				ALEMANIA					
USD	326.000	AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	307.637	0,69	GBP	600.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.88% 15/09/2026	682.370	1,53
USD	298.000	Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	263.063	0,59			Total de Alemania	682.370	1,53
USD	287.000	AT&T Inc. 2.55% 01/12/2033	229.138	0,51	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
USD	125.000	AT&T Inc. 4.30% 15/12/2042	113.607	0,25				682.370	1,53
USD	150.000	Bank of America Corp. FRN 21/07/2032	119.809	0,27	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				
USD	583.000	Bank of America Corp. FRN 22/04/2032	481.727	1,08				38.564.763	86,40
EUR	160.000	Berkshire Hathaway Finance 1.50% 18/03/2030	159.469	0,36	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
EUR	189.000	Digital Euro Finco LLC 1.13% 09/04/2028	176.886	0,40	Bonos				
EUR	118.000	Eli Lilly & Company 1.38% 14/09/2061	92.086	0,21	AUSTRALIA				
USD	106.000	Goodman USA Finance Three 3.70% 15/03/2028	95.352	0,21	USD	330.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	306.401	0,69
USD	100.000	JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	81.999	0,18			Total de Australia	306.401	0,69
USD	451.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	371.674	0,83	BERMUDAS				
EUR	175.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	179.071	0,40	USD	320.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	294.120	0,66
GBP	368.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	457.355	1,03	USD	333.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	312.558	0,70
USD	255.000	Lowe's Cos Inc. 3.75% 01/04/2032	231.784	0,52			Total de Bermudas	606.678	1,36
EUR	548.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	581.272	1,31	CANADÁ				
EUR	100.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	108.919	0,24	USD	128.000	Rogers Communications 3.80% 15/03/2032	114.181	0,26
EUR	70.000	Petroleos Mexicanos 5.50% 24/02/2025	73.322	0,16			Total de Canadá	114.181	0,26
USD	219.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	190.472	0,43					
EUR	172.000	Prologis Euro Finance LLC 1.00% 08/02/2029	163.164	0,37					
EUR	130.000	Southern Company FRN 15/09/2081	116.057	0,26					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

Estado de la cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)			
Bonos (continuación)			
DINAMARCA			
USD	215.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	176.017 0,39
		Total de Dinamarca	176.017 0,39
FRANCIA			
USD	500.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	427.402 0,96
USD	293.000	Credit Agricole SA Perp FRN	239.288 0,54
		Total de Francia	666.690 1,50
PAÍSES BAJOS			
USD	50.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	46.114 0,10
		Total de Países Bajos	46.114 0,10
ESTADOS UNIDOS			
USD	391.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	330.623 0,74
USD	271.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	227.262 0,51
USD	309.000	Magallanes Inc. 4.28% 15/03/2032	279.212 0,63
USD	300.000	Magallanes Inc. 5.14% 15/03/2052	276.578 0,62
		Total de Estados Unidos	1.113.675 2,50
Total de bonos		3.029.756	6,80
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		3.029.756	6,80
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
178	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	17.525	0,04
Total de Irlanda		17.525	0,04
Total de fondos		17.525	0,04
Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		17.525	0,04
Valor total de las inversiones		41.612.044	93,24
(Coste total: 43.262.237 EUR)			

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BÉLGICA				SUECIA			
74.110	KBC Group NV	4.845.312	3,91	143.484	Epiroc AB	2.797.937	2,26
	Total de Bélgica	4.845.312	3,91	127.870	Sandvik AB	2.478.666	2,00
DINAMARCA				SUIZA			
18.126	Novo Nordisk A/S	1.824.919	1,47	9.205	Lonza Group AG - Reg	6.043.073	4,88
302.104	Tryg A/S	6.670.828	5,39	51.713	Nestle SA - Reg	6.070.713	4,90
	Total de Dinamarca	8.495.747	6,86	78.617	Novartis AG - Reg	6.238.432	5,05
FRANCIA				REINO UNIDO			
40.208	Air Liquide SA	6.389.855	5,17	18.759	Roche Holding AG	6.179.338	4,99
29.267	Compagnie de Saint-Gobain	1.588.320	1,28	373.975	Sika AG	5.631.824	4,55
1.784	Kering	1.027.049	0,83		UBS Group AG	6.627.276	5,35
1.814	Louis Vuitton Moët Hennessy SE	1.178.011	0,95		Total de Suiza	36.790.656	29,72
31.577	Pernod-Ricard SA	6.293.296	5,08	8.584	Linde plc	2.493.652	2,01
101.775	Publicis Groupe SA	5.624.087	4,54		Total de Reino Unido	2.493.652	2,01
3.785	Sanofi	350.150	0,28		Total de renta variable	120.948.668	97,67
8.414	Schneider Electric SE	1.280.274	1,03		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	120.948.668	97,67
17.726	Teleperformance	6.138.513	4,96		Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		
	Total de Francia	29.869.555	24,12		Fondos		
ALEMANIA				IRLANDA			
88.296	Daimler Truck Holding AG	2.227.708	1,80	59	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	5.786	0,00
88.916	Mercedes-Benz Group AG - Reg	5.673.730	4,58		Total de Irlanda	5.786	0,00
33.785	Volkswagen AG Pfd	5.304.245	4,28		Total de fondos	5.786	0,00
	Total de Alemania	13.205.683	10,66		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	5.786	0,00
ITALIA				Valor total de las inversiones			
21.528	Moncler SpA	1.092.331	0,88		120.954.454	97,67	
	Total de Italia	1.092.331	0,88				
PAÍSES BAJOS				(Coste total: 116.684.115 EUR)			
1.773	ASML Holding NV	1.081.530	0,87	<i>* Pequeñas diferencias debido al redondeo.</i>			
312.084	ING Groep NV	2.968.231	2,40				
22.608	Koninklijke DSM NV	3.673.800	2,97				
625.106	Royal KPN NV	1.964.708	1,59				
30.759	Wolters Kluwer NV	2.970.704	2,40				
	Total de Países Bajos	12.658.973	10,23				
NORUEGA							
302.429	DNB Bank ASA	6.220.156	5,02				
	Total de Noruega	6.220.156	5,02				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
CANADÁ				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
1.444	Shopify Inc. - A	976.086	0,78	25.771	Voya Financial Inc.	1.709.906	1,37
	Total de Canadá	976.086	0,78		Total de Estados Unidos	116.898.321	93,37
ISLAS CAIMÁN				Total de renta variable			
26.049	Globalfoundries Inc.	1.625.979	1,30			119.500.386	95,45
	Total de Islas Caimán	1.625.979	1,30		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	119.500.386	95,45
ESTADOS UNIDOS				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
17.522	Agco Corp.	2.558.738	2,04	Fondos			
3.440	Alphabet Inc. - A	9.567.844	7,64	IRLANDA			
45.831	American Electric Power Company Inc.	4.572.559	3,65	3.521.563	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	3.521.563	2,81
11.627	Cirrus Logic Inc.	985.853	0,79		Total de Irlanda	3.521.563	2,81
138.495	Cisco Systems Inc.	7.722.481	6,17		Total de fondos	3.521.563	2,81
5.001	Coca Cola Company	310.062	0,25		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	3.521.563	2,81
16.148	Crowdstrike Holdings Inc. - A	3.666.888	2,93		Valor total de las inversiones	123.021.949	98,26
71.398	CVS Health Corp.	7.226.191	5,78		(Coste total: 114.568.752 USD)		
24.830	Darling International Inc.	1.995.835	1,59				
10.323	Doordash Inc. - A	1.209.752	0,97				
13.761	Doximity Inc.	716.810	0,57				
15.312	Exact Sciences Corp.	1.070.615	0,86				
40.980	Gap Inc.	576.998	0,46				
42.326	General Motors Company	1.851.339	1,48				
5.925	Herc Holdings Inc.	990.008	0,79				
37.291	Hilton Worldwide Holdings Inc.	5.658.536	4,52				
67.019	Konтоor Brands Inc.	2.771.236	2,21				
9.730	Lam Research Corp.	5.230.946	4,17				
63.942	Livent Corp.	1.666.968	1,33				
6.337	Mastercard Inc. - A	2.264.717	1,81				
19.149	Microsoft Corp.	5.903.829	4,71				
10.877	Mirati Therapeutics Inc.	894.307	0,71				
28.359	Ncino Inc.	1.162.152	0,93				
32.820	Northern Trust Corp.	3.821.889	3,05				
174.366	Nov Inc.	3.419.317	2,73				
35.937	Ranpak Holdings Corp.	734.193	0,59				
22.279	Salesforce.com Inc.	4.730.278	3,78				
41.912	Schnitzer Steel Industries Inc.	2.176.909	1,74				
17.121	Starbucks Corp.	1.557.498	1,24				
60.055	State Street Corp.	5.231.992	4,18				
5.584	Svb Financial Group	3.123.969	2,50				
32.212	Teradata Corp.	1.587.729	1,27				
2.815	Teradyne Inc.	332.817	0,27				
27.277	Transunion	2.818.805	2,25				
12.057	Union Pacific Corp.	3.294.093	2,63				
28.164	United Parcel Service Inc.	6.040.051	4,83				
22.011	Vertex Pharmaceuticals Inc.	5.744.211	4,58				

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
ISLAS CAIMÁN				PAÍSES BAJOS			
9.294	Sea Limited	1.113.328	1,12	5.274	Airbus SE	647.605	0,65
	Total de Islas Caimán	1.113.328	1,12	5.286	Koninklijke DSM NV	955.739	0,96
DINAMARCA				Total de Países Bajos			
15.464	Novo Nordisk A/S	1.732.296	1,75			1.603.344	1,61
15.100	Orsted A/S	1.918.065	1,93	NORUEGA			
40.640	Tryg A/S	998.471	1,01	42.384	Equinor ASA	1.605.394	1,62
	Total de Dinamarca	4.648.832	4,69		Total de Noruega	1.605.394	1,62
FINLANDIA				REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
24.583	Upm-Kymmene Oyj	811.268	0,82	61.568	Samsung Electronics Company Limited	3.535.448	3,58
	Total de Finlandia	811.268	0,82	3.129	Samsung Sdi Company Limited	1.538.623	1,55
FRANCIA				Total de República de Corea (Sur)			
6.436	Essilor International SA	1.190.877	1,20			5.074.071	5,13
12.265	Schneider Electric SE	2.076.475	2,09	SUIZA			
	Total de Francia	3.267.352	3,29	3.562	Roche Holding AG	1.418.413	1,43
ALEMANIA				Total de Suiza			
4.303	Adidas AG	1.014.521	1,02			1.418.413	1,43
	Total de Alemania	1.014.521	1,02	TAIWÁN			
INDIA				130.000 Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited			
76.123	HDFC Bank Limited	1.477.106	1,49			2.708.744	2,73
	Total de India	1.477.106	1,49		Total de Taiwán	2.708.744	2,73
INDONESIA				REINO UNIDO			
4.385.549	Bank Rakyat Indonesia	1.423.005	1,44	21.243	Diageo plc	1.080.605	1,09
	Total de Indonesia	1.423.005	1,44	42.853	SSE PLC	986.546	1,00
IRLANDA				Total de Reino Unido			
8.183	CRH plc	330.960	0,33			2.067.151	2,09
23.746	Medtronic Inc.	2.634.619	2,66	ESTADOS UNIDOS			
9.234	Trane Technologies plc	1.410.032	1,42	8.178	Abbott Laboratories	967.948	0,98
	Total de Irlanda	4.375.611	4,41	1.367	Adobe Systems Inc.	622.833	0,63
JAPÓN				1.870	Amazon.com Inc.	6.096.107	6,16
3.500	Keyence Corp.	1.650.875	1,67	3.283	American Tower Corp.	824.755	0,83
8.700	Sony Corp.	912.470	0,92	3.421	Autodesk Inc.	733.291	0,74
12.300	Yaskawa Electric Corp.	487.947	0,49	14.935	Centene Corp.	1.257.378	1,27
	Total de Japón	3.051.292	3,08	20.341	Comcast Corp.	952.366	0,96
				3.400	Cooper Companies Inc.	1.419.806	1,43
				5.763	Deere & Company	2.394.296	2,42
				6.321	Ecolab Inc.	1.116.035	1,13
				9.860	Electronic Arts Inc.	1.247.389	1,26
				4.961	Eli Lilly & Company	1.420.682	1,43
				6.078	Fidelity National Information Services Inc.	610.353	0,62

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

Estado de la cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
----------	-----------	----------------------------	-------------------------------

Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)

Renta variable (continuación)

ESTADOS UNIDOS (continuación)

34.512	General Motors Company	1.509.555	1,52
5.062	IntercontinentalExchange Inc.	668.791	0,67
6.190	Intuit Inc.	2.976.399	2,99
4.359	JPMorgan Chase & Company	594.219	0,60
3.799	Mastercard Inc. - A	1.357.687	1,37
684	Mercadolibre Inc.	813.604	0,82
8.141	NextEra Energy Inc.	689.624	0,70
6.990	Nvidia Corp.	1.907.291	1,92
9.813	Paypal Holdings Inc.	1.134.873	1,15
14.445	Qualcomm Inc.	2.207.485	2,23
1.665	S&P Global Inc.	682.950	0,69
360	Stryker Corp.	96.246	0,10
2.866	Thermo Fisher Scientific Inc.	1.692.803	1,71
31.191	T-Mobile USA Inc.	4.003.365	4,04
1.151	Transunion	118.944	0,12
7.612	Trimble Navigation Limited	549.130	0,55
36.978	Uber Technologies Inc.	1.319.375	1,33
3.989	Union Pacific Corp.	1.089.835	1,10
17.278	Walt Disney Company	2.369.850	2,38
	Total de Estados Unidos	45.445.265	45,85
	Total de renta variable	81.104.697	81,82
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	81.104.697	81,82

Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios

Fondos

IRLANDA

4.651.928	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	4.651.928	4,69
	Total de Irlanda	4.651.928	4,69
	Total de fondos	4.651.928	4,69
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	4.651.928	4,69
	Valor total de las inversiones	85.756.625	86,51

(Coste total: 75.542.479 USD)

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

Estado de la cartera

a 31 de marzo de 2022

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
Instrumentos estructurados - Materias primas			
IRLANDA			
28.231	Invesco Physical Gold ETC 0.00%	5.306.299	0,97
	Total de Irlanda	5.306.299	0,97
Total de Instrumentos estructurados - Materias primas		5.306.299	0,97
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		5.306.299	0,97
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente			
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			
ESTADOS UNIDOS			
USD 17.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 12/04/2022	16.999.448	3,11
USD 39.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 05/05/2022	38.994.677	7,13
USD 78.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 26/05/2022	78.467.454	14,34
USD 80.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 16/06/2022	79.930.583	14,61
USD 80.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 23/06/2022	79.913.424	14,61
USD 80.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 30/06/2022	79.896.960	14,60
USD 80.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 07/07/2022	79.879.616	14,60
USD 50.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 21/07/2022	49.897.410	9,12
	Total de Estados Unidos	503.979.572	92,12
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda		503.979.572	92,12
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		503.979.572	92,12
Valor total de las inversiones		509.285.871	93,09
(Coste total: 508.936.615 USD)			

* Pequeñas diferencias debido al redondeo.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Notas a los estados financieros

1 GENERAL

Threadneedle (Lux) (la «SICAV») es una sociedad de inversión con capital variable (*Société d'Investissement à Capital Variable*) regulada por la Parte I de la Ley del 17 de diciembre de 2010, relativa a los Organismos de inversión colectiva, en su versión modificada.

La SICAV ofrece a los inversores la oportunidad de invertir en subfondos separados (las «Carteras»), cada uno de los cuales tiene un objetivo de inversión diferente y es una cartera separada de activos representados por valores separados. Cada Cartera puede tener una o más clases de acciones (las «Clases de Acciones») relacionadas con ella. La SICAV en su conjunto, incluidas todas las Carteras actuales y todas las Carteras futuras, es una persona jurídica. Sin embargo, con respecto a terceros y, en particular, con respecto a los acreedores de la SICAV y entre Accionistas, cada Cartera será exclusivamente responsable de todos los pasivos que se le atribuyan.

Acontecimientos significativos durante el año:

Nuevos folletos

Se han publicado nuevos folletos en julio y noviembre de 2021.

Reducción de comisiones y gastos

A partir del 1 de septiembre de 2021, las comisiones y los gastos de las Carteras Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend y Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities se han reducido de la siguiente manera:

Cartera y clase	Hasta el 31 de agosto de 2021			Desde el 1 de septiembre de 2021		
	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	IGT	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	IGT
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend - Clase I	0,75%	0,20%	0,95%	0,50%	0,15%	0,65%
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities - Clase Z	0,55%	0,25%	0,80%	0,55%*	0,15%	0,70%

* Sin cambios

A partir del 1 de diciembre de 2021, se ha procedido a reducir las comisiones y los gastos de las siguientes clases de acciones de la Cartera Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities como sigue:

Clase	Hasta el 30 de noviembre de 2021			Desde el 1 de diciembre de 2021		
	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	IGT	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	IGT
A	1,75%	0,30%	2,05%	1,00%	0,25%	1,25%
D	2,25%	0,30%	2,55%	1,25%	0,25%	1,50%
I	0,80%	0,20%	1,00%	0,80%*	0,15%	0,95%
N	0,45%	0,20%	0,65%	0,45%*	0,15%	0,60%
Z	0,75%	0,30%	1,05%	0,75%*	0,25%	1,00%

* Sin cambios

Consulte también la nota 5.

Cierre de cartera

Con efecto a partir del 21 de mayo de 2021, la Cartera Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity está en liquidación y sus Acciones ya no están disponibles para su suscripción. La liquidación se hizo necesaria debido a los controles de divisas en Nigeria que impedían la libre conversión del naira en otras monedas. Se han vendido los activos de renta variable de la Cartera y en julio de 2021 se efectuó a los accionistas un pago inicial de los ingresos procedentes de la venta de los activos totalmente líquidos, que ascendían aproximadamente al 75% del VL de la Cartera. La parte restante de los ingresos procedentes de la renta variable nigeriana se encuentra actualmente en cola a la espera de su conversión a USD. A 31 de marzo de 2022, la Cartera tenía 27 posiciones nigerianas en naira a la espera de su conversión a USD.

Lanzamiento de clases de acciones

Las siguientes clases de acciones se lanzaron durante el ejercicio cerrado a 31 de marzo de 2022:

Clase de Acciones	Cartera	Fecha Efectiva
IEP	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	8 de abril de 2021
ZE	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	11 de noviembre de 2021
ZU	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	11 de noviembre de 2021
ZU	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	11 de noviembre de 2021
ISC	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	29 de julio de 2021
ZU	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	11 de noviembre de 2021
XU	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	17 de marzo de 2022
AE	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	10 de junio de 2021
AEH	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	10 de junio de 2021

Notas a los estados financieros

(continuación)

1 GENERAL

(continuación)

Clase de Acciones	Cartera	Fecha Efectiva
DE	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	10 de junio de 2021
DEH	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	10 de junio de 2021
ZE	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	15 de julio de 2021
XE	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	25 de febrero de 2022
ZE	Threadneedle (Lux) - European Select	14 de octubre de 2021
ZU	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	11 de noviembre de 2021
AE	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	5 de agosto de 2021
IE	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	5 de agosto de 2021

A 31 de marzo de 2022, las Carteras activas de la SICAV son las siguientes:

Las Carteras de bonos:

- Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) - European Social Bond
- Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond
- Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds¹
- Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt
- Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds¹
- Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond¹
- Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Las Carteras de asignación de activos:

- Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Las Carteras de renta variable:

- Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities
- Threadneedle (Lux) - Global Focus¹
- Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities¹
- Threadneedle (Lux) - Global Equity Income
- Threadneedle (Lux) - Global Select
- Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - American¹
- Threadneedle (Lux) - American Select
- Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity¹
- Threadneedle (Lux) - Asia Equities
- Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities
- Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities
- Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities
- Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend
- Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities¹
- Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - European Select
- Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income¹
- Threadneedle (Lux) - Global Technology¹
- Threadneedle (Lux) - UK Equities
- Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

Las Carteras de rendimiento absoluto:

- Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha
- Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

¹ A 31 de marzo de 2022, estas Carteras han sido autorizadas por la Comisión de Valores y Futuros en Hong Kong y están disponibles al público de Hong Kong.

Notas a los estados financieros

(continuación)

1 GENERAL

(continuación)

Las Carteras de Extended Alpha:

- Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha
- Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

La Cartera de especialistas:

- Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

2 RESUMEN DE POLÍTICAS CONTABLES SIGNIFICATIVAS

Los estados financieros se preparan y presentan con arreglo a los principios de contabilidad generalmente aceptados aplicables a los fondos de inversión de OICVM (Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios) en Luxemburgo y requieren que la administración haga estimaciones y supuestos que afecten a los importes declarados en los estados financieros y notas adjuntas. Los resultados reales pueden diferir de estas estimaciones.

Los estados financieros se presentan sobre la base del Valor liquidativo de las Carteras, que se calculan a 31 de marzo de 2022. El último Valor liquidativo oficial de las Carteras correspondientes se calculó el 31 de marzo de 2022.

Los estados financieros se preparan con arreglo a los requisitos legales y reglamentarios de Luxemburgo relativos a los fondos de inversión bajo los criterios de contabilidad de la empresa en funcionamiento, excepto en el caso de la Cartera Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity, que se puso en liquidación el 21 de mayo de 2021. Como tal, los estados financieros de esta Cartera se han preparado sobre una base de empresa no consolidada, y cualquier gasto adicional respecto al cierre de esta Cartera correrá a cargo de la Sociedad Gestora.

I) Valoración de valores

Los valores mobiliarios, los instrumentos del mercado monetario y cualquier activo financiero cotizado o negociado en un mercado regulado se valoran a su último precio de cambio en el mercado correspondiente en el momento del cierre del mercado. Si dichos precios no son representativos de su valor razonable de mercado, dichos valores se expresan según el valor razonable al que se espera que puedan revenderse, según lo determine de buena fe el Consejo de Administración o bajo su dirección.

Los valores de renta fija que no se negocian en dichos mercados se valoran al último precio disponible o rendimiento equivalente obtenido de uno o más distribuidores o servicios de fijación de precios aprobados por el Consejo de Administración, o cualquier otro precio que el Consejo de Administración considere apropiado.

Los Instrumentos del mercado monetario (u otros instrumentos en línea con la convención de mercado en la jurisdicción en la que se mantiene el instrumento) con un vencimiento restante de 90 días o menos se valorarán según el método de coste amortizado, que se aproxima al valor de mercado. Bajo este método de valoración, las inversiones de la Cartera correspondiente se valoran a su coste de adquisición o al último valor de mercado antes del periodo de 90 días (en caso de que un instrumento tuviera, en la fecha de compra original, más de 90 días hasta el vencimiento) y se ajustan para la amortización de la prima o acumulación de descuento en lugar de al valor de mercado.

Las participaciones o acciones de organismos de inversión colectiva («OIC») abiertos se valoran a su último valor liquidativo determinado y disponible (el «Valor liquidativo») o, si dicho precio no es representativo del valor razonable de mercado de tales activos, entonces será la SICAV quien determine el precio, de manera justa y equitativa. Las participaciones o acciones de OIC cerrados se valoran a su último valor de mercado de valores disponible.

Los consejeros de la SICAV (los «Consejeros»), a su discreción, pueden permitir el uso de algún otro método de valoración si consideran que dicha valoración refleja mejor el valor razonable de cualquier activo de la SICAV.

II) Contratos de divisas a plazo

Con el fin de realizar operaciones de cobertura del riesgo de divisa específico o invertir en otras divisas, la SICAV podrá celebrar contratos de divisas a plazo. Al final del año, los contratos abiertos de divisas a plazo se valoran a los tipos a plazo aplicables para el periodo restante hasta el vencimiento. El movimiento neto en la ganancia/(pérdida) no realizada que surge de los contratos de divisas a plazo se registra en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto. Los contratos vigentes a 31 de marzo de 2022 figuran en la Nota 9.

III) Contratos de futuros

La SICAV podrá celebrar contratos de futuros. Los contratos de futuros abiertos se valoran a los precios del mercado de valores para el cual se negocian los contratos. El movimiento neto en la ganancia/(pérdida) no realizada que surge de los contratos de futuros se registra en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto. Los contratos vigentes a 31 de marzo de 2022 figuran en la Nota 11.

IV) Swaps

La SICAV podrá participar en Swaps de tipos de interés («IRS», por sus siglas en inglés), Swaps de incumplimiento crediticio («CDS», por sus siglas en inglés) y Swaps de rentabilidad total («SRT»). Los IRS se valoran sobre la base de su valor de mercado establecido por referencia a la curva del tipo de interés aplicable. Los CDS se valoran por referencia al valor presente neto de los flujos de efectivo futuros esperados según los tipos de interés del mercado y la tasa de incumplimiento y recuperación esperada del mercado del activo subyacente. Un pago por adelantado, si lo hubiera, realizado por la SICAV se registra como

Notas a los estados financieros

(continuación)

2 RESUMEN DE POLÍTICAS CONTABLES SIGNIFICATIVAS

(continuación)

un activo en el Estado del patrimonio neto. Un pago por adelantado, si lo hubiera, recibido por la SICAV se registra como un pasivo en el Estado del patrimonio neto. Los SRT se valoran por referencia al valor de mercado en función del valor de mercado del activo subyacente. El movimiento neto en la ganancia o pérdida no realizada que surge de los swaps se registra en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto. Los contratos vigentes a 31 de marzo de 2022 figuran en la Nota 10. Los dividendos por pagar en swaps de posiciones cortas, si existen, se registran como un pasivo en el Estado del patrimonio neto.

V) Opciones

Las opciones negociadas en un mercado regulado se valoran al precio de mercado en la fecha de valoración. Dichas opciones abiertas a 31 de marzo de 2022 se muestran en el Programa de inversiones. Las opciones de venta libre («OTC», por sus siglas en inglés) se valoran según los precios recibidos de los agentes o los modelos de precios de terceros. Dichas opciones abiertas a 31 de marzo de 2022 se muestran en la Nota 12. Las ganancias o pérdidas no realizadas que surgen en el momento de la presentación del informe de la valoración de las transacciones de opciones se tienen en cuenta en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto.

VI) Conversión de divisas

Las cuentas de cada Cartera se mantienen en la divisa en que se expresa su patrimonio neto. El Estado del patrimonio neto, el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto y el Programa de inversiones correspondientes se expresan en esta divisa (la «divisa base»).

Durante el año, las transacciones, los ingresos y los gastos denominados en una divisa distinta de la divisa base se registran sobre la base de los tipos de cambio vigentes en la fecha en que ocurren o se acumulan en la Cartera.

En la fecha del Estado del patrimonio neto, los activos y pasivos monetarios denominados en una divisa distinta de la divisa base se convierten a la divisa base en función de los tipos de cambio vigentes en esa fecha. Las diferencias de cambio se incluyen en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto.

El Estado consolidado del patrimonio neto y el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto se presentan en USD en función de los tipos de cambio vigentes en la fecha del Estado del patrimonio neto. Los tipos de cambio utilizados a 31 de marzo de 2022 son: 1 USD = 1,331647 AUD, 1 USD = 0,898755 EUR, 1 USD = 0,759503 GBP, 1 USD = 0,920250 CHF, 1 USD = 9,319404 SEK, 1 USD = 6,685341 DKK, 1 USD = 8,744010 NOK, 1 USD = 7,831406 HKD y 1 USD = 1,353350 SGD.

La diferencia entre el patrimonio neto de apertura declarado a los tipos de cambio vigentes al inicio del año y su valor al final del año se muestra como un ajuste de conversión de divisa en el Estado consolidado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto bajo el epígrafe «Diferencias de cambio».

VII) Efectivo en el banco

El efectivo en el banco reflejado en los estados del patrimonio neto incluye también los márgenes sobre los contratos de futuros y las garantías en efectivo pagadas por las Carteras respecto a las operaciones de swaps y los contratos de divisas a plazo.

El efectivo y los márgenes sobre los contratos de futuros se valoran a precio de coste, que se aproxima al valor de mercado.

VIII) Depósitos a plazo

Los depósitos a plazo se valoran a precio de coste, que se aproxima al valor de mercado.

IX) Transacciones de inversión e ingresos por inversiones

Los valores se registran a precio de coste y, cuando corresponda, en función de los tipos de cambio vigentes en la fecha de compra.

Los resultados sobre las ventas de valores se determinan en función del método del coste promedio. Las transacciones de inversión se contabilizan en la fecha de transacción. Los dividendos se contabilizan en la fecha ex-dividendo. Los ingresos por intereses se registran en valores devengados. Los descuentos o primas en bonos con cupón cero se acumulan como ajustes a los ingresos por intereses.

Los intereses, dividendos y ganancias de capital en valores podrán estar sujetos a retenciones o impuestos a las ganancias de capital en ciertos países.

X) Política de distribución

La política de la SICAV con respecto a todas las Clases de Acciones de Carteras, con excepción de las Clases cuya denominación termina en «C», «M», «P» o «T», es no hacer distribuciones, acumular en dichas Carteras todas las ganancias netas y reinvertirlas dentro de la misma Cartera y Clase. Con respecto a las Clases cuya denominación termina en «C», «M», «P» o «T», la SICAV pretende hacer distribuciones con una frecuencia, al menos, anual y en una cantidad que determinarán los Consejeros. Los Accionistas de estas Clases de Acciones tienen la opción de recibir el dividendo o reinvertirlo en la misma Clase de Acciones.

XI) Reembolsos de comisiones de gestión de activos

Las inversiones cruzadas y las inversiones en otros fondos de Columbia Threadneedle se realizan en clases de acciones sin pago de comisiones; de lo contrario, cualquier comisión de gestión pagada se reembolsa por completo. Consulte también la Nota 18 para obtener detalles sobre las inversiones cruzadas.

Notas a los estados financieros

(continuación)

3 TRIBUTACIÓN

De acuerdo con las leyes y prácticas actuales, la SICAV no está sujeta a ningún impuesto sobre la renta de Luxemburgo ni a las ganancias de capital de Luxemburgo sobre la apreciación del capital realizada de los activos de la SICAV, ni los dividendos pagados por la SICAV están sujetos a ningún impuesto de retención de Luxemburgo.

De conformidad con la legislación y los reglamentos vigentes, la SICAV está sujeta en el Gran Ducado de Luxemburgo a un impuesto de suscripción anual («*taxe d'abonnement*») del 0,05%, pagadero trimestralmente y evaluado sobre su Valor liquidativo al final de cada trimestre. No se adeudan impuestos sobre los activos mantenidos por la SICAV en otros OICVM ya sujetos a ese impuesto en Luxemburgo.

Con respecto a las Clases de Acciones Institucionales, se aplica un impuesto de suscripción anual reducido del 0,01% sobre el Valor liquidativo el último día de cada trimestre con arreglo a la Ley del 17 de diciembre de 2010, en su versión modificada.

Además, aquellas carteras cuyo único objeto es la inversión colectiva en instrumentos del mercado monetario y la colocación de depósitos en entidades de crédito también están sujetas a un impuesto reducido del 0,01%. Nuevamente, no se adeuda dicho impuesto sobre la parte de los activos de la SICAV invertidos en otros OICVM de Luxemburgo, si los hubiere.

Para evitar dudas, dicha *taxe d'abonnement* forma parte de los Gastos operativos de la SICAV.

Si bien las ganancias de capital realizadas de la SICAV no están sujetas a impuestos en Luxemburgo, ya sea a corto o largo plazo, estas ganancias de capital realizadas podrán estar sujetas a impuestos en los países de origen.

4 COMISIONES VARIAS

Las comisiones varias se componen principalmente de comisiones de impuestos italianos.

5 OPERACIONES VINCULADAS

La SICAV puede, en nombre de las diferentes Carteras, suscribir acuerdos de empréstito (sujetos a las restricciones establecidas en «Restricciones de inversión» en el Apéndice A del Folleto) con, y comprar o vender valores mobiliarios, divisas u otros instrumentos financieros a través de Threadneedle Asset Management Limited («TAML»), una entidad relacionada y sus filiales, siempre que dichas operaciones se realicen en condiciones comerciales normales y sean en el mejor interés de la Cartera correspondiente y sus Accionistas.

Para el ejercicio que finaliza el 31 de marzo de 2022, la SICAV no realizó transacciones con personas relacionadas.

La SICAV ha nombrado a Threadneedle Management Luxembourg S.A. (la «Sociedad Gestora») para que actúe como su Sociedad Gestora designada con arreglo al Capítulo 15 de la Ley del 17 de diciembre de 2010, en su versión modificada. En virtud del Acuerdo de Servicios de la Sociedad Gestora, la Sociedad Gestora proporciona servicios de gestión de inversiones, administrativos y de comercialización a la SICAV, sujetos a la supervisión y el control generales del Consejo de Administración.

Ni la Sociedad Gestora ni TAML obtuvieron comisiones relacionadas con operaciones de corretaje.

Algunos directivos y/o consejeros de la Sociedad Gestora, la SICAV y otras entidades del Grupo Columbia Threadneedle también son directivos y/o consejeros de TAML.

La Sociedad Gestora (en nombre de la SICAV) ha delegado ciertas funciones de comercialización y/o distribución a otras entidades del Grupo Columbia Threadneedle. La Sociedad Gestora recibe una comisión mensual por los servicios de gestión de activos a una tasa anual que se detalla en esta nota, expresada como porcentaje del patrimonio neto diario promedio de cada una de las Carteras. La Sociedad Gestora es responsable de pagar las comisiones de subdistribución de esta comisión. Algunos de los subasesores son entidades relacionadas.

Como se describe en la Nota 8, la Sociedad Gestora también puede recibir comisiones de rendimiento con respecto a todas las Acciones A, D, I y Z de la Cartera Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha, con respecto a todas las Acciones J e Y de la Cartera Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities y con respecto a todas las Acciones A, D, I, L y Z de la Cartera Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha.

Todos los gastos incurridos en el funcionamiento de la SICAV y definidos a continuación (en adelante, «Gastos operativos», «Comisión de gestión de activos» o «Cargos de Cartera»; y conjuntamente, los «Gastos») se fijan a las tasas mostradas en las tablas de la página 241 en adelante. Todos los gastos se acumulan diariamente en función del Valor liquidativo de la Clase de Acciones correspondiente en la Cartera correspondiente.

Los Gastos operativos incluyen, entre otras cosas, impuestos, gastos por servicios legales y de auditoría, costes de impresión de apoderamientos, certificados de acciones, informes y avisos para los Accionistas, Folletos y Datos fundamentales para el inversor y otros gastos promocionales; comisiones y cargos del Depositario y sus corresponsales, y del Agente domiciliario, Agente administrativo, Secretario y Agente de transferencia y de cualquier agente de pagos; gastos de emisión y reembolso de Acciones, comisiones de registro y gastos en diversas jurisdicciones, comisiones de cotización, comisiones de consejeros no afiliados de la SICAV, gastos de los Consejeros y directivos de la SICAV y de los Subasesores relacionados con la asistencia a las juntas de los Consejeros y de los Accionistas de la SICAV, costes de traducción, costes de contabilidad y fijación de precios (incluido el cálculo del Valor liquidativo por Acción), seguros, litigios y otros gastos extraordinarios o no recurrentes, y todos los demás gastos pagaderos debidamente por la SICAV. Los Gastos operativos también incluyen la comisión de servicio pagadera a la Sociedad Gestora. La Sociedad Gestora soportará el exceso de cualquier Gasto operativo por encima de la tasa anual. En cambio, la Sociedad Gestora tendrá derecho a retener cualquier cantidad en la cual la tasa anual de Gastos operativos exceda los gastos reales incurridos por la SICAV.

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

Además, la Sociedad Gestora tiene derecho a recibir una comisión de gestión de activos (la «Comisión de gestión de activos») tal como se describe más detalladamente en las tablas de la página 241 en adelante que se acumulan diariamente y se pagan mensualmente. Las Acciones X y las Acciones 4 están exentas del pago de una Comisión de gestión de activos. Para evitar dudas, los Gastos operativos no incluyen las Comisiones de gestión de activos ni las comisiones de rendimiento, que son independientes y distintas.

La SICAV ofrece Acciones B en la Cartera Threadneedle (Lux) - Global Technology.

Esas Acciones B son una Clase de Acciones heredada disponible solo para su suscripción posterior por los Accionistas actuales y no tienen coste de venta inicial.

ACCIONES A:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Carteras de bonos	Máximo 3,0%	Máximo 0,75%
Carteras de renta variable y Carteras de asignación de activos	Máximo 5,0%	Máximo 0,75%
Carteras de rendimiento absoluto	Máximo 5,0%	Máximo 0,75%
Carteras de Extended Alpha	Máximo 5,0%	Máximo 0,75%
Cartera de especialistas	Máximo 5,0%	Máximo 0,75%

Los costes de venta son los máximos, a los que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,60%	0,25%	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,90%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	1,25%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,75%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,40%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,90%	0,25%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,35%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,35%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,30%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	1,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,90%	0,25%	USD
Carteras de asignación de activos				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	1,25%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	1,35%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	1,25%	0,30%	USD
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	1,50%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	1,50%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,55%	0,15%	USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de renta variable				
<i>(continuación)</i>				
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,30%	0,25%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,50%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	1,50%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,50%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	1,65%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	1,50%	0,30%	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	1,50%	0,30%	GBP
Carteras de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	1,00%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,90%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	1,50%	0,35%	EUR
Carteras de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	1,50%	0,30%	USD
Cartera de especialistas				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	1,00% ¹	0,25% ²	USD

ACCIONES B:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	N/D	Cero

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Cartera de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	2,00%	0,35%	USD

ACCIONES D:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	Máximo 1,00%	Máximo 0,75%

Los costes de venta son los máximos, a los que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	1,35%	0,25%	USD
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	1,45%	0,25%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,45%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,45%	0,30%	USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
<i>(continuación)</i>				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,45%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	1,45%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	1,20%	0,25%	USD
Carteras de asignación de activos				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	2,00%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	2,00%	0,30%	USD
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	2,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	2,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	2,00%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	1,85%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	2,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	2,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	2,00%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,75%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,50%	0,25%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,85%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	2,40%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	2,00%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	2,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	2,25%	0,35%	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	2,25%	0,30%	GBP
Carteras de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	1,45%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	2,00%	0,35%	EUR
Carteras de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	2,00%	0,30%	USD
Cartera de especialistas				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	1,25% ³	0,25% ²	USD

ACCIONES I:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	N/D	Máximo 0,75%

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,50%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,40%	0,20%	EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
<i>(continuación)</i>				
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,65%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,40%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,40%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,65%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,65%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,65%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,55%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,40%	0,15%	USD
Carteras de asignación de activos				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,65%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	0,75%	0,20%	USD
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	0,65%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	0,70%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,80%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,80%	0,25%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,25%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,65%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,50% ⁴	0,15% ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,85%	0,25%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	0,85%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,65%	0,20%	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,65%	0,20%	GBP
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*	1,25%	0,35%	USD
Carteras de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,35%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,75%	0,20%	EUR
Carteras de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75%	0,15%	USD
Cartera de especialistas				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,80%	0,15% ⁶	USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

ACCIONES J:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	N/D	Máximo 0,75%

También se pagará una comisión de rendimiento para las Acciones J, según se describe en la sección titulada «Comisión de rendimiento» en el texto principal del Folleto.

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Cartera de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,25%	0,20%	EUR

ACCIONES L:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	N/D	Máximo 0,75%

Los costes de venta son los máximos, a los que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Cartera de bonos				
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30%	0,10%	EUR
Cartera de asignación de activos				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,50%	0,20%	EUR
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	0,35%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,50%	0,20%	GBP
Carteras de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,20%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,375%	0,20%	EUR

ACCIONES N:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	N/D	0,75%

Los costes de venta son los máximos, a los que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,30%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30%	0,10%	EUR
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,55%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,10%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,60%	0,08%	GBP

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Cartera de especialistas				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,45%	0,15% ⁶	USD

ACCIONES S:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	Máximo 5,0%	Máximo 0,75%

Los costes de venta son los máximos, a los que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Cartera de bonos				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,50%	0,30%	USD

ACCIONES T:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	5,00%	0,75%

Los costes de venta son los máximos, a los que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Cartera de bonos				
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,55%	0,10%	USD
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,90%	0,19%	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,60%	0,12%	GBP

ACCIONES W:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	Máximo 5,0%	Máximo 0,75%

Los costes de venta son los máximos, a los que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,00%	0,30%	USD
Cartera de asignación de activos				
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	1,40%	0,35%	USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,40%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,15%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,40%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,40%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	1,55%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	1,65%	0,35%	USD

ACCIONES X:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	N/D	Máximo 0,75%

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos			
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,15%	USD
Carteras de renta variable			
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,15%	USD
Carteras de rendimiento absoluto			
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,15%	EUR
Cartera de especialistas			
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,15%	USD

ACCIONES Y:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	5,00%	Máximo 0,75%

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

Los costes de venta son los máximos, a los que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Cartera de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,35%	0,25%	EUR

ACCIONES Z:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	5,00%	Máximo 0,75%

Los costes de venta son los máximos, a los que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,40%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,40%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,40%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,40%	0,25%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,60%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,60%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,60%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,60%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,40%	0,25%	USD
Carteras de asignación de activos				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,75%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	0,75%	0,25%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	0,75%	0,30%	USD
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	0,75%	0,25%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,75%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,30%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,75%	0,25%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,75%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,75%	0,30%	USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de renta variable				
<i>(continuación)</i>				
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	0,85%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75%	0,30%	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75%	0,30%	GBP
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*	1,25%	0,35%	USD
Carteras de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,55%	0,15% ⁷	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,45%	0,25%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,75%	0,30%	EUR
Carteras de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75%	0,30%	USD
Cartera de especialistas				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,75%	0,25% ²	USD

ACCIONES 1:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	Máximo 5,0%	N/D

Los costes de venta son los máximos, a los que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	1,00%	0,19%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	1,20%	0,18%	EUR
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,50%	0,21%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,50%	0,18%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	1,50%	0,18%	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,50%	0,17%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,50%	0,17%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,50%	0,18%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,50%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,30%	0,23%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,50%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	1,50%	0,22%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,50%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	1,50%	0,22%	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	1,50%	0,14%	GBP
Cartera de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	1,00%	0,17%	EUR
Carteras de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	1,50%	0,19%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	1,50%	0,19%	USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

ACCIONES 2:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	N/D	N/D

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50%	0,08%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,75%	0,07%	EUR
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,00%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,00%	0,07%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	1,00%	0,07%	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,00%	0,06%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,00%	0,06%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,00%	0,07%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,00%	0,09%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,00%	0,08%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,00%	0,09%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	1,00%	0,07%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,00%	0,06%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	1,00%	0,07%	EUR
Cartera de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50%	0,06%	EUR
Carteras de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75%	0,08%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75%	0,08%	USD

ACCIONES 3:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	Máximo 3,0%	N/D

Los costes de venta son los máximos, a los que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50%	0,19%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60%	0,17%	EUR
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75%	0,18%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - American	0,75%	0,13%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75%	0,12%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75%	0,18%	USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de renta variable				
<i>(continuación)</i>				
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,75%	0,19%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75%	0,16%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75%	0,13%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75%	0,18%	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75%	0,12%	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75%	0,13%	GBP
Cartera de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75%	0,19%	USD

ACCIONES 4:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	N/D	N/D

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos			
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,08%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,07%	EUR
Carteras de renta variable			
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,08%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,09%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,07%	EUR
Cartera de rendimiento absoluto			
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,06%	EUR

ACCIONES 8:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	N/D	N/D

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50%	0,12%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,75%	0,11%	EUR
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,00%	0,14%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,00%	0,11%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	1,00%	0,11%	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,00%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,00%	0,10%	USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de renta variable				
<i>(continuación)</i>				
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,00%	0,11%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,00%	0,13%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,00%	0,12%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,00%	0,13%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	1,00%	0,11%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,00%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	1,00%	0,11%	EUR
Cartera de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50%	0,10%	EUR
Carteras de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75%	0,12%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75%	0,12%	USD

ACCIONES 9:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	N/D	N/D

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60%	0,13%	EUR
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75%	0,14%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75%	0,11%	USD
	Threadneedle (Lux) - American	0,75%	0,09%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75%	0,08%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75%	0,14%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75%	0,16%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,75%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75%	0,16%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75%	0,12%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75%	0,09%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75%	0,14%	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75%	0,08%	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75%	0,09%	GBP
Cartera de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75%	0,15%	USD

* Consulte la nota 1.

¹ El 1,75% hasta el 30 de noviembre de 2021.² El 0,30% hasta el 30 de noviembre de 2021.³ El 2,25% hasta el 30 de noviembre de 2021.⁴ El 0,75% hasta el 31 de agosto de 2021.⁵ El 0,20% hasta el 31 de agosto de 2021.⁶ El 0,20% hasta el 30 de noviembre de 2021.⁷ El 0,25% hasta el 31 de agosto de 2021.

Notas a los estados financieros

(continuación)

6 ACUERDOS DE REPARTO DE COMISIONES

La Sociedad Gestora y algunos Subasesores podrán celebrar acuerdos de reparto de comisiones con corredores de bolsa/agentes en virtud de los cuales determinados servicios comerciales se obtengan directamente de dichos corredores de bolsa/agentes o de terceros y se abonen por parte de los corredores de bolsa/agentes con cargo a las comisiones que ellos mismos perciban en concepto de operaciones para la SICAV. En consonancia con la obtención de la mejor ejecución, la Sociedad Gestora o cada uno de los Subasesores pertinentes podrán asignar específicamente las comisiones de corretaje sobre las operaciones de cartera de la SICAV a los corredores de bolsa/agentes en consideración de los servicios de investigación prestados, así como de los servicios prestados en la ejecución de órdenes por parte de dichos corredores de bolsa/agentes. En la sección «Acuerdos de asesoramiento de inversiones» del Folleto se detalla la información adicional sobre las prácticas de cada Subasesor con respecto a los acuerdos de reparto de comisiones.

Cualquier acuerdo de reparto de comisiones suscrito por la Sociedad Gestora o un Subasesor operará bajo las siguientes condiciones: (i) la Sociedad Gestora o el Subasesor actuarán en todo momento en interés de la SICAV y de sus Accionistas cuando celebren acuerdos de reparto de comisiones; (ii) los servicios prestados estarán directamente relacionados con las actividades de la Sociedad Gestora o del Subasesor; (iii) la Sociedad Gestora o el Subasesor asignarán las comisiones de corretaje sobre las operaciones de cartera de la SICAV a los corredores de bolsa/agentes que sean entidades y no a personas físicas; (iv) los acuerdos de reparto de comisiones no serán un factor determinante en la selección de los corredores de bolsa/agentes; (v) la Sociedad Gestora o el Subasesor presentarán informes a los Consejeros con respecto a los acuerdos de reparto de comisiones, incluida la naturaleza de los servicios; (vi) ni la Sociedad Gestora, ni el Subasesor ni ninguna de las personas vinculadas a ellos podrán retener reembolsos en efectivo o de otro tipo por parte de los corredores de bolsa/agentes; (vii) los bienes o servicios recibidos serán de beneficio demostrable para los Accionistas; y (viii) la divulgación periódica se hará en el informe anual de la SICAV en forma de declaración en la que se describa cualquier acuerdo de reparto de comisiones, incluida una descripción de los bienes o servicios recibidos. Los bienes y servicios recibidos pueden incluir: investigación que pueda agregar valor al proceso de toma de decisiones de un Subasesor y servicios de ejecución que mejoren la capacidad del Subasesor para ejecutar transacciones.

Solo los Subasesores Columbia Management Investment Advisors, LLC y STANLIB Asset Management (Pty) Limited pueden celebrar acuerdos de reparto de comisiones.

7 DIVIDENDOS

La SICAV declaró los siguientes dividendos durante el ejercicio cerrado a 31 de marzo de 2022:

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Clase AEC	24/06/2021	EUR	0,065	119.718
	Clase AEC	24/09/2021	EUR	0,066	119.934
	Clase AEC	22/12/2021	EUR	0,060	102.796
	Clase AEC	25/03/2022	EUR	0,070	113.307
	Clase AUP	24/06/2021	USD	0,070	6.531
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,073	8.164
	Clase AUP	22/12/2021	USD	0,067	6.767
	Clase AUP	25/03/2022	USD	0,077	9.151
	Clase DEC	24/06/2021	EUR	0,060	7.214
	Clase DEC	24/09/2021	EUR	0,059	7.004
	Clase DEC	22/12/2021	EUR	0,054	4.844
	Clase DEC	25/03/2022	EUR	0,063	5.408
	Clase DUP	24/06/2021	USD	0,068	3.960
	Clase DUP	24/09/2021	USD	0,067	3.659
	Clase DUP	22/12/2021	USD	0,059	3.479
	Clase DUP	25/03/2022	USD	0,069	4.710
	Clase IEC	24/06/2021	EUR	0,063	153.279
	Clase IEC	24/09/2021	EUR	0,062	156.909
	Clase IEC	22/12/2021	EUR	0,059	90.148
	Clase IEC	25/03/2022	EUR	0,068	47.389
Clase IEP	24/06/2021	EUR	0,065	8	
Clase IEP	24/09/2021	EUR	0,065	6	
Clase IEP	22/12/2021	EUR	0,063	5	
Clase IEP	25/03/2022	EUR	0,074	6	
Clase IGC	24/06/2021	GBP	0,062	18.371	
Clase IGC	24/09/2021	GBP	0,065	16.923	
Clase IGC	22/12/2021	GBP	0,060	85	
Clase IGC	25/03/2022	GBP	0,070	99	
Clase IUP	24/06/2021	USD	0,067	14.801	
Clase IUP	24/09/2021	USD	0,068	36.735	

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond <i>(continuación)</i>	Clase IUP	22/12/2021	USD	0,062	33.495
	Clase IUP	25/03/2022	USD	0,072	41.642
	Clase NEC	24/06/2021	EUR	0,064	14.293
	Clase NEC	24/09/2021	EUR	0,064	14.117
	Clase NEC	22/12/2021	EUR	0,059	13.707
	Clase NEC	25/03/2022	EUR	0,068	15.500
	Clase NGC	24/06/2021	GBP	0,061	868.875
	Clase NGC	24/09/2021	GBP	0,064	969.086
	Clase NGC	22/12/2021	GBP	0,058	901.166
	Clase NGC	25/03/2022	GBP	0,068	1.068.893
	Clase NUP	24/06/2021	USD	0,067	5.904
	Clase NUP	24/09/2021	USD	0,067	5.688
	Clase NUP	22/12/2021	USD	0,063	5.651
	Clase NUP	25/03/2022	USD	0,072	6.459
					5.025.886 USD
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	Clase IEP	24/06/2021	EUR	0,028	3
	Clase IEP	24/09/2021	EUR	0,037	3
	Clase IEP	22/12/2021	EUR	0,033	3
	Clase IEP	25/03/2022	EUR	0,036	3
					12 EUR
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	Clase IEP	25/03/2022	EUR	0,368	2.032.159
	Clase ZEP	25/03/2022	EUR	0,367	173.646
	Clase 1EP	25/03/2022	EUR	0,365	465.536
	Clase 1GP	25/03/2022	GBP	0,337	1.782
	Clase 1UT	26/04/2021	USD	0,031	5.579
	Clase 1UT	21/05/2021	USD	0,025	5.803
	Clase 1UT	24/06/2021	USD	0,034	8.101
	Clase 1UT	26/07/2021	USD	0,032	7.832
	Clase 1UT	24/08/2021	USD	0,032	7.849
	Clase 1UT	24/09/2021	USD	0,031	7.598
	Clase 1UT	25/10/2021	USD	0,030	7.418
	Clase 1UT	23/11/2021	USD	0,031	7.938
	Clase 1UT	22/12/2021	USD	0,030	7.671
	Clase 1UT	25/01/2022	USD	0,035	8.912
	Clase 1UT	22/02/2022	USD	0,029	7.367
	Clase 1UT	25/03/2022	USD	0,033	8.633
	Clase 2EP	25/03/2022	EUR	0,365	31
	Clase 2GP	25/03/2022	GBP	0,339	30
	Clase 3EP	25/03/2022	EUR	0,372	854.656
	Clase 3FC	25/03/2022	CHF	0,350	4.501
	Clase 3GP	25/03/2022	GBP	0,341	45.078
	Clase 8EP	25/03/2022	EUR	0,370	2.055.542
	Clase 8GP	25/03/2022	GBP	0,359	2.159
	Clase 9EP	25/03/2022	EUR	0,373	2.825
	Clase 9FC	25/03/2022	CHF	0,348	31
	Clase 9GP	25/03/2022	GBP	0,339	30
					5.728.707 EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	Clase AEP	25/03/2022	EUR	3,605	604
	Clase IEP	25/03/2022	EUR	3,577	299.956
	Clase IGC	25/03/2022	GBP	3,510	34
	Clase XGC	25/03/2022	GBP	3,658	313.455
					614.049 EUR
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	Clase AEP	24/06/2021	EUR	0,026	78
	Clase AEP	24/09/2021	EUR	0,026	1.170
	Clase AEP	22/12/2021	EUR	0,026	1.170
	Clase AEP	25/03/2022	EUR	0,027	1.215
	Clase ASC	24/06/2021	SGD	0,026	2
	Clase ASC	24/09/2021	SGD	0,026	2
	Clase ASC	22/12/2021	SGD	0,027	2
	Clase ASC	25/03/2022	SGD	0,029	2
	Clase AUC	24/06/2021	USD	0,028	2
	Clase AUC	24/09/2021	USD	0,029	2
	Clase AUC	22/12/2021	USD	0,027	2
	Clase AUC	25/03/2022	USD	0,028	3
	Clase IEP	24/06/2021	EUR	0,026	81.999
	Clase IEP	24/09/2021	EUR	0,026	85.835
	Clase IEP	22/12/2021	EUR	0,029	86.501
	Clase IEP	25/03/2022	EUR	0,028	80.066
	Clase ISC	24/06/2021	SGD	0,026	2
	Clase ISC	24/09/2021	SGD	0,026	2
	Clase ISC	22/12/2021	SGD	0,027	2
	Clase ISC	25/03/2022	SGD	0,029	2
	Clase IUC	24/06/2021	USD	0,028	2
	Clase IUC	24/09/2021	USD	0,026	606
	Clase IUC	22/12/2021	USD	0,026	1.223
	Clase IUC	25/03/2022	USD	0,027	2.293
	Clase NEP	24/06/2021	EUR	2,700	249.906
	Clase NEP	24/09/2021	EUR	2,621	254.973
	Clase NEP	22/12/2021	EUR	2,711	264.390
	Clase NEP	25/03/2022	EUR	2,815	275.250
	Clase ZEP	24/06/2021	EUR	0,027	8.546
	Clase ZEP	24/09/2021	EUR	0,026	12.884
	Clase ZEP	22/12/2021	EUR	0,027	17.130
	Clase ZEP	25/03/2022	EUR	0,028	16.601
Clase ZGC	24/06/2021	GBP	0,027	54.969	
Clase ZGC	24/09/2021	GBP	0,027	68.716	
Clase ZGC	22/12/2021	GBP	0,028	93.601	
Clase ZGC	25/03/2022	GBP	0,029	123.780	
					1.782.929 EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)	
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Clase AEP	26/04/2021	EUR	0,032	23.679	
	Clase AEP	21/05/2021	EUR	0,032	23.157	
	Clase AEP	24/06/2021	EUR	0,032	23.231	
	Clase AEP	26/07/2021	EUR	0,032	23.267	
	Clase AEP	24/08/2021	EUR	0,032	23.784	
	Clase AEP	24/09/2021	EUR	0,035	25.411	
	Clase AEP	25/10/2021	EUR	0,035	25.006	
	Clase AEP	23/11/2021	EUR	0,035	24.725	
	Clase AEP	22/12/2021	EUR	0,035	24.052	
	Clase AEP	25/01/2022	EUR	0,035	23.878	
	Clase AEP	22/02/2022	EUR	0,035	24.073	
	Clase AEP	25/03/2022	EUR	0,033	22.541	
	Clase DEP	26/04/2021	EUR	0,024	39.117	
	Clase DEP	21/05/2021	EUR	0,024	40.122	
	Clase DEP	24/06/2021	EUR	0,024	41.969	
	Clase DEP	26/07/2021	EUR	0,024	42.803	
	Clase DEP	24/08/2021	EUR	0,024	43.383	
	Clase DEP	24/09/2021	EUR	0,026	47.210	
	Clase DEP	25/10/2021	EUR	0,026	46.995	
	Clase DEP	23/11/2021	EUR	0,026	44.732	
	Clase DEP	22/12/2021	EUR	0,026	44.566	
	Clase DEP	25/01/2022	EUR	0,026	43.625	
	Clase DEP	22/02/2022	EUR	0,026	42.813	
	Clase DEP	25/03/2022	EUR	0,025	40.031	
						804.170 EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	Clase AEC	26/04/2021	EUR	0,043	26.733
		Clase AEC	21/05/2021	EUR	0,043	26.971
Clase AEC		24/06/2021	EUR	0,043	26.363	
Clase AEC		26/07/2021	EUR	0,043	25.371	
Clase AEC		24/08/2021	EUR	0,043	24.921	
Clase AEC		24/09/2021	EUR	0,043	24.821	
Clase AEC		25/10/2021	EUR	0,043	24.884	
Clase AEC		23/11/2021	EUR	0,043	23.605	
Clase AEC		22/12/2021	EUR	0,042	22.394	
Clase AEC		25/01/2022	EUR	0,042	19.919	
Clase AEC		22/02/2022	EUR	0,042	18.929	
Clase AEC		25/03/2022	EUR	0,037	15.885	
Clase AUP		26/04/2021	USD	0,028	22.712	
Clase AUP		21/05/2021	USD	0,028	21.719	
Clase AUP		24/06/2021	USD	0,028	21.565	
Clase AUP		26/07/2021	USD	0,028	21.399	
Clase AUP		24/08/2021	USD	0,028	21.579	
Clase AUP		24/09/2021	USD	0,028	21.542	
Clase AUP		25/10/2021	USD	0,028	21.422	
Clase AUP		23/11/2021	USD	0,028	21.212	
Clase AUP		22/12/2021	USD	0,027	20.336	
Clase AUP		25/01/2022	USD	0,027	20.142	
Clase AUP		22/02/2022	USD	0,027	20.074	
Clase AUP		25/03/2022	USD	0,024	17.570	

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds (continuación)	Clase DEC	26/04/2021	EUR	0,032	2.117
	Clase DEC	21/05/2021	EUR	0,032	2.130
	Clase DEC	24/06/2021	EUR	0,031	1.965
	Clase DEC	26/07/2021	EUR	0,031	1.942
	Clase DEC	24/08/2021	EUR	0,031	1.942
	Clase DEC	24/09/2021	EUR	0,031	1.845
	Clase DEC	25/10/2021	EUR	0,031	1.664
	Clase DEC	23/11/2021	EUR	0,031	1.594
	Clase DEC	22/12/2021	EUR	0,030	1.476
	Clase DEC	25/01/2022	EUR	0,030	1.430
	Clase DEC	22/02/2022	EUR	0,030	1.526
	Clase DEC	25/03/2022	EUR	0,027	1.302
	Clase IEC	26/04/2021	EUR	0,033	4
	Clase IEC	21/05/2021	EUR	0,033	12.297
	Clase IEC	24/06/2021	EUR	0,033	11.980
	Clase IEC	26/07/2021	EUR	0,033	11.842
	Clase IEC	24/08/2021	EUR	0,033	11.820
	Clase IEC	24/09/2021	EUR	0,033	11.829
	Clase IEC	25/10/2021	EUR	0,033	19.182
	Clase IEC	23/11/2021	EUR	0,033	18.523
	Clase IEC	22/12/2021	EUR	0,032	6.995
	Clase IEC	25/01/2022	EUR	0,032	7.024
	Clase IEC	22/02/2022	EUR	0,032	7.044
	Clase IEC	25/03/2022	EUR	0,029	6.196
	Clase XUP	24/06/2021	USD	0,112	11
	Clase XUP	24/09/2021	USD	0,129	11
	Clase XUP	22/12/2021	USD	0,121	10
	Clase XUP	25/03/2022	USD	0,133	11
					677.780 USD
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	Clase AEC	26/04/2021	EUR	0,035	3.126
	Clase AEC	21/05/2021	EUR	0,035	3.170
	Clase AEC	24/06/2021	EUR	0,036	3.140
	Clase AEC	26/07/2021	EUR	0,036	3.042
	Clase AEC	24/08/2021	EUR	0,036	2.974
	Clase AEC	24/09/2021	EUR	0,037	3.057
	Clase AEC	25/10/2021	EUR	0,037	3.007
	Clase AEC	23/11/2021	EUR	0,037	2.873
	Clase AEC	22/12/2021	EUR	0,036	2.551
	Clase AEC	25/01/2022	EUR	0,036	2.484
	Clase AEC	22/02/2022	EUR	0,036	2.454
	Clase AEC	25/03/2022	EUR	0,032	1.821
	Clase AUP	26/04/2021	USD	0,043	134.552
	Clase AUP	21/05/2021	USD	0,043	133.785
	Clase AUP	24/06/2021	USD	0,044	136.088
	Clase AUP	26/07/2021	USD	0,044	134.286
	Clase AUP	24/08/2021	USD	0,044	132.261
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,046	136.512
	Clase AUP	25/10/2021	USD	0,046	134.882

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt (continuación)	Clase AUP	23/11/2021	USD	0,046	133.873
	Clase AUP	22/12/2021	USD	0,044	126.356
	Clase AUP	25/01/2022	USD	0,044	125.388
	Clase AUP	22/02/2022	USD	0,044	124.439
	Clase AUP	25/03/2022	USD	0,039	108.705
	Clase SUP	26/04/2021	USD	0,041	2.108
	Clase SUP	21/05/2021	USD	0,041	2.108
	Clase SUP	24/06/2021	USD	0,042	2.160
	Clase SUP	26/07/2021	USD	0,042	2.155
	Clase SUP	24/08/2021	USD	0,042	2.128
	Clase SUP	24/09/2021	USD	0,044	2.226
	Clase SUP	25/10/2021	USD	0,044	2.193
	Clase SUP	23/11/2021	USD	0,044	2.162
	Clase SUP	22/12/2021	USD	0,042	2.052
	Clase SUP	25/01/2022	USD	0,042	2.052
	Clase SUP	22/02/2022	USD	0,042	2.052
	Clase SUP	25/03/2022	USD	0,038	1.848
	Clase XUP	24/06/2021	USD	0,122	12
	Clase XUP	24/09/2021	USD	0,134	12
	Clase XUP	22/12/2021	USD	0,122	11
	Clase XUP	25/03/2022	USD	0,122	11
					1.620.116 USD
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	Clase AEC	26/04/2021	EUR	0,021	89.183
	Clase AEC	21/05/2021	EUR	0,021	66.070
	Clase AEC	24/06/2021	EUR	0,021	64.297
	Clase AEC	26/07/2021	EUR	0,021	63.572
	Clase AEC	24/08/2021	EUR	0,021	63.480
	Clase AEC	24/09/2021	EUR	0,021	63.189
	Clase AEC	25/10/2021	EUR	0,021	62.328
	Clase AEC	23/11/2021	EUR	0,021	59.582
	Clase AEC	22/12/2021	EUR	0,021	59.257
	Clase AEC	25/01/2022	EUR	0,021	59.223
	Clase AEC	22/02/2022	EUR	0,021	59.279
	Clase AEC	25/03/2022	EUR	0,018	49.287
	Clase ASC	26/04/2021	SGD	0,029	3.075
	Clase ASC	21/05/2021	SGD	0,029	3.044
	Clase ASC	24/06/2021	SGD	0,029	2.966
	Clase ASC	26/07/2021	SGD	0,029	2.939
	Clase ASC	24/08/2021	SGD	0,029	2.994
	Clase ASC	24/09/2021	SGD	0,028	2.916
	Clase ASC	25/10/2021	SGD	0,028	2.926
	Clase ASC	23/11/2021	SGD	0,028	2.897
	Clase ASC	22/12/2021	SGD	0,029	2.994
	Clase ASC	25/01/2022	SGD	0,029	3.020
	Clase ASC	22/02/2022	SGD	0,029	3.029
	Clase ASC	25/03/2022	SGD	0,025	847
	Clase AUP	26/04/2021	USD	0,023	38.087

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds					
<i>(continuación)</i>	Clase AUP	21/05/2021	USD	0,023	37.686
	Clase AUP	24/06/2021	USD	0,022	35.938
	Clase AUP	26/07/2021	USD	0,022	35.557
	Clase AUP	24/08/2021	USD	0,022	35.300
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,022	34.683
	Clase AUP	25/10/2021	USD	0,022	34.403
	Clase AUP	23/11/2021	USD	0,022	33.603
	Clase AUP	22/12/2021	USD	0,023	34.956
	Clase AUP	25/01/2022	USD	0,023	34.758
	Clase AUP	22/02/2022	USD	0,023	34.159
	Clase AUP	25/03/2022	USD	0,019	27.914
	Clase XUP	26/04/2021	USD	0,039	35.263
	Clase XUP	21/05/2021	USD	0,039	35.263
	Clase XUP	24/06/2021	USD	0,039	35.263
	Clase XUP	26/07/2021	USD	0,039	35.263
	Clase XUP	24/08/2021	USD	0,039	35.263
	Clase XUP	24/09/2021	USD	0,039	34.036
	Clase XUP	25/10/2021	USD	0,039	28.767
	Clase XUP	23/11/2021	USD	0,039	20.883
	Clase XUP	22/12/2021	USD	0,039	19.853
	Clase XUP	25/01/2022	USD	0,039	14.197
	Clase XUP	22/02/2022	USD	0,039	14.197
	Clase XUP	25/03/2022	USD	0,034	12.379
					1.530.065 USD
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	Clase AEC	26/04/2021	EUR	0,055	1.948
	Clase AEC	21/05/2021	EUR	0,055	1.975
	Clase AEC	24/06/2021	EUR	0,055	1.924
	Clase AEC	26/07/2021	EUR	0,055	1.902
	Clase AEC	24/08/2021	EUR	0,055	1.903
	Clase AEC	24/09/2021	EUR	0,055	1.904
	Clase AEC	25/10/2021	EUR	0,055	1.888
	Clase AEC	23/11/2021	EUR	0,055	1.632
	Clase AEC	22/12/2021	EUR	0,051	1.510
	Clase AEC	25/01/2022	EUR	0,051	1.427
	Clase AEC	22/02/2022	EUR	0,051	1.250
	Clase AEC	25/03/2022	EUR	0,048	1.210
	Clase AUP	26/04/2021	USD	0,059	17.179
	Clase AUP	21/05/2021	USD	0,059	17.188
	Clase AUP	24/06/2021	USD	0,059	17.159
	Clase AUP	26/07/2021	USD	0,059	17.476
	Clase AUP	24/08/2021	USD	0,059	15.495
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,059	15.517
	Clase AUP	25/10/2021	USD	0,059	15.323
	Clase AUP	23/11/2021	USD	0,059	15.166
	Clase AUP	22/12/2021	USD	0,055	14.104
	Clase AUP	25/01/2022	USD	0,055	14.057
	Clase AUP	22/02/2022	USD	0,055	13.842

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond (continuación)	Clase AUP	25/03/2022	USD	0,052	12.917
	Clase DEC	26/04/2021	EUR	0,041	1.483
	Clase DEC	21/05/2021	EUR	0,041	1.464
	Clase DEC	24/06/2021	EUR	0,042	1.461
	Clase DEC	26/07/2021	EUR	0,042	1.444
	Clase DEC	24/08/2021	EUR	0,042	1.446
	Clase DEC	24/09/2021	EUR	0,042	1.473
	Clase DEC	25/10/2021	EUR	0,042	1.443
	Clase DEC	23/11/2021	EUR	0,042	1.364
	Clase DEC	22/12/2021	EUR	0,039	1.269
	Clase DEC	25/01/2022	EUR	0,039	1.274
	Clase DEC	22/02/2022	EUR	0,039	1.278
	Clase DEC	25/03/2022	EUR	0,036	989
	Clase IEC	26/04/2021	EUR	0,040	5
	Clase IEC	21/05/2021	EUR	0,040	5
	Clase IEC	24/06/2021	EUR	0,040	5
	Clase IEC	26/07/2021	EUR	0,040	5
	Clase IEC	24/08/2021	EUR	0,040	4
	Clase IEC	24/09/2021	EUR	0,041	4
	Clase IEC	25/10/2021	EUR	0,041	4
	Clase IEC	23/11/2021	EUR	0,041	4
	Clase IEC	22/12/2021	EUR	0,038	4
	Clase IEC	25/01/2022	EUR	0,038	4
	Clase IEC	22/02/2022	EUR	0,038	4
	Clase IEC	25/03/2022	EUR	0,036	4
	Clase ISC	24/08/2021	SGD	0,044	4
	Clase ISC	24/09/2021	SGD	0,044	4
	Clase ISC	25/10/2021	SGD	0,044	4
	Clase ISC	23/11/2021	SGD	0,044	37
	Clase ISC	22/12/2021	SGD	0,041	126
	Clase ISC	25/01/2022	SGD	0,041	2.698
	Clase ISC	22/02/2022	SGD	0,041	3.804
	Clase ISC	25/03/2022	SGD	0,039	4.288
	Clase XUP	24/06/2021	USD	0,139	14
	Clase XUP	24/09/2021	USD	0,149	13
	Clase XUP	22/12/2021	USD	0,137	12
	Clase XUP	25/03/2022	USD	0,141	13
					233.353 USD
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	Clase ASC	26/04/2021	SGD	0,032	323
	Clase ASC	21/05/2021	SGD	0,032	339
	Clase ASC	24/06/2021	SGD	0,032	335
	Clase ASC	26/07/2021	SGD	0,032	342
	Clase ASC	24/08/2021	SGD	0,032	263
	Clase ASC	24/09/2021	SGD	0,034	79
	Clase ASC	25/10/2021	SGD	0,034	88
	Clase ASC	23/11/2021	SGD	0,034	92
	Clase ASC	22/12/2021	SGD	0,034	99

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond (continuación)	Clase ASC	25/01/2022	SGD	0,034	101
	Clase ASC	22/02/2022	SGD	0,034	101
	Clase ASC	25/03/2022	SGD	0,031	95
	Clase AUP	26/04/2021	USD	0,033	40.709
	Clase AUP	21/05/2021	USD	0,033	39.558
	Clase AUP	24/06/2021	USD	0,033	39.674
	Clase AUP	26/07/2021	USD	0,033	35.614
	Clase AUP	24/08/2021	USD	0,033	32.918
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,036	31.886
	Clase AUP	25/10/2021	USD	0,036	31.985
	Clase AUP	23/11/2021	USD	0,036	28.945
	Clase AUP	22/12/2021	USD	0,035	27.578
	Clase AUP	25/01/2022	USD	0,035	24.623
	Clase AUP	22/02/2022	USD	0,035	24.772
	Clase AUP	25/03/2022	USD	0,032	22.722
	Clase AVC	26/04/2021	AUD	0,031	2
	Clase AVC	21/05/2021	AUD	0,031	2
	Clase AVC	24/06/2021	AUD	0,031	2
	Clase AVC	26/07/2021	AUD	0,031	2
	Clase AVC	24/08/2021	AUD	0,031	2
	Clase AVC	24/09/2021	AUD	0,033	2
	Clase AVC	25/10/2021	AUD	0,033	2
	Clase AVC	23/11/2021	AUD	0,033	2
	Clase AVC	22/12/2021	AUD	0,032	2
	Clase AVC	25/01/2022	AUD	0,032	2
	Clase AVC	22/02/2022	AUD	0,032	2
	Clase AVC	25/03/2022	AUD	0,029	2
	Clase ZUP	26/04/2021	USD	0,032	3
	Clase ZUP	21/05/2021	USD	0,032	3
	Clase ZUP	24/06/2021	USD	0,032	3
	Clase ZUP	26/07/2021	USD	0,032	3
	Clase ZUP	24/08/2021	USD	0,032	3
	Clase ZUP	24/09/2021	USD	0,034	3
	Clase ZUP	25/10/2021	USD	0,034	3
	Clase ZUP	23/11/2021	USD	0,034	3
	Clase ZUP	22/12/2021	USD	0,034	3
	Clase ZUP	25/01/2022	USD	0,034	3
	Clase ZUP	22/02/2022	USD	0,034	3
	Clase ZUP	25/03/2022	USD	0,031	3
					383.301 USD
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	Clase AEP	24/09/2021	EUR	0,002	0*
	Clase IEP	24/09/2021	EUR	0,002	0*
	Clase LEP	24/09/2021	EUR	0,002	0*
	Clase ZEP	24/09/2021	EUR	0,002	1
					1 EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	Clase AEC	26/04/2021	EUR	0,012	923
	Clase AEC	21/05/2021	EUR	0,012	933
	Clase AEC	24/06/2021	EUR	0,018	1.363
	Clase AEC	26/07/2021	EUR	0,018	1.348
	Clase AEC	24/08/2021	EUR	0,018	1.347
	Clase AEC	24/09/2021	EUR	0,015	1.123
	Clase AEC	25/10/2021	EUR	0,015	1.088
	Clase AEC	23/11/2021	EUR	0,015	1.041
	Clase AEC	22/12/2021	EUR	0,012	836
	Clase AEC	25/01/2022	EUR	0,012	854
	Clase AEC	22/02/2022	EUR	0,012	857
	Clase AEC	25/03/2022	EUR	0,011	758
	Clase AUP	26/04/2021	USD	0,014	5.272
	Clase AUP	21/05/2021	USD	0,014	5.213
	Clase AUP	24/06/2021	USD	0,021	7.764
	Clase AUP	26/07/2021	USD	0,021	7.629
	Clase AUP	24/08/2021	USD	0,021	7.605
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,018	6.417
	Clase AUP	25/10/2021	USD	0,018	6.393
	Clase AUP	23/11/2021	USD	0,018	6.037
Clase AUP	22/12/2021	USD	0,013	4.308	
Clase AUP	25/01/2022	USD	0,013	4.286	
Clase AUP	22/02/2022	USD	0,013	4.272	
Clase AUP	25/03/2022	USD	0,013	4.222	
					81.889 USD
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Clase AEC	24/06/2021	EUR	0,104	663.930
	Clase AEC	24/09/2021	EUR	0,104	636.548
	Clase AEC	22/12/2021	EUR	0,102	563.058
	Clase AEC	25/03/2022	EUR	0,078	391.816
	Clase AEP	24/06/2021	EUR	0,117	237.007
	Clase AEP	24/09/2021	EUR	0,118	230.570
	Clase AEP	22/12/2021	EUR	0,122	234.885
	Clase AEP	25/03/2022	EUR	0,096	193.344
	Clase ASC	24/06/2021	SGD	0,122	1.593
	Clase ASC	24/09/2021	SGD	0,121	2.512
	Clase ASC	22/12/2021	SGD	0,120	1.618
	Clase ASC	25/03/2022	SGD	0,092	1.277
	Clase ASP	24/06/2021	SGD	0,121	523
	Clase ASP	24/09/2021	SGD	0,121	540
	Clase ASP	22/12/2021	SGD	0,121	517
	Clase ASP	25/03/2022	SGD	0,092	374
	Clase AUM	26/04/2021	USD	0,042	1.712
	Clase AUM	21/05/2021	USD	0,042	1.712
	Clase AUM	24/06/2021	USD	0,043	1.752
	Clase AUM	26/07/2021	USD	0,043	1.752
Clase AUM	24/08/2021	USD	0,043	1.752	
Clase AUM	24/09/2021	USD	0,043	1.752	

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income (continuación)	Clase AUM	25/10/2021	USD	0,043	1.752
	Clase AUM	23/11/2021	USD	0,043	1.752
	Clase AUM	22/12/2021	USD	0,042	1.715
	Clase AUM	25/01/2022	USD	0,042	1.718
	Clase AUM	22/02/2022	USD	0,042	1.715
	Clase AUM	25/03/2022	USD	0,032	1.307
	Clase AUP	24/06/2021	USD	0,123	138.327
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,122	133.724
	Clase AUP	22/12/2021	USD	0,121	132.706
	Clase AUP	25/03/2022	USD	0,093	98.559
	Clase DEC	24/06/2021	EUR	0,099	355.070
	Clase DEC	24/09/2021	EUR	0,098	337.554
	Clase DEC	22/12/2021	EUR	0,097	305.578
	Clase DEC	25/03/2022	EUR	0,074	216.545
	Clase DEP	24/06/2021	EUR	0,111	47.720
	Clase DEP	24/09/2021	EUR	0,111	45.133
	Clase DEP	22/12/2021	EUR	0,115	43.117
	Clase DEP	25/03/2022	EUR	0,090	28.431
	Clase DUP	24/06/2021	USD	0,112	235.562
	Clase DUP	24/09/2021	USD	0,111	230.314
	Clase DUP	22/12/2021	USD	0,110	227.161
	Clase DUP	25/03/2022	USD	0,084	170.710
	Clase ZEC	24/06/2021	EUR	0,115	14
	Clase ZEC	24/09/2021	EUR	0,114	12
	Clase ZEC	22/12/2021	EUR	0,113	12
	Clase ZEC	25/03/2022	EUR	0,087	9
	Clase ZUP	24/06/2021	USD	0,123	12
	Clase ZUP	24/09/2021	USD	0,123	12
	Clase ZUP	22/12/2021	USD	0,122	12
	Clase ZUP	25/03/2022	USD	0,093	9
					5.926.806 USD
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	Clase AEC	24/09/2021	EUR	0,064	8
	Clase AEC	25/03/2022	EUR	0,043	5
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,064	6
	Clase AUP	25/03/2022	USD	0,043	4
	Clase ZEC	24/09/2021	EUR	0,064	8
	Clase ZEC	25/03/2022	EUR	0,043	5
	Clase ZUP	24/09/2021	USD	0,064	6
	Clase ZUP	25/03/2022	USD	0,043	4
					46 USD
Threadneedle (Lux) - Global Focus	Clase AEP	24/09/2021	EUR	0,083	216.877
	Clase AEP	25/03/2022	EUR	0,071	233.779
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,067	2.258
	Clase AUP	25/03/2022	USD	0,054	2.126

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Global Focus <i>(continuación)</i>	Clase IUP	24/09/2021	USD	0,069	3.451
	Clase IUP	25/03/2022	USD	0,056	2.816
	Clase ZEP	24/09/2021	EUR	0,080	246.548
	Clase ZEP	25/03/2022	EUR	0,074	269.403
					977.258 USD
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	Clase AEC	24/06/2021	EUR	0,110	635
	Clase AEC	24/09/2021	EUR	0,064	363
	Clase AEC	22/12/2021	EUR	0,059	321
	Clase AEC	25/03/2022	EUR	0,070	372
	Clase AUP	24/06/2021	USD	0,117	12
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,070	6
	Clase AUP	22/12/2021	USD	0,062	5
	Clase AUP	25/03/2022	USD	0,073	6
	Clase DEC	24/06/2021	EUR	0,110	13
	Clase DEC	24/09/2021	EUR	0,063	6
	Clase DEC	22/12/2021	EUR	0,058	5
	Clase DEC	25/03/2022	EUR	0,069	6
	Clase DUP	24/06/2021	USD	0,115	12
	Clase DUP	24/09/2021	USD	0,069	6
	Clase DUP	22/12/2021	USD	0,061	5
	Clase DUP	25/03/2022	USD	0,072	3.550
	Clase 1EP	24/06/2021	EUR	0,115	210.331
	Clase 1EP	24/09/2021	EUR	0,067	120.189
	Clase 1EP	22/12/2021	EUR	0,064	105.944
	Clase 1EP	25/03/2022	EUR	0,077	123.719
	Clase 1SC	24/06/2021	SGD	0,119	40.317
	Clase 1SC	24/09/2021	SGD	0,068	22.717
	Clase 1SC	22/12/2021	SGD	0,061	20.139
	Clase 1SC	25/03/2022	SGD	0,073	24.070
	Clase 1ST	26/04/2021	SGD	0,040	2.503
	Clase 1ST	21/05/2021	SGD	0,044	2.788
	Clase 1ST	24/06/2021	SGD	0,030	1.892
	Clase 1ST	26/07/2021	SGD	0,013	665
	Clase 1ST	24/08/2021	SGD	0,036	1.821
	Clase 1ST	24/09/2021	SGD	0,026	1.059
	Clase 1ST	25/10/2021	SGD	0,020	821
	Clase 1ST	23/11/2021	SGD	0,017	697
	Clase 1ST	22/12/2021	SGD	0,023	947
	Clase 1ST	25/01/2022	SGD	0,013	553
	Clase 1ST	22/02/2022	SGD	0,016	681
	Clase 1ST	25/03/2022	SGD	0,043	1.806
	Clase 1UP	24/06/2021	USD	0,118	51.262
	Clase 1UP	24/09/2021	USD	0,069	29.575
	Clase 1UP	22/12/2021	USD	0,062	25.810
	Clase 1UP	25/03/2022	USD	0,074	30.700
	Clase 1VT	26/04/2021	AUD	0,039	223
	Clase 1VT	21/05/2021	AUD	0,043	247
	Clase 1VT	24/06/2021	AUD	0,030	167

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income (continuación)	Clase 1VT	26/07/2021	AUD	0,010	54
	Clase 1VT	24/08/2021	AUD	0,035	189
	Clase 1VT	24/09/2021	AUD	0,021	115
	Clase 1VT	25/10/2021	AUD	0,019	107
	Clase 1VT	23/11/2021	AUD	0,017	98
	Clase 1VT	22/12/2021	AUD	0,022	125
	Clase 1VT	25/01/2022	AUD	0,012	69
	Clase 1VT	22/02/2022	AUD	0,016	94
	Clase 1VT	25/03/2022	AUD	0,041	253
	Clase 2EP	24/06/2021	EUR	0,115	14
	Clase 2EP	24/09/2021	EUR	0,068	6
	Clase 2EP	22/12/2021	EUR	0,065	5
	Clase 2EP	25/03/2022	EUR	0,078	6
	Clase 2UP	24/06/2021	USD	0,119	12
	Clase 2UP	24/09/2021	USD	0,072	6
	Clase 2UP	22/12/2021	USD	0,064	5
	Clase 2UP	25/03/2022	USD	0,075	6
	Clase 3EP	24/06/2021	EUR	0,114	1.349.752
	Clase 3EP	24/09/2021	EUR	0,069	806.124
	Clase 3EP	22/12/2021	EUR	0,065	601.000
	Clase 3EP	25/03/2022	EUR	0,079	716.946
	Clase 3UP	24/06/2021	USD	0,119	4.680
	Clase 3UP	24/09/2021	USD	0,070	2.759
	Clase 3UP	22/12/2021	USD	0,064	2.523
	Clase 3UP	25/03/2022	USD	0,076	2.996
	Clase 8EP	24/06/2021	EUR	0,114	23
	Clase 8EP	24/09/2021	EUR	0,068	19
	Clase 8EP	22/12/2021	EUR	0,064	17
	Clase 8EP	25/03/2022	EUR	0,078	20
	Clase 8UP	24/06/2021	USD	0,119	6.890
	Clase 8UP	24/09/2021	USD	0,070	4.059
	Clase 8UP	22/12/2021	USD	0,063	3.653
	Clase 8UP	25/03/2022	USD	0,075	4.349
	Clase 9EP	24/06/2021	EUR	0,115	14
	Clase 9EP	24/09/2021	EUR	0,068	6
	Clase 9EP	22/12/2021	EUR	0,065	5
	Clase 9EP	25/03/2022	EUR	0,079	6
	Clase 9UP	24/06/2021	USD	0,119	12
	Clase 9UP	24/09/2021	USD	0,072	6
	Clase 9UP	22/12/2021	USD	0,064	5
	Clase 9UP	25/03/2022	USD	0,076	6
					4.334.000 USD
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	Clase AEP	25/03/2022	EUR	0,114	2.157.448
	Clase AUP	25/03/2022	USD	0,106	7.057
	Clase IEP	25/03/2022	EUR	0,096	230.480
					2.394.985 EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - American	Clase 1EP	25/03/2022	EUR	0,194	66.138
					66.138 USD
Threadneedle (Lux) - American Select	Clase 1EP	25/03/2022	EUR	0,066	28.362
					28.362 USD
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	Clase 1EP	25/03/2022	EUR	0,213	238.798
					238.798 USD
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	Clase XUP	24/09/2021	USD	0,230	885.956
	Clase XUP	25/03/2022	USD	0,119	331.803
					1.217.759 USD
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	Clase AEC	24/09/2021	EUR	0,116	46
	Clase AEC	25/03/2022	EUR	0,131	49
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,125	1.353
	Clase AUP	25/03/2022	USD	0,150	1.423
				2.871 USD	
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,138	47
	Clase AUP	25/03/2022	USD	0,157	10
	Clase IEC	24/09/2021	EUR	0,129	9
	Clase IEC	25/03/2022	EUR	0,149	10
				76 USD	
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	Clase 1EP	25/03/2022	EUR	0,336	22
	Clase 1GP	25/03/2022	GBP	0,311	22
	Clase 3GP	25/03/2022	GBP	0,319	143
	Clase 9GP	25/03/2022	GBP	0,320	22
				209 EUR	
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	Clase 1EP	24/09/2021	EUR	0,030	321.819
	Clase 1EP	25/03/2022	EUR	0,014	152.433
	Clase 1GP	24/09/2021	GBP	0,025	9.937
	Clase 1GP	25/03/2022	GBP	0,012	5.065
	Clase 2EP	24/09/2021	EUR	0,298	21
	Clase 2EP	25/03/2022	EUR	0,149	11
	Clase 2GP	24/09/2021	GBP	0,290	21
	Clase 2GP	25/03/2022	GBP	0,141	11
	Clase 3EP	24/09/2021	EUR	0,047	3.349
	Clase 3EP	25/03/2022	EUR	0,024	1.710
	Clase 3GP	24/09/2021	GBP	0,040	35.200
	Clase 3GP	25/03/2022	GBP	0,020	16.300
	Clase 4GP	24/09/2021	GBP	0,037	279.782
	Clase 4GP	25/03/2022	GBP	0,017	112.390
Clase 8EP	24/09/2021	EUR	0,031	29.686	
Clase 8EP	25/03/2022	EUR	0,016	13.772	
Clase 8GP	24/09/2021	GBP	0,027	13.993	

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend (continuación)	Clase 8GP	25/03/2022	GBP	0,013	7.054
	Clase 9EP	24/09/2021	EUR	0,319	2.670
	Clase 9EP	25/03/2022	EUR	0,150	11
	Clase 9GP	24/09/2021	GBP	0,290	21
	Clase 9GP	25/03/2022	GBP	0,142	11
	Clase AEP	24/09/2021	EUR	0,292	3.134
	Clase AEP	25/03/2022	EUR	0,146	2.227
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,312	21
	Clase AUP	25/03/2022	USD	0,145	11
	Clase DEP	24/09/2021	EUR	0,289	755
	Clase DEP	25/03/2022	EUR	0,144	424
	Clase IEP	24/09/2021	EUR	0,299	188.003
	Clase IEP	25/03/2022	EUR	0,150	127.782
	Clase ZEP	24/09/2021	EUR	0,298	4.670
	Clase ZEP	25/03/2022	EUR	0,149	3.398
					1.335.692 EUR
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	Clase 1EP	25/03/2022	EUR	0,164	173.604
	Clase 3EP	25/03/2022	EUR	0,167	202.796
	Clase 3GP	25/03/2022	GBP	0,155	40.726
	Clase 9EP	25/03/2022	EUR	0,168	11
	Clase 9GP	25/03/2022	GBP	0,156	11
					417.148 EUR
Threadneedle (Lux) - European Select	Clase 1EP	25/03/2022	EUR	0,194	169.490
	Clase 2EP	25/03/2022	EUR	0,197	15.598
	Clase 8EP	25/03/2022	EUR	0,197	6.554
					191.642 EUR
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	Clase 1EP	25/03/2022	EUR	0,185	607.913
	Clase 3EP	25/03/2022	EUR	0,188	147.653
	Clase 9EP	25/03/2022	EUR	0,180	112.699
					868.265 EUR
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,323	6.766
	Clase AUP	25/03/2022	USD	0,183	26.701
	Clase DUP	24/09/2021	USD	0,317	6.709
	Clase DUP	25/03/2022	USD	0,178	7.318
	Clase IEP	24/09/2021	EUR	0,316	197.969
	Clase IEP	25/03/2022	EUR	0,192	174.615
	Clase XUP	24/09/2021	USD	0,335	170.243
	Clase XUP	25/03/2022	USD	0,191	54.029
	Clase ZGP	24/09/2021	GBP	0,279	21
	Clase ZGP	25/03/2022	GBP	0,165	12
	Clase ZUP	24/09/2021	USD	0,371	1.316
	Clase ZUP	25/03/2022	USD	0,212	769
					646.468 USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Global Technology	Clase AUP	25/03/2022	USD	0,163	11.791
					11.791 USD
Threadneedle (Lux) - UK Equities	Clase AGP	24/09/2021	GBP	0,375	29.513
	Clase AGP	25/03/2022	GBP	0,251	18.121
	Clase IGP	24/09/2021	GBP	0,551	1.289.225
	Clase IGP	25/03/2022	GBP	0,370	262.521
	Clase NGP	24/09/2021	GBP	0,225	13
	Clase NGP	25/03/2022	GBP	0,148	8
	Clase TGP	24/09/2021	GBP	0,225	13
	Clase TGP	25/03/2022	GBP	0,148	8
	Clase ZGP	24/09/2021	GBP	0,202	254.950
	Clase ZGP	25/03/2022	GBP	0,132	170.000
	Clase 9EP	24/09/2021	EUR	0,184	745.194
	Clase 9EP	25/03/2022	EUR	0,124	268.125
					3.037.691 GBP
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	Clase AEC	24/06/2021	EUR	0,115	6.432
	Clase AEC	24/09/2021	EUR	0,070	3.928
	Clase AEC	22/12/2021	EUR	0,077	4.327
	Clase AEC	25/03/2022	EUR	0,054	3.463
	Clase ASC	24/06/2021	SGD	0,119	11
	Clase ASC	24/09/2021	SGD	0,073	5
	Clase ASC	22/12/2021	SGD	0,080	6
	Clase ASC	25/03/2022	SGD	0,055	4
	Clase AUC	24/06/2021	USD	0,124	49.715
	Clase AUC	24/09/2021	USD	0,074	30.408
	Clase AUC	22/12/2021	USD	0,083	41.190
	Clase AUC	25/03/2022	USD	0,058	26.222
	Clase DEC	24/06/2021	EUR	0,111	11
	Clase DEC	24/09/2021	EUR	0,068	5
	Clase DEC	22/12/2021	EUR	0,074	6
	Clase DEC	25/03/2022	EUR	0,052	553
	Clase DGP	24/06/2021	GBP	0,120	12
	Clase DGP	24/09/2021	GBP	0,074	5
	Clase DGP	22/12/2021	GBP	0,081	6
	Clase DGP	25/03/2022	GBP	0,056	22
	Clase IGP	24/06/2021	GBP	0,124	155.152
	Clase IGP	24/09/2021	GBP	0,073	94.594
	Clase IGP	22/12/2021	GBP	0,084	113.310
	Clase IGP	25/03/2022	GBP	0,058	74.419
	Clase LGP	24/06/2021	GBP	0,125	1.131.701
	Clase LGP	24/09/2021	GBP	0,075	784.215
	Clase LGP	22/12/2021	GBP	0,085	875.654
	Clase LGP	25/03/2022	GBP	0,060	627.573
	Clase ZGP	24/06/2021	GBP	0,129	831
	Clase ZGP	24/09/2021	GBP	0,080	1.392
	Clase ZGP	22/12/2021	GBP	0,088	10.748
	Clase ZGP	25/03/2022	GBP	0,061	7.718
					4.043.638 GBP

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Clase 1EP	25/03/2022	EUR	0,304	18.132
	Clase 2EP	25/03/2022	EUR	0,306	17.916
	Clase 2GC	25/03/2022	GBP	0,304	28
	Clase 8EP	25/03/2022	EUR	0,310	37.670
	Clase 8GC	25/03/2022	GBP	0,311	13.802
					87.548 EUR
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Clase IEP	24/06/2021	EUR	0,057	6
	Clase IEP	24/09/2021	EUR	0,061	5
	Clase IEP	22/12/2021	EUR	0,057	5
	Clase IEP	25/03/2022	EUR	0,065	6
	Clase LEP	24/06/2021	EUR	0,057	6
	Clase LEP	24/09/2021	EUR	0,061	5
	Clase LEP	22/12/2021	EUR	0,058	5
	Clase LEP	25/03/2022	EUR	0,067	6
					44 EUR
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Clase AEP	25/03/2022	EUR	0,043	1.219
					1.219 EUR

* Cantidad fraccionada redondeada a 0.

Notas a los estados financieros

(continuación)

8 COMISIONES DE RENDIMIENTO

La Sociedad Gestora recibirá una comisión de rendimiento según se establece a continuación con respecto a las Clases de Acciones de las Carteras que se enumeran en la siguiente tabla. Se establecerán provisiones diarias para el devengo de la comisión de rendimiento con respecto al saldo de la comisión de rendimiento (como se describe a continuación), por el cual el importe se pagará a la Sociedad Gestora al final de cada año calendario (es decir, el 31 de diciembre). La Sociedad Gestora es responsable de abonar la totalidad o parte de la comisión de rendimiento a los Subasesores con arreglo a su acuerdo de subasesoramiento. El importe de esta comisión de rendimiento depende del rendimiento del Valor liquidativo de la Clase de Acciones correspondiente dentro de la Cartera correspondiente en comparación con el rendimiento del índice de rendimiento correspondiente (el «índice de rendimiento», según la tabla a continuación). Las acumulaciones solo se harán cuando el saldo de la comisión de rendimiento sea positivo y se supere la High Water Mark del VL (que se define a continuación).

Para evitar dudas, el rendimiento de las Clases de Acciones incluye los dividendos pagados.

Cartera	Clases de Acciones	Índice de rendimiento	Tasa de rendimiento
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Acciones A	El Secured Overnight Financing Rate (SOFR) ¹ medio más elevado a 90 días más 1,75% o 1,50%	20%
	Acciones D		
	Acciones I		
	Acciones Z		
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Acciones J	Tipo medio más elevado del Euro Short-Term Rate (€STR) compuesto a 1 mes ² más 1,00% o 1,00%	10%
	Acciones Y		
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Acciones A	El Euro Interbank Offered Rate (EURÍBOR) ³ a 3 meses más elevado más 1,50% o 1,50%	20%
	Acciones D		
	Acciones I		
	Acciones L		
	Acciones Z		

¹ A partir del 1 de septiembre de 2021. Hasta el 31 de agosto de 2021 incluido, el Índice de rendimiento es el LIBOR a 3 meses en USD más elevado más 1,50% o 1,50%. El índice de referencia lo proporciona el Banco de la Reserva Federal de Nueva York. La Sociedad Gestora mantiene un plan escrito en el que se establecen las medidas que se tomarán en caso de que el índice de referencia cambie sustancialmente o deje de cumplirse.

² A partir del 1 de septiembre de 2021. Hasta el 31 de agosto de 2021 incluido, el Índice de rendimiento es el ICE BofA Euro Currency 1-Month Deposit Bid Rate Constant Maturity Index (Local Total Return) más elevado más 1,00% o 1,00%. El Banco Central Europeo (BCE) proporciona el índice de referencia. La Sociedad Gestora mantiene un plan escrito en el que se establecen las medidas que se tomarán en caso de que el índice de referencia cambie sustancialmente o deje de cumplirse.

³ El índice de referencia es proporcionado por European Money Markets Institute, un administrador incluido en el registro de administradores de índices de referencia de la ESMA. La Sociedad Gestora mantiene un plan escrito en el que se establecen las medidas que se tomarán en caso de que el índice de referencia cambie sustancialmente o deje de cumplirse.

El rendimiento de las Carteras Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha, Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities y Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha, incluido el efecto de todas las comisiones aplicables, se compara con el Índice de rendimiento.

High Water Mark del VL: con respecto a cada Clase de Acciones, es el Valor liquidativo de una Acción de dicha Clase de Acciones en la última Fecha de valoración del último año calendario pertinente en el que se pagó cualquier comisión de rendimiento acumulado. Si nunca se ha pagado una comisión de rendimiento, la High Water Mark del VL es el precio inicial de la Clase de Acciones correspondiente.

El saldo de la comisión de rendimiento se calculará sobre la diferencia entre el rendimiento del Índice de rendimiento y el rendimiento de la Clase de Acciones en cuestión (la «Diferencia diaria»):

- (i) en caso de que la Diferencia diaria sea positiva, el saldo de la comisión de rendimiento aumentará en una cantidad con respecto a la Diferencia diaria, a la tasa de rendimiento correspondiente;
- (ii) en caso de que la Diferencia diaria sea negativa, el saldo de la comisión de rendimiento se reducirá en una cantidad con respecto a la Diferencia diaria, a la tasa de rendimiento correspondiente.

Si el saldo de la comisión de rendimiento es positivo al final del año calendario, es decir, a 31 de diciembre, y se supera la High Water Mark del VL, la cantidad acumulada de la comisión de rendimiento se pagará a la Sociedad Gestora dentro del primer trimestre del año calendario siguiente. Solo se pagará una comisión de rendimiento a la Sociedad Gestora si el Valor liquidativo de la Clase de Acciones pertinente supera la High Water Mark del VL y el saldo de la comisión de rendimiento es positivo.

Si al final del año calendario el saldo de la comisión de rendimiento es negativo y no se ha superado la High Water Mark del VL, dicha cantidad negativa se transferirá y la Sociedad Gestora no recibirá el pago de una comisión de rendimiento hasta que el importe de la comisión de rendimiento acumulada sea positivo y se haya excedido la High Water Mark del VL, al final de cualquier año calendario posterior.

Notas a los estados financieros

(continuación)

8 COMISIONES DE RENDIMIENTO

(continuación)

Si al final del año calendario el saldo de la comisión de rendimiento es negativo y se ha superado la High Water Mark del VL, dicha cantidad negativa se transferirá y la Sociedad Gestora no recibirá el pago de una comisión de rendimiento hasta que el importe de la comisión de rendimiento acumulada sea positivo y se haya excedido la High Water Mark del VL, al final de cualquier año calendario posterior.

En el caso de que una Cartera o una Clase de Acciones se liquide o una Cartera o Clase de Acciones quede inactiva, cualquier acumulación de comisiones de rendimiento pendiente se realizará y será pagadera a la Sociedad Gestora. A partir de entonces, cuando nuevos Accionistas hayan invertido en dicha Cartera o Clase de Acciones, se restablecerá el saldo de la comisión de rendimiento.

No se ha establecido ningún valor máximo que se pueda cobrar con respecto a la comisión de rendimiento.

Desde el 31 de marzo de 2022, las comisiones de rendimiento se han pagado de la siguiente manera:

Cartera	Clase de Acciones	Importe por acción en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Clase IU	2.846
	Clase IGH	7.563
	Clase ZGH	12
	Clase ZU	3
		10.424 USD
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Clase AE	128.717
	Clase AEP	559
	Clase AUH	217
	Clase DE	63.450
	Clase IE	226.346
	Clase IGH	7.391
	Clase LE	204.557
	Clase ZE	19.008
	Clase ZFH	617
	Clase ZGH	8
		650.870 EUR

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

A 31 de marzo de 2022, la SICAV tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	19/04/2022	EUR	10.976.067	USD	12.087.778	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	131.526
	19/04/2022	EUR	14.614.761	USD	16.095.017	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	175.129
	19/04/2022	SEK	7.888	USD	824	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	19/04/2022	EUR	2.105.563	USD	2.318.825	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25.231
	19/04/2022	EUR	700.171	USD	771.088	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8.390
	19/04/2022	EUR	13.428.359	USD	14.788.450	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	160.912
	19/04/2022	GBP	19.336.604	USD	25.190.568	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	265.724
	19/04/2022	SEK	9.304.135	USD	971.720	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26.977
	19/04/2022	GBP	360.160	USD	469.195	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.949
	19/04/2022	EUR	31.054.943	USD	34.200.343	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	372.131
	19/04/2022	EUR	1.130.084	USD	1.244.545	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13.542
	19/04/2022	GBP	11.322.464	USD	14.750.226	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	155.593
	19/04/2022	GBP	117.149.987	USD	152.615.974	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.609.875
	19/04/2022	EUR	6.154.776	USD	6.778.162	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	73.753

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond (continuación)								
	19/04/2022	GBP	10.730	USD	13.978	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	147
	19/04/2022	EUR	2.030.945	USD	2.236.649	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24.337
	19/04/2022	GBP	102.973.832	USD	134.148.130	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.415.066
	19/04/2022	NOK	7.918	USD	876	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29
	19/04/2022	NOK	7.949	USD	879	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30
	19/04/2022	CHF	850	USD	907	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/04/2022	CHF	848	USD	905	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/04/2022	EUR	778	USD	856	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/04/2022	USD	31.601	EUR	28.748	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(403)
	19/04/2022	USD	498	EUR	453	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/04/2022	EUR	20.000	USD	21.985	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	280
	19/04/2022	USD	7.434	GBP	5.698	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(68)
	19/04/2022	USD	39.816	GBP	30.518	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(362)
	19/04/2022	USD	11.262	EUR	10.252	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(151)
	19/04/2022	EUR	19.088	USD	20.970	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	281
	19/04/2022	GBP	1.986	USD	2.595	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
	19/04/2022	USD	91.058	GBP	69.694	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(694)
	19/04/2022	USD	20.029	EUR	18.203	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(235)
	19/04/2022	USD	81.126	EUR	73.727	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(951)
	19/04/2022	USD	2.639	GBP	2.016	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	19/04/2022	GBP	2.707	USD	3.545	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	19/04/2022	USD	20.801	EUR	18.707	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(25)
	19/04/2022	USD	81.890	EUR	73.646	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(97)
	19/04/2022	GBP	56.461	USD	74.276	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	53
	19/04/2022	USD	7.391	EUR	6.684	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(50)
	19/04/2022	EUR	4.957	USD	5.482	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	37
	19/04/2022	EUR	499	USD	551	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/04/2022	USD	171.519	GBP	130.260	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	33
	19/04/2022	EUR	130.967	USD	144.909	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	892
	19/04/2022	EUR	174.651	USD	193.244	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.190
	19/04/2022	SEK	94	USD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	25.081	USD	27.751	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	171
	19/04/2022	EUR	8.340	USD	9.228	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	57
	19/04/2022	EUR	161.605	USD	178.809	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.101
	19/04/2022	GBP	232.027	USD	305.351	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	108
	19/04/2022	SEK	111.150	USD	11.802	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	129
	19/04/2022	GBP	4.324	USD	5.690	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/04/2022	EUR	373.333	USD	413.077	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.543
	19/04/2022	EUR	13.604	USD	15.052	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	93
	19/04/2022	GBP	136.051	USD	179.046	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	63
	19/04/2022	GBP	1.407.330	USD	1.852.068	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	656
	19/04/2022	EUR	73.973	USD	81.848	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	504
	19/04/2022	GBP	129	USD	169	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	24.449	USD	27.052	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	167
	19/04/2022	GBP	1.241.301	USD	1.633.572	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	578
	19/04/2022	NOK	93	USD	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	NOK	94	USD	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	CHF	10	USD	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond (continuación)								
	19/04/2022	CHF	10	USD	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	9	USD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	7.000	USD	7.741	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	52
	19/04/2022	GBP	17.238	USD	22.759	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(65)
	19/04/2022	USD	132.571	EUR	120.184	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.226)
	19/04/2022	USD	11.653	EUR	10.564	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(108)
	19/04/2022	EUR	12.185.114	USD	13.440.973	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	124.325
	19/04/2022	USD	795	GBP	599	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/04/2022	USD	53.299	GBP	40.202	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	374
	19/04/2022	EUR	4.825	USD	5.311	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	60
	19/04/2022	EUR	10.801	USD	11.890	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	133
	19/04/2022	GBP	357.337	USD	472.065	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.638)
	19/04/2022	GBP	22.650	USD	29.922	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(104)
	19/04/2022	GBP	58.012	USD	76.637	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(266)
	19/04/2022	EUR	78.419	USD	86.378	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	923
	19/04/2022	EUR	41.735	USD	45.971	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	491
	19/04/2022	USD	1.665	GBP	1.263	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/04/2022	USD	121.041	GBP	91.820	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	163
	19/04/2022	USD	175.933	EUR	160.479	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.721)
	19/04/2022	USD	347.828	EUR	317.274	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.380)
	19/04/2022	USD	12	SEK	116	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	34.408	EUR	31.385	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(532)
	19/04/2022	USD	16.836	EUR	15.357	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(260)
	19/04/2022	USD	217.091	EUR	198.021	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.358)
	19/04/2022	USD	368.175	GBP	279.882	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(285)
	19/04/2022	USD	14.331	SEK	136.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(267)
	19/04/2022	USD	6.783	GBP	5.157	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	19/04/2022	USD	584.443	EUR	533.104	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9.040)
	19/04/2022	USD	18.190	EUR	16.592	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(281)
	19/04/2022	USD	212.936	GBP	161.872	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(165)
	19/04/2022	USD	3.264.359	GBP	2.481.525	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.525)
	19/04/2022	USD	146.625	EUR	133.745	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.268)
	19/04/2022	USD	301	GBP	229	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	48.160	EUR	43.930	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(745)
	19/04/2022	USD	1.927.779	GBP	1.465.473	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.491)
	19/04/2022	USD	13	NOK	113	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	13	NOK	113	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	13	CHF	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	13	CHF	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	12	EUR	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	5.359	EUR	4.876	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(69)
	19/04/2022	USD	30.186	EUR	27.463	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(387)
	19/04/2022	GBP	38.945	USD	51.376	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(105)
	19/04/2022	USD	106.515	EUR	97.044	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.520)
	19/04/2022	USD	49.233	EUR	44.856	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(703)
	19/04/2022	USD	15.366	EUR	14.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(219)
	19/04/2022	USD	26.957	GBP	20.604	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(169)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond (continuación)								
	19/04/2022	USD	38.792	EUR	35.342	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(554)
	19/04/2022	EUR	99.387	USD	110.403	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	242
	19/04/2022	USD	3.070	EUR	2.764	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/04/2022	USD	15.970	GBP	12.159	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(37)
	19/04/2022	USD	5.971	EUR	5.376	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/04/2022	USD	17.742	EUR	15.885	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	58
	19/04/2022	EUR	978	USD	1.093	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/04/2022	GBP	216.252	USD	284.860	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(168)
	19/04/2022	EUR	3.429	USD	3.830	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/04/2022	GBP	3.169	USD	4.174	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/04/2022	USD	237.555	GBP	180.340	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	140
	01/04/2022	AUD	20.513	USD	14.824	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	580
	01/04/2022	USD	1.793.311	JPY	207.140.317	Operaciones comerciales	Barclays	86.697
	01/04/2022	USD	6.975.072	CAD	8.906.307	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(155.389)
	01/04/2022	USD	64.660.841	GBP	48.299.216	Operaciones comerciales	Barclays	1.067.678
	01/04/2022	USD	171.702.217	EUR	152.835.065	Operaciones comerciales	Barclays	1.650.282
	01/04/2022	GBP	1.500.000	USD	2.010.042	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(35.067)
	01/04/2022	AUD	7.933	USD	5.721	Operaciones comerciales	Barclays	236
	01/04/2022	JPY	2.193.576	USD	18.992	Operaciones comerciales	Barclays	(919)
	01/04/2022	USD	7.317	AUD	10.061	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(239)
	01/04/2022	USD	11.215	JPY	1.286.415	Operaciones comerciales	Barclays	617
	01/04/2022	USD	90.251	CAD	114.339	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(1.289)
	01/04/2022	EUR	100.000	USD	111.032	Operaciones comerciales	Barclays	233
	01/04/2022	AUD	5.307	USD	3.853	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	132
	01/04/2022	USD	150.395	CAD	191.262	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(2.731)
	01/04/2022	USD	646.724	GBP	485.776	Operaciones comerciales	Barclays	7.127
	01/04/2022	JPY	28.106.640	USD	243.491	Operaciones comerciales	Barclays	(11.922)
	01/04/2022	USD	8.943	AUD	12.241	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(249)
	01/04/2022	USD	11.032	JPY	1.276.317	Operaciones comerciales	Barclays	516
	01/04/2022	CAD	131.931	USD	104.474	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	1.151
	01/04/2022	EUR	600.000	USD	665.631	Operaciones comerciales	Barclays	1.959
	01/04/2022	GBP	328.792	USD	437.157	Operaciones comerciales	Barclays	(4.253)
	01/04/2022	AUD	9.593	USD	7.054	Operaciones comerciales	Barclays	150
	01/04/2022	USD	37.845	CAD	48.155	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(708)
	01/04/2022	USD	1.129	AUD	1.525	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(16)
	01/04/2022	USD	106.063	CAD	134.905	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(1.943)
	01/04/2022	USD	1.164	AUD	1.594	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(34)
	01/04/2022	USD	9.892	JPY	1.143.054	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	475
	01/04/2022	CAD	86.247	USD	67.213	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	1.837
	01/04/2022	AUD	10.067	USD	7.381	Operaciones comerciales	Barclays	179
	01/04/2022	JPY	1.386.508	USD	11.976	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(552)
	01/04/2022	CAD	158.840	USD	123.894	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	3.274
	01/04/2022	GBP	374.027	USD	492.564	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(101)
	01/04/2022	EUR	918.557	USD	1.009.559	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	12.473
	01/04/2022	AUD	9.139	USD	6.705	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	158
	01/04/2022	CAD	75.440	USD	58.835	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	1.562
	01/04/2022	AUD	5.078	USD	3.715	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	98
	01/04/2022	CAD	64.000	USD	50.140	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	1.099

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond <i>(continuación)</i>								
	01/04/2022	AUD	3.193	USD	2.316	Operaciones comerciales	Barclays	82
	01/04/2022	CAD	71.158	USD	55.775	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	1.195
	01/04/2022	AUD	5.869	USD	4.223	Operaciones comerciales	Barclays	184
	01/04/2022	CAD	201.181	USD	156.567	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	4.500
	01/04/2022	AUD	6.650	USD	4.813	Operaciones comerciales	Barclays	180
	01/04/2022	JPY	1.326.990	USD	11.216	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(283)
	01/04/2022	CAD	52.392	USD	41.203	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	743
	01/04/2022	GBP	617.500	USD	813.463	Operaciones comerciales	Barclays	(432)
	01/04/2022	USD	1.796	AUD	2.450	Operaciones comerciales	Barclays	(43)
	01/04/2022	AUD	1.024	USD	756	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	13
	01/04/2022	AUD	7.127	USD	5.258	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	94
	01/04/2022	AUD	504	USD	374	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	4
	01/04/2022	CAD	144.547	USD	114.843	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	882
	01/04/2022	EUR	2.500.000	USD	2.754.184	Operaciones comerciales	Barclays	27.441
	01/04/2022	USD	440.202	EUR	400.000	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(4.858)
	01/04/2022	AUD	14.104	USD	10.541	Operaciones comerciales	Barclays	51
	01/04/2022	CAD	107.084	USD	85.082	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	650
	01/04/2022	AUD	5.487	USD	4.104	Operaciones comerciales	Barclays	16
	01/04/2022	JPY	935.341	USD	7.689	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	17
	01/04/2022	USD	89.238	CAD	112.218	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(605)
	01/04/2022	USD	747	AUD	994	Operaciones comerciales	Barclays	1
	01/04/2022	CAD	61.400	USD	48.982	Operaciones comerciales	Barclays	176
	01/04/2022	AUD	996	USD	749	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(1)
	01/04/2022	CAD	194.625	USD	155.815	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	3
	01/04/2022	JPY	1.363.760	USD	10.946	Operaciones comerciales	Barclays	290
	06/05/2022	USD	1.410.897	JPY	171.721.422	Operaciones comerciales	Barclays	(4.980)
	03/05/2022	USD	6.618.797	CAD	8.260.540	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	6.338
	03/05/2022	USD	60.462.285	GBP	45.964.673	Operaciones comerciales	Barclays	(45.160)
	03/05/2022	USD	166.087.129	EUR	149.116.508	Operaciones comerciales	Barclays	2.801
	03/05/2022	AUD	95.591	USD	71.852	Operaciones comerciales	Barclays	(38)
	03/05/2022	USD	7.762	AUD	10.355	Operaciones comerciales	Barclays	(17)
	03/05/2022	USD	42.895	CAD	53.721	Operaciones comerciales	Barclays	(109)
	06/05/2022	USD	24.755	JPY	3.016.406	Operaciones comerciales	Barclays	(116)
								7.171.721 USD
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond								
	19/04/2022	NOK	8.103	EUR	814	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
	19/04/2022	NOK	8.147	EUR	818	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
	19/04/2022	CHF	868	EUR	841	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/04/2022	CHF	875	EUR	848	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/04/2022	USD	965	EUR	877	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/04/2022	GBP	694	EUR	820	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	01/04/2022	EUR	9.765.208	USD	10.968.945	Operaciones comerciales	Barclays	(93.188)
	01/04/2022	EUR	1.912.346	GBP	1.603.988	Operaciones comerciales	Lloyds	14.273
	01/04/2022	USD	40.000	EUR	36.023	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(73)
	01/04/2022	EUR	23.057	GBP	19.220	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	313

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond								
<i>(continuación)</i>	01/04/2022	GBP	10.590	EUR	12.777	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(245)
	01/04/2022	GBP	10.435	EUR	12.566	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(217)
	01/04/2022	USD	79.273	EUR	72.733	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(1.486)
	01/04/2022	GBP	9.786	EUR	11.658	Operaciones comerciales	Lloyds	(78)
	01/04/2022	USD	55.250	EUR	50.270	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(614)
	01/04/2022	USD	79.994	EUR	72.704	Operaciones comerciales	Barclays	(809)
	01/04/2022	EUR	69.740	USD	76.984	Operaciones comerciales	Barclays	550
	01/04/2022	USD	58.782	EUR	53.561	Operaciones comerciales	Lloyds	(730)
	03/05/2022	EUR	9.639.847	USD	10.732.630	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	3.708
	03/05/2022	EUR	1.880.691	GBP	1.592.396	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(1.368)
								(79.923) EUR
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond								
	19/04/2022	EUR	4.007	CHF	4.104	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/04/2022	EUR	28	CHF	29	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	10.703	CHF	10.979	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21)
	19/04/2022	SEK	8.120	EUR	770	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/04/2022	SEK	8.160	EUR	774	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/04/2022	USD	2.810.770	EUR	2.552.264	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(27.472)
	19/04/2022	CHF	343.190	EUR	332.401	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.799
	19/04/2022	CHF	125.488	EUR	121.544	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.024
	19/04/2022	CHF	415.108	EUR	402.059	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.386
	19/04/2022	CHF	72.467	EUR	70.189	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	591
	19/04/2022	CHF	891	EUR	863	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/04/2022	CHF	24.549	EUR	23.777	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	200
	19/04/2022	NOK	8.179	EUR	822	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
	19/04/2022	NOK	8.228	EUR	827	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	07/04/2022	GBP	996.510	EUR	1.181.093	Operaciones comerciales	Barclays	(2.177)
	07/04/2022	EUR	169.516	GBP	143.025	Operaciones comerciales	Lloyds	312
	07/04/2022	EUR	178.746	GBP	151.164	Operaciones comerciales	Lloyds	(88)
	07/04/2022	EUR	51.756	USD	56.812	Operaciones comerciales	Lloyds	706
	07/04/2022	EUR	9.661.191	USD	10.714.850	Operaciones comerciales	Barclays	33.022
	07/04/2022	EUR	63.362.646	GBP	52.533.989	Operaciones comerciales	Barclays	1.212.883
	07/04/2022	GBP	208.009	EUR	252.394	Operaciones comerciales	Lloyds	(6.311)
	07/04/2022	GBP	290.387	EUR	349.599	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(6.058)
	07/04/2022	EUR	144.973	GBP	121.780	Operaciones comerciales	Barclays	902
	07/04/2022	EUR	298.201	GBP	250.000	Operaciones comerciales	Barclays	2.440
	07/04/2022	EUR	79.980	USD	88.307	Operaciones comerciales	Barclays	629
	07/04/2022	EUR	221.384	GBP	186.050	Operaciones comerciales	Barclays	1.279
	07/04/2022	EUR	208.826	GBP	174.026	Operaciones comerciales	Barclays	2.946
	07/04/2022	EUR	41.837	USD	46.051	Operaciones comerciales	Barclays	456
	07/04/2022	USD	30.127	EUR	27.419	Operaciones comerciales	Lloyds	(348)
								1.221.168 EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond								
	19/04/2022	NOK	86	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	GBP	8	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	GBP	763.147	EUR	899.783	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.668
	19/04/2022	NOK	87	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SEK	92	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SEK	93	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SEK	8.345	EUR	791	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/04/2022	NOK	8.483	EUR	852	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	19/04/2022	GBP	727	EUR	860	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	GBP	784	EUR	927	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	GBP	71.111.777	EUR	84.094.942	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.493)
	19/04/2022	SEK	8.386	EUR	795	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/04/2022	NOK	8.447	EUR	848	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	19/04/2022	GBP	7.075.632	EUR	8.367.459	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(248)
	19/04/2022	EUR	26	GBP	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	239.084	GBP	199.306	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.399
	07/04/2022	EUR	91.888	GBP	77.992	Operaciones comerciales	Barclays	(381)
	07/04/2022	EUR	1.346.722	USD	1.493.543	Operaciones comerciales	Barclays	4.651
	07/04/2022	EUR	24.459.170	GBP	20.280.573	Operaciones comerciales	Barclays	466.461
	07/04/2022	EUR	7.319	USD	8.065	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	72
	07/04/2022	USD	4.615	EUR	4.258	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(112)
	07/04/2022	GBP	208.620	EUR	251.691	Operaciones comerciales	Barclays	(4.884)
	07/04/2022	GBP	98.206	EUR	118.231	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(2.049)
	07/04/2022	USD	4.267	EUR	3.889	Operaciones comerciales	Barclays	(55)
	07/04/2022	USD	4.915	EUR	4.466	Operaciones comerciales	Barclays	(50)
	07/04/2022	EUR	7.335	USD	8.099	Operaciones comerciales	Barclays	58
	07/04/2022	EUR	79.904	GBP	66.588	Operaciones comerciales	Barclays	1.127
	07/04/2022	EUR	3.761	USD	4.139	Operaciones comerciales	Barclays	41
	07/04/2022	EUR	5.313	USD	5.848	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	58
	07/04/2022	GBP	344.670	EUR	408.561	Operaciones comerciales	Barclays	(801)
								467.526 EUR
Threadneedle (Lux) - European Social Bond								
	19/04/2022	CHF	23.405.316	EUR	22.669.553	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	190.907
	19/04/2022	CHF	348.991	EUR	338.020	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.847
	19/04/2022	GBP	9.034.140	EUR	10.683.539	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(317)
	19/04/2022	SEK	8.073	EUR	766	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/04/2022	NOK	8.134	EUR	817	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
	19/04/2022	GBP	34.687.148	EUR	41.020.121	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.216)
	19/04/2022	USD	14.570	EUR	13.230	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(142)
	19/04/2022	NOK	8.134	EUR	817	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
	19/04/2022	SEK	8.063	EUR	765	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/04/2022	CHF	868	EUR	841	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/04/2022	USD	943	EUR	857	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/04/2022	USD	934	EUR	848	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/04/2022	SGD	942	EUR	627	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - European Social Bond								
<i>(continuación)</i>	19/04/2022	SGD	934	EUR	621	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/04/2022	USD	944	EUR	857	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/04/2022	USD	830.970	EUR	754.546	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.122)
	19/04/2022	SGD	943	EUR	627	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/04/2022	SGD	934	EUR	621	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/04/2022	GBP	3.309	EUR	3.913	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	23.256	GBP	19.595	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	84
	19/04/2022	GBP	136.447	EUR	161.940	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(587)
	19/04/2022	USD	42.967	EUR	39.088	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(492)
	19/04/2022	EUR	8.762	GBP	7.367	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	50
	19/04/2022	GBP	11.000	EUR	13.082	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(74)
	19/04/2022	CHF	393.032	EUR	379.761	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.122
	19/04/2022	GBP	27.402	EUR	32.608	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(204)
	19/04/2022	GBP	4.818	EUR	5.734	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(36)
	19/04/2022	GBP	25.643	EUR	30.339	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15)
	19/04/2022	GBP	39.404	EUR	46.619	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23)
	19/04/2022	GBP	8.697	EUR	10.357	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(72)
	19/04/2022	GBP	5.107	EUR	6.082	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42)
	19/04/2022	EUR	95.353	GBP	79.867	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	908
	19/04/2022	GBP	45.147	EUR	53.901	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(513)
	19/04/2022	GBP	6.054	EUR	7.276	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(117)
	19/04/2022	GBP	110.786	EUR	133.155	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.146)
	19/04/2022	GBP	16.367	EUR	19.640	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(285)
	19/04/2022	GBP	3.975	EUR	4.758	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(57)
	19/04/2022	EUR	24.642	GBP	20.590	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	294
	19/04/2022	GBP	30.539	EUR	36.653	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(539)
	19/04/2022	GBP	1.426.267	EUR	1.711.770	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(25.153)
	19/04/2022	GBP	21.857	EUR	26.053	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(206)
	19/04/2022	GBP	20.753	EUR	24.538	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/04/2022	EUR	57.134	GBP	48.323	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/04/2022	CHF	13.888	EUR	13.488	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	77
	19/04/2022	EUR	94.640	GBP	80.246	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(255)
	19/04/2022	GBP	3.311	EUR	3.904	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
	19/04/2022	EUR	16.939.505	USD	18.653.760	Operaciones comerciales	HSBC	183.749
	19/04/2022	EUR	548.029	SEK	5.710.785	Operaciones comerciales	HSBC	(2.594)
	19/04/2022	EUR	764.657	CAD	1.069.441	Operaciones comerciales	HSBC	(4.371)
	19/04/2022	EUR	33.542.271	GBP	28.184.702	Operaciones comerciales	HSBC	212.905
	19/04/2022	GBP	1.037.430	EUR	1.226.418	Operaciones comerciales	HSBC	383
	19/04/2022	GBP	1.217.320	EUR	1.447.826	Operaciones comerciales	HSBC	(8.298)
	19/04/2022	CAD	7.253	EUR	5.233	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(18)
	19/04/2022	EUR	161.201	GBP	134.400	Operaciones comerciales	HSBC	2.270
	19/04/2022	SEK	36.863	EUR	3.536	Operaciones comerciales	HSBC	18
	19/04/2022	SEK	34.112	EUR	3.286	Operaciones comerciales	HSBC	3
	19/04/2022	GBP	350.000	EUR	419.938	Operaciones comerciales	HSBC	(6.049)
	19/04/2022	SEK	34.958	EUR	3.382	Operaciones comerciales	HSBC	(12)
	19/04/2022	EUR	717.762	GBP	600.000	Operaciones comerciales	HSBC	8.244

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - European Social Bond								
<i>(continuación)</i>	19/04/2022	CAD	10.595	EUR	7.715	Operaciones comerciales	HSBC	(96)
	19/04/2022	SEK	29.327	EUR	2.834	Operaciones comerciales	HSBC	(7)
	19/04/2022	EUR	89.693	USD	100.019	Operaciones comerciales	HSBC	(150)
	19/04/2022	SEK	38.640	EUR	3.735	Operaciones comerciales	HSBC	(9)
	19/04/2022	EUR	180.794	GBP	152.969	Operaciones comerciales	HSBC	(98)
								544.590 EUR
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond								
	19/04/2022	USD	969	EUR	880	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/04/2022	USD	958	EUR	870	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/04/2022	SEK	8.230	EUR	781	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/04/2022	NOK	8.271	EUR	831	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	19/04/2022	NOK	8.323	EUR	836	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	12/04/2022	EUR	33.151.013	GBP	28.010.120	Operaciones comerciales	Lloyds	19.700
	12/04/2022	EUR	34.285.188	USD	39.233.501	Operaciones comerciales	Lloyds	(964.355)
	12/04/2022	EUR	109.298	AUD	175.664	Operaciones comerciales	Lloyds	(9.238)
	12/04/2022	USD	181.194	EUR	158.817	Operaciones comerciales	Barclays	3.976
	12/04/2022	USD	1.299.505	EUR	1.147.431	Operaciones comerciales	UBS	20.105
	12/04/2022	USD	7.818.665	GBP	5.785.561	Operaciones comerciales	Lloyds	181.375
	12/04/2022	USD	173.571	EUR	152.539	Operaciones comerciales	UBS	3.405
	12/04/2022	EUR	65.110	USD	74.078	Operaciones comerciales	Barclays	(1.446)
	12/04/2022	EUR	256.456	USD	290.900	Operaciones comerciales	HSBC	(4.904)
	12/04/2022	USD	115.126	EUR	103.186	Operaciones comerciales	Barclays	248
	12/04/2022	USD	93.059	EUR	82.658	Operaciones comerciales	UBS	950
	12/04/2022	GBP	78.226	EUR	93.133	Operaciones comerciales	HSBC	(605)
	12/04/2022	EUR	85.181	USD	95.350	Operaciones comerciales	HSBC	(486)
	12/04/2022	GBP	48.532	EUR	58.175	Operaciones comerciales	HSBC	(770)
	12/04/2022	EUR	51.015	USD	56.626	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	140
	12/04/2022	GBP	3.238.776	EUR	3.882.816	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(51.881)
	12/04/2022	USD	156.609	EUR	141.246	Operaciones comerciales	HSBC	(541)
	12/04/2022	GBP	105.141	EUR	126.820	Operaciones comerciales	Barclays	(2.456)
	12/04/2022	USD	158.648	EUR	145.183	Operaciones comerciales	Barclays	(2.646)
	12/04/2022	GBP	141.033	EUR	169.428	Operaciones comerciales	Barclays	(2.610)
	12/04/2022	USD	138.657	EUR	126.573	Operaciones comerciales	Lloyds	(1.997)
	12/04/2022	GBP	62.432	EUR	74.825	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(979)
	12/04/2022	EUR	531.648	USD	583.749	Operaciones comerciales	HSBC	7.183
	12/04/2022	USD	200.000	EUR	181.093	Operaciones comerciales	HSBC	(1.404)
	12/04/2022	GBP	910.000	EUR	1.083.825	Operaciones comerciales	HSBC	(7.445)
	12/04/2022	EUR	197.091	USD	218.032	Operaciones comerciales	Barclays	1.201
	12/04/2022	EUR	74.450	GBP	62.563	Operaciones comerciales	Barclays	449
	12/04/2022	EUR	772.355	USD	850.436	Operaciones comerciales	HSBC	8.286
	12/04/2022	EUR	67.854	USD	74.595	Operaciones comerciales	HSBC	834
	12/04/2022	EUR	149.577	USD	166.991	Operaciones comerciales	Lloyds	(456)
	12/04/2022	EUR	74.493	GBP	63.182	Operaciones comerciales	Barclays	(240)
								(806.574) EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds								
	19/04/2022	EUR	5.109.465	USD	5.626.977	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	61.227
	19/04/2022	EUR	1.953.376	USD	2.151.224	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23.407
	19/04/2022	EUR	11.451.518	USD	12.611.385	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	137.224
	19/04/2022	SGD	98.034	USD	71.747	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	685
	19/04/2022	EUR	4.359.980	USD	4.801.581	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	52.246
	19/04/2022	EUR	143.623	USD	158.170	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.721
	19/04/2022	EUR	361.217	USD	397.803	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.328
	19/04/2022	SEK	7.576	USD	791	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
	19/04/2022	NOK	7.611	USD	842	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	28
	19/04/2022	EUR	1.641.265	USD	1.807.500	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19.667
	19/04/2022	EUR	827	USD	909	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
	19/04/2022	USD	8.313	EUR	7.563	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(106)
	19/04/2022	EUR	165	USD	181	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/04/2022	EUR	873	USD	959	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/04/2022	USD	16.111	EUR	14.665	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(216)
	19/04/2022	EUR	520	USD	572	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/04/2022	USD	10.217	EUR	9.285	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(120)
	19/04/2022	EUR	95	USD	105	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	EUR	40	USD	45	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	5.367	EUR	4.826	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/04/2022	USD	8.291	EUR	7.456	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
	19/04/2022	USD	1.094	EUR	989	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/04/2022	EUR	1.725	USD	1.907	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/04/2022	EUR	254	USD	281	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/04/2022	EUR	57.216	USD	62.902	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	795
	19/04/2022	EUR	21.833	USD	24.003	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	303
	19/04/2022	EUR	129.844	USD	142.748	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.803
	19/04/2022	SGD	1.098	USD	808	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/04/2022	EUR	48.433	USD	53.246	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	673
	19/04/2022	EUR	1.618	USD	1.779	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
	19/04/2022	EUR	4.037	USD	4.439	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	56
	19/04/2022	SEK	85	USD	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	NOK	85	USD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	18.630	USD	20.481	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	259
	19/04/2022	EUR	9.985	USD	11.042	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	74
	19/04/2022	EUR	5.000	USD	5.529	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	37
	19/04/2022	EUR	792	USD	876	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/04/2022	USD	3.261	EUR	2.949	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(22)
	19/04/2022	USD	9.222	EUR	8.361	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(85)
	19/04/2022	EUR	136.417	USD	150.183	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.685
	19/04/2022	EUR	10.050	USD	11.064	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	124
	19/04/2022	USD	2.699	EUR	2.456	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(35)
	19/04/2022	USD	25.490	EUR	23.190	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(327)
	19/04/2022	EUR	1.000	USD	1.098	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
	19/04/2022	USD	2.521	EUR	2.297	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(36)
	19/04/2022	EUR	680	USD	747	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
	19/04/2022	EUR	3.100	USD	3.403	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	49

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds								
<i>(continuación)</i>	19/04/2022	EUR	20	USD	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	8.510	USD	9.453	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21
	19/04/2022	USD	85	EUR	76	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	10.000	USD	11.108	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24
	19/04/2022	USD	1.515	EUR	1.356	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/04/2022	EUR	18.798	USD	20.996	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(69)
	19/04/2022	EUR	3	USD	4	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								305.532 USD
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt								
	19/04/2022	EUR	186.592	USD	205.491	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.236
	19/04/2022	EUR	311.764	USD	343.341	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.736
	19/04/2022	EUR	471.572	USD	519.335	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.651
	19/04/2022	EUR	406.769	USD	447.968	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.874
	19/04/2022	SGD	26.812	USD	19.622	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	187
	19/04/2022	SEK	7.362	USD	769	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21
	19/04/2022	NOK	7.437	USD	823	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	28
	19/04/2022	EUR	2.823	USD	3.120	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
	19/04/2022	EUR	4.718	USD	5.215	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	37
	19/04/2022	EUR	7.157	USD	7.911	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	56
	19/04/2022	EUR	6.155	USD	6.805	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	48
	19/04/2022	SGD	402	USD	297	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	SEK	110	USD	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	NOK	111	USD	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	18.170	EUR	16.531	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(233)
	19/04/2022	USD	5.031	EUR	4.568	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(54)
	19/04/2022	EUR	6.834	USD	7.611	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/04/2022	SGD	278	USD	205	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	NOK	77	USD	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	9.990	USD	11.158	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(37)
	19/04/2022	USD	25.185	EUR	22.548	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	82
	29/04/2022	USD	483.578	MXN	10.095.000	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(20.193)
	29/04/2022	USD	1.015.667	EUR	884.421	Operaciones comerciales	Lloyds	30.746
								27.205 USD
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds								
	19/04/2022	EUR	1.047.792	USD	1.153.917	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12.556
	19/04/2022	EUR	2.740.230	USD	3.017.774	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	32.836
	19/04/2022	EUR	12.065.503	USD	13.287.558	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	144.581
	19/04/2022	EUR	11.339.509	USD	12.488.031	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	135.881
	19/04/2022	SGD	168.330	USD	123.193	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.176
	19/04/2022	SGD	877.239	USD	642.012	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.127
	19/04/2022	SEK	7.627	USD	797	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds								
<i>(continuación)</i>	19/04/2022	EUR	158.159	USD	174.178	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.895
	19/04/2022	NOK	7.639	USD	845	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	28
	19/04/2022	SGD	199	USD	146	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	USD	647	EUR	588	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	19/04/2022	SGD	5.265	USD	3.884	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/04/2022	SGD	9.918	USD	7.324	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/04/2022	USD	438.992	SGD	594.441	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(205)
	19/04/2022	EUR	11.380	USD	12.591	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	78
	19/04/2022	EUR	29.815	USD	32.989	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	203
	19/04/2022	EUR	132.273	USD	146.354	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	901
	19/04/2022	EUR	123.378	USD	136.512	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	840
	19/04/2022	SGD	1.881	USD	1.388	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/04/2022	SEK	82	USD	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	1.733	USD	1.917	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
	19/04/2022	NOK	82	USD	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	31	EUR	28	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	7.542	EUR	6.838	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(70)
	19/04/2022	USD	93.111	EUR	84.577	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.042)
	19/04/2022	EUR	20.766	USD	22.873	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	244
	19/04/2022	USD	22.981	EUR	20.863	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(245)
	19/04/2022	USD	130.379	EUR	118.927	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.017)
	19/04/2022	USD	97.546	EUR	88.746	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.251)
	19/04/2022	SGD	693	USD	511	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/04/2022	USD	1.001	EUR	912	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	19/04/2022	USD	974	EUR	877	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/04/2022	EUR	139.081	USD	154.892	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(57)
	19/04/2022	USD	519.728	EUR	465.320	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.702
	19/04/2022	EUR	483	USD	539	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/04/2022	USD	1.841	SGD	2.490	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
								334.184 USD
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond								
	19/04/2022	EUR	573.448	USD	631.529	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.872
	19/04/2022	EUR	630.209	USD	694.040	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7.552
	19/04/2022	EUR	63.016.278	USD	69.398.882	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	755.124
	19/04/2022	SGD	649.789	USD	475.552	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.538
	19/04/2022	EUR	261.647	USD	288.148	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.135
	19/04/2022	EUR	246.539	USD	271.510	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.954
	19/04/2022	SEK	8.032	USD	839	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	19/04/2022	SEK	8.113	USD	847	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24
	19/04/2022	CHF	874	USD	932	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
	19/04/2022	GBP	686	USD	894	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/04/2022	EUR	46.028	USD	50.690	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	552
	19/04/2022	EUR	776	USD	854	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/04/2022	NOK	8.116	USD	898	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond (continuación)								
	19/04/2022	NOK	8.170	USD	904	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30
	19/04/2022	SGD	1.235.064	USD	903.888	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8.626
	19/04/2022	USD	1.536	SGD	2.096	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
	19/04/2022	USD	110	EUR	100	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/04/2022	SGD	12.829	USD	9.406	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	73
	19/04/2022	SGD	262	USD	192	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/04/2022	SGD	2.779	USD	2.034	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	19/04/2022	SGD	108	USD	80	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SGD	1.793	USD	1.318	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/04/2022	EUR	10.257	USD	11.375	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	44
	19/04/2022	EUR	11.262	USD	12.490	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	48
	19/04/2022	EUR	1.131.834	USD	1.255.193	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.842
	19/04/2022	SGD	11.611	USD	8.571	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/04/2022	EUR	4.677	USD	5.187	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
	19/04/2022	EUR	4.403	USD	4.883	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	19/04/2022	SEK	142	USD	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SEK	145	USD	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	CHF	16	USD	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	GBP	12	USD	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	825	USD	915	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/04/2022	EUR	14	USD	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	NOK	143	USD	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	NOK	145	USD	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SGD	22.527	USD	16.629	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
	19/04/2022	USD	25.052	EUR	22.530	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30)
	19/04/2022	USD	28.143	SGD	38.109	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/04/2022	SGD	15.592	USD	11.514	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/04/2022	USD	71	EUR	64	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	48.761	SGD	66.132	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(100)
	19/04/2022	SGD	46.458	USD	34.255	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	70
	19/04/2022	USD	62.211	SGD	84.314	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(83)
	19/04/2022	SGD	21.619	USD	15.952	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21
	19/04/2022	EUR	127	USD	140	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	USD	2.555	SGD	3.469	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	19/04/2022	SGD	12.832	USD	9.450	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30
	19/04/2022	SGD	700	USD	516	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/04/2022	SGD	15.516	USD	11.428	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	36
	19/04/2022	SGD	14	USD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	35.298	EUR	32.045	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(377)
	19/04/2022	SGD	10.578	USD	7.791	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24
	19/04/2022	USD	3.383	EUR	3.086	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(52)
	19/04/2022	USD	2.973	EUR	2.712	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(46)
	19/04/2022	USD	10	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	11.437	SGD	15.568	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(65)
	19/04/2022	USD	17.549	EUR	15.966	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(225)
	19/04/2022	USD	30.843	EUR	28.060	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(395)
	19/04/2022	USD	8.959	SGD	12.170	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32)
	19/04/2022	USD	174	EUR	159	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond								
<i>(continuación)</i>	19/04/2022	USD	94	SGD	128	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/04/2022	SGD	18.172	USD	13.348	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	78
	19/04/2022	SGD	49	USD	36	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SGD	9.827	USD	7.247	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/04/2022	SGD	19.966	USD	14.760	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	19/04/2022	EUR	2.478	USD	2.770	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/04/2022	EUR	2.277	USD	2.545	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
	19/04/2022	EUR	8	USD	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SGD	15.402	USD	11.387	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
								793.399 USD
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond								
	19/04/2022	EUR	1.054.313	USD	1.161.099	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12.634
	19/04/2022	SGD	621.702	USD	454.996	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.342
	19/04/2022	SGD	47.527	USD	34.783	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	332
	19/04/2022	EUR	703.596	USD	774.859	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8.431
	19/04/2022	EUR	13.243.571	USD	14.584.946	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	158.698
	19/04/2022	GBP	659	USD	858	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/04/2022	SGD	1.236	USD	905	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/04/2022	AUD	1.067	USD	767	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	34
	19/04/2022	AUD	921	USD	663	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29
	19/04/2022	SEK	7.735	USD	808	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
	19/04/2022	USD	36.845	SGD	50.255	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(286)
	19/04/2022	SGD	200	USD	147	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	EUR	19.084	USD	20.978	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	268
	19/04/2022	USD	24.370	EUR	22.184	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(326)
	19/04/2022	USD	2.269	SGD	3.100	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21)
	19/04/2022	EUR	9.545	USD	10.486	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	140
	19/04/2022	SGD	1.240	USD	911	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/04/2022	USD	4.615	EUR	4.194	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(54)
	19/04/2022	USD	2.156	SGD	2.919	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/04/2022	EUR	9.428	USD	10.484	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
	19/04/2022	USD	7.452	EUR	6.739	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(50)
	19/04/2022	SGD	261.563	USD	192.860	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	394
	19/04/2022	USD	1.238	EUR	1.119	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	19/04/2022	SGD	43.582	USD	32.157	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	43
	19/04/2022	USD	69	SGD	93	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	5.925	USD	6.552	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	44
	19/04/2022	USD	582	SGD	790	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/04/2022	USD	5.616	SGD	7.626	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	19/04/2022	EUR	56.320	USD	62.125	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	575
	19/04/2022	USD	26	SGD	35	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SGD	171	USD	126	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	31.763	EUR	28.852	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(356)
	19/04/2022	USD	1.195	SGD	1.622	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/04/2022	SGD	180	USD	133	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SGD	242	USD	178	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond (continuación)								
	19/04/2022	SGD	87	USD	64	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	9.127	USD	10.032	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	129
	19/04/2022	USD	2.372	SGD	3.229	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	19/04/2022	EUR	12.005	USD	13.176	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	188
	19/04/2022	SGD	710	USD	523	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	USD	2.392	EUR	2.153	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	19/04/2022	USD	6	SGD	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SGD	10	USD	7	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	11.792	USD	13.171	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(43)
	19/04/2022	EUR	17.983	USD	20.101	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(81)
	19/04/2022	SGD	13.416	USD	9.918	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/04/2022	SGD	645	USD	477	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	12.361	USD	13.817	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(56)
	19/04/2022	EUR	239.211	USD	267.386	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.080)
	19/04/2022	GBP	12	USD	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SGD	23	USD	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	AUD	19	USD	14	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	AUD	13	USD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SEK	138	USD	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	29/04/2022	PHP	24.131.185	USD	467.152	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(2.240)
	29/04/2022	USD	1.991.836	CNY	12.750.337	Operaciones comerciales	Barclays	(12.914)
	29/04/2022	USD	1.537.332	SGD	2.067.860	Operaciones comerciales	Barclays	9.573
	29/04/2022	USD	915.066	THB	30.172.944	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	7.493
	29/04/2022	MYR	1.265.571	USD	301.865	Operaciones comerciales	Barclays	(1.691)
	29/04/2022	USD	1.718.414	CNY	10.985.618	Operaciones comerciales	UBS	(8.860)
								175.291 USD
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return								
	07/06/2022	JPY	85.065.000	EUR	664.531	Operaciones comerciales	Barclays	(35.170)
	07/06/2022	EUR	2.113.278	GBP	1.780.000	Operaciones comerciales	Barclays	13.092
	07/06/2022	EUR	499.203	USD	553.000	Operaciones comerciales	Barclays	3.506
	07/06/2022	AUD	1.030.000	EUR	681.680	Operaciones comerciales	Barclays	12.482
	07/06/2022	EUR	11.761	GBP	10.000	Operaciones comerciales	Barclays	(38)
								(6.128) EUR
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return								
	19/04/2022	EUR	8.218.884	USD	9.051.334	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	98.487
	19/04/2022	EUR	2.036.742	USD	2.243.034	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24.406
	19/04/2022	EUR	808.647	USD	890.550	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9.690
	19/04/2022	GBP	335.629	USD	437.237	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.612
	19/04/2022	EUR	768	USD	846	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/04/2022	SEK	7.723	USD	807	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
	19/04/2022	USD	15.936	EUR	14.497	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(203)
	19/04/2022	USD	3.692	EUR	3.361	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(49)
	19/04/2022	EUR	5.584	USD	6.144	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	72

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return								
<i>(continuación)</i>	19/04/2022	EUR	251.707	USD	279.141	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.077
	19/04/2022	EUR	62.378	USD	69.177	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	267
	19/04/2022	EUR	24.809	USD	27.513	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	106
	19/04/2022	GBP	10.379	USD	13.655	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/04/2022	EUR	24	USD	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SEK	236	USD	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	138	USD	152	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/04/2022	EUR	28	USD	30	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	23.071	EUR	20.990	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(296)
	19/04/2022	USD	15.910	EUR	14.475	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(204)
	19/04/2022	USD	7.141	EUR	6.393	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	19/04/2022	EUR	45	USD	50	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	07/06/2022	JPY	464.140.000	USD	4.016.752	Operaciones comerciales	Barclays	(185.869)
	07/06/2022	AUD	1.480.000	USD	1.085.021	Operaciones comerciales	Lloyds	27.700
								(20.139) USD
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income								
	19/04/2022	EUR	12.531.836	USD	13.801.123	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	150.169
	19/04/2022	SGD	6.870	USD	5.028	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	48
	19/04/2022	EUR	195.165	USD	214.933	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.339
	19/04/2022	CHF	880	USD	939	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
	19/04/2022	EUR	34.851.085	USD	38.380.977	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	417.621
	19/04/2022	EUR	19.136.907	USD	21.075.189	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	229.318
	19/04/2022	EUR	782	USD	862	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/04/2022	EUR	2.493.614	USD	2.746.180	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29.881
	19/04/2022	SGD	168.380	USD	123.230	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.176
	19/04/2022	USD	5.049	EUR	4.593	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(64)
	19/04/2022	USD	3.158	EUR	2.873	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40)
	19/04/2022	USD	10.795	EUR	9.826	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(144)
	19/04/2022	USD	112.626	EUR	102.521	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.507)
	19/04/2022	EUR	99	USD	108	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	USD	45.284	EUR	41.153	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(531)
	19/04/2022	EUR	296.046	USD	328.312	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.267
	19/04/2022	SGD	163	USD	120	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	4.622	USD	5.126	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
	19/04/2022	CHF	21	USD	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	821.561	USD	911.103	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.515
	19/04/2022	EUR	450.797	USD	499.930	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.929
	19/04/2022	EUR	19	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	58.729	USD	65.130	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	251
	19/04/2022	SGD	3.992	USD	2.947	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/04/2022	USD	2.797	EUR	2.516	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/04/2022	EUR	150	USD	166	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	USD	9.923	EUR	8.973	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(67)
	19/04/2022	USD	5.444	EUR	4.923	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(37)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income								
<i>(continuación)</i>								
	19/04/2022	USD	15.058	EUR	13.617	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(101)
	19/04/2022	USD	42.055	EUR	38.030	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(282)
	19/04/2022	USD	4.409	EUR	3.997	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(41)
	19/04/2022	USD	17.705	EUR	16.051	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(164)
	19/04/2022	USD	3.566	EUR	3.239	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40)
	19/04/2022	USD	35.919	EUR	32.609	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(384)
	19/04/2022	USD	10.087	EUR	9.158	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(108)
	19/04/2022	USD	13	EUR	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	4.885	USD	5.369	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	69
	19/04/2022	USD	38.724	EUR	35.230	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(496)
	19/04/2022	USD	16.907	EUR	15.382	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(217)
	19/04/2022	SGD	224	USD	165	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	USD	11.493	EUR	10.471	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(164)
	19/04/2022	USD	152	EUR	139	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/04/2022	USD	2.176	EUR	1.983	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(31)
	19/04/2022	USD	99.983	EUR	90.007	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(219)
	19/04/2022	USD	13.412	EUR	12.074	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(29)
	19/04/2022	USD	33.628	EUR	30.273	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(74)
	19/04/2022	EUR	5.990	USD	6.691	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(22)
	19/04/2022	EUR	8.017	USD	8.955	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(29)
	19/04/2022	SGD	1.218	USD	900	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	12/04/2022	SGD	16.213	USD	12.056	Operaciones comerciales	HSBC	(77)
	12/04/2022	CNY	2.960.051	USD	463.145	Operaciones comerciales	Barclays	2.788
	12/04/2022	KRW	79.474.929	USD	66.183	Operaciones comerciales	HSBC	(696)
	12/04/2022	IDR	355.453.455	USD	24.595	Operaciones comerciales	HSBC	163
	12/04/2022	RUB	793.606	USD	10.331	Operaciones comerciales	UBS	(785)
	12/04/2022	THB	602.030	USD	18.288	Operaciones comerciales	HSBC	(181)
	12/04/2022	SEK	215.418	USD	23.584	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(464)
	12/04/2022	JPY	55.039.397	USD	477.634	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(24.072)
	12/04/2022	CAD	30.011	USD	23.620	Operaciones comerciales	UBS	406
	12/04/2022	USD	212.273	GBP	156.750	Operaciones comerciales	Lloyds	5.907
	12/04/2022	EUR	637.422	USD	729.382	Operaciones comerciales	HSBC	(19.911)
	12/04/2022	AUD	53.268	USD	37.936	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	2.071
	12/04/2022	USD	765	ZAR	11.901	Operaciones comerciales	Lloyds	(49)
	12/04/2022	NOK	65.310	USD	7.405	Operaciones comerciales	HSBC	63
	12/04/2022	MXN	2.152.265	USD	103.170	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	4.534
	12/04/2022	CHF	28.256	USD	30.659	Operaciones comerciales	HSBC	58
	12/04/2022	NZD	14.125	USD	9.357	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	466
	12/04/2022	GBP	3.152	USD	4.269	Operaciones comerciales	HSBC	(119)
	12/04/2022	USD	3.171	EUR	2.780	Operaciones comerciales	HSBC	77
	12/04/2022	CNY	11.966	USD	1.873	Operaciones comerciales	HSBC	10
	12/04/2022	USD	8.102	JPY	931.855	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	423
	12/04/2022	EUR	3.887	USD	4.400	Operaciones comerciales	HSBC	(73)
	12/04/2022	ZAR	11.901	USD	790	Operaciones comerciales	UBS	24
	12/04/2022	USD	1.544	MXN	31.599	Operaciones comerciales	HSBC	(37)
	12/04/2022	JPY	339.839	USD	2.961	Operaciones comerciales	HSBC	(161)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income								
<i>(continuación)</i>								
	12/04/2022	USD	1.570	CNY	9.983	Operaciones comerciales	HSBC	(1)
	12/04/2022	USD	2.716	GBP	1.993	Operaciones comerciales	UBS	92
	12/04/2022	EUR	1.706	USD	1.941	Operaciones comerciales	HSBC	(42)
	12/04/2022	EUR	48.968	USD	55.602	Operaciones comerciales	HSBC	(1.099)
	12/04/2022	USD	95.747	JPY	11.012.013	Operaciones comerciales	HSBC	4.999
	12/04/2022	USD	79.789	GBP	58.746	Operaciones comerciales	UBS	2.449
	12/04/2022	USD	55.126	GBP	40.666	Operaciones comerciales	UBS	1.588
	12/04/2022	USD	1.513	JPY	174.530	Operaciones comerciales	Barclays	74
	01/04/2022	USD	47.629	JPY	5.501.469	Operaciones comerciales	Barclays	2.303
	01/04/2022	USD	86.580	CAD	110.552	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(1.929)
	01/04/2022	USD	1.507.467	GBP	1.126.093	Operaciones comerciales	Lloyds	24.797
	01/04/2022	USD	5.068.704	EUR	4.513.399	Operaciones comerciales	HSBC	46.870
	12/04/2022	USD	2.166	GBP	1.618	Operaciones comerciales	HSBC	36
	01/04/2022	GBP	22.411	USD	30.000	Operaciones comerciales	Barclays	(493)
	01/04/2022	JPY	57.028	USD	494	Operaciones comerciales	Barclays	(24)
	01/04/2022	EUR	25.000	USD	28.093	Operaciones comerciales	Barclays	(277)
	01/04/2022	USD	290	JPY	33.230	Operaciones comerciales	Barclays	16
	01/04/2022	USD	2.080	CAD	2.635	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(30)
	12/04/2022	JPY	433.731	USD	3.779	Operaciones comerciales	HSBC	(205)
	12/04/2022	USD	1.764	CAD	2.235	Operaciones comerciales	HSBC	(25)
	12/04/2022	USD	2.951	GBP	2.199	Operaciones comerciales	HSBC	56
	01/04/2022	USD	3.619	CAD	4.602	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(66)
	01/04/2022	USD	12.178	GBP	9.147	Operaciones comerciales	Barclays	134
	12/04/2022	USD	3.562	GBP	2.677	Operaciones comerciales	HSBC	38
	12/04/2022	EUR	2.425	USD	2.692	Operaciones comerciales	HSBC	7
	07/04/2022	USD	6.087.144	GBP	4.551.552	Operaciones comerciales	Barclays	94.722
	07/04/2022	USD	33.247.077	EUR	29.983.345	Operaciones comerciales	HSBC	(120.285)
	01/04/2022	GBP	5.660	USD	7.574	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(122)
	01/04/2022	USD	272	JPY	31.458	Operaciones comerciales	Barclays	13
	01/04/2022	CAD	2.951	USD	2.337	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	26
	12/04/2022	GBP	1.854	USD	2.480	Operaciones comerciales	UBS	(39)
	12/04/2022	USD	2.505	EUR	2.259	Operaciones comerciales	HSBC	(10)
	07/04/2022	USD	135.982	GBP	102.830	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	599
	07/04/2022	USD	431.873	EUR	395.470	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(8.230)
	01/04/2022	USD	894	CAD	1.138	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(17)
	12/04/2022	GBP	134.547	EUR	162.620	Operaciones comerciales	HSBC	(3.865)
	12/04/2022	USD	50.125	MXN	1.056.771	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(2.764)
	07/04/2022	GBP	24.334	USD	32.008	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	29
	07/04/2022	EUR	157.784	USD	171.001	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	4.592
	01/04/2022	USD	2.725	CAD	3.466	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(50)
	07/04/2022	EUR	312.156	USD	340.113	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	7.274
	07/04/2022	GBP	31.558	USD	41.423	Operaciones comerciales	UBS	126
	01/04/2022	USD	304	JPY	35.183	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	15
	01/04/2022	CAD	1.845	USD	1.438	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	39
	01/04/2022	GBP	7.663	USD	10.058	Operaciones comerciales	UBS	31
	07/04/2022	EUR	83.179	USD	91.438	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	1.129

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income (continuación)								
	07/04/2022	EUR	101.920	USD	112.080	Operaciones comerciales	Lloyds	1.343
	07/04/2022	EUR	104.990	USD	116.068	Operaciones comerciales	Lloyds	771
	01/04/2022	JPY	42.636	USD	368	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(17)
	01/04/2022	CAD	4.066	USD	3.172	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	84
	01/04/2022	GBP	6.486	USD	8.542	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(2)
	01/04/2022	EUR	25.222	USD	27.721	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	342
	07/06/2022	USD	3.307.465	GBP	2.515.000	Operaciones comerciales	HSBC	(2.965)
	07/04/2022	USD	132.689	EUR	120.160	Operaciones comerciales	Lloyds	(1.033)
	07/04/2022	EUR	200.000	USD	220.950	Operaciones comerciales	Lloyds	1.623
	01/04/2022	CAD	1.938	USD	1.511	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	40
	01/04/2022	CAD	1.598	USD	1.252	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	27
	12/04/2022	USD	1.486	CNY	9.451	Operaciones comerciales	HSBC	(2)
	12/04/2022	USD	1.785	CHF	1.661	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(21)
	12/04/2022	EUR	4.502	USD	4.955	Operaciones comerciales	HSBC	55
	07/04/2022	USD	15.211	GBP	11.667	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(150)
	01/04/2022	CAD	1.573	USD	1.233	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	26
	07/04/2022	USD	97.893	GBP	75.000	Operaciones comerciales	Lloyds	(850)
	01/04/2022	GBP	5.841	USD	7.615	Operaciones comerciales	Lloyds	76
	01/04/2022	CAD	5.016	USD	3.904	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	112
	07/04/2022	GBP	18.145	USD	23.710	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	179
	07/04/2022	EUR	113.591	USD	125.072	Operaciones comerciales	Lloyds	1.339
	01/04/2022	JPY	40.806	USD	345	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(9)
	01/04/2022	CAD	1.271	USD	1.000	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	18
	07/04/2022	USD	140.109	EUR	126.850	Operaciones comerciales	HSBC	(1.058)
	07/04/2022	USD	187.794	EUR	170.123	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(1.530)
	07/04/2022	USD	36.019	GBP	27.412	Operaciones comerciales	HSBC	(72)
	07/04/2022	USD	183.764	EUR	166.949	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(2.027)
	07/04/2022	USD	23.649	GBP	17.903	Operaciones comerciales	Lloyds	78
	01/04/2022	CAD	3.936	USD	3.128	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	24
	07/04/2022	USD	218.894	EUR	198.860	Operaciones comerciales	Lloyds	(2.409)
	01/04/2022	CAD	2.561	USD	2.035	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	16
	12/04/2022	USD	2.206	EUR	2.004	Operaciones comerciales	HSBC	(25)
	07/04/2022	USD	131.816	GBP	100.000	Operaciones comerciales	Barclays	159
	01/04/2022	JPY	33.310	USD	274	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	1
	01/04/2022	USD	2.096	CAD	2.636	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(14)
	01/04/2022	JPY	967.150	USD	7.924	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	44
	01/04/2022	CAD	1.412	USD	1.126	Operaciones comerciales	Barclays	4
	07/04/2022	EUR	80.398	USD	88.343	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	1.129
	01/04/2022	CAD	4.709	USD	3.770	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	0
	01/04/2022	JPY	29.548	USD	237	Operaciones comerciales	Barclays	6
	12/04/2022	GBP	1.549	USD	2.038	Operaciones comerciales	Barclays	2
	07/04/2022	GBP	101.370	USD	132.731	Operaciones comerciales	UBS	730
	12/04/2022	USD	34.882	JPY	4.313.537	Operaciones comerciales	HSBC	(664)
	07/04/2022	USD	97.785	EUR	87.814	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	60
	07/04/2022	USD	24.949	GBP	19.010	Operaciones comerciales	UBS	(79)
	06/05/2022	USD	35.612	JPY	4.334.518	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(127)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income <i>(continuación)</i>								
	03/05/2022	USD	75.792	CAD	94.611	Operaciones comerciales	UBS	57
	03/05/2022	USD	1.429.580	GBP	1.087.179	Operaciones comerciales	Lloyds	(1.570)
	03/05/2022	USD	4.967.985	EUR	4.463.178	Operaciones comerciales	Lloyds	(3.050)
	12/04/2022	USD	3.143	EUR	2.815	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	9
	03/05/2022	USD	963	CAD	1.205	Operaciones comerciales	Barclays	(2)
	06/05/2022	USD	625	JPY	76.164	Operaciones comerciales	Barclays	(3)
								846.360 USD
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities								
	19/04/2022	EUR	855	USD	942	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/04/2022	EUR	79.874	USD	87.964	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	962
	19/04/2022	EUR	874	USD	963	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/04/2022	EUR	872	USD	960	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/04/2022	EUR	5.706	USD	6.308	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	44
	19/04/2022	EUR	2.434	USD	2.699	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/04/2022	EUR	865	USD	952	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/04/2022	EUR	61	USD	68	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	63	USD	69	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	62	USD	69	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	62	USD	68	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	26	USD	29	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	27	USD	30	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	27	USD	30	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	26	USD	29	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								1.056 USD
Threadneedle (Lux) - Global Focus								
	19/04/2022	EUR	81.349.183	USD	89.588.635	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	974.807
	19/04/2022	EUR	21.468.255	USD	23.642.667	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	257.254
	19/04/2022	EUR	45.663.590	USD	50.288.627	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	547.187
	19/04/2022	EUR	47.023	USD	51.786	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	563
	19/04/2022	CHF	1.093.453	USD	1.166.647	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22.321
	19/04/2022	USD	2.650	EUR	2.411	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(34)
	19/04/2022	EUR	27.741	USD	30.494	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	389
	19/04/2022	EUR	1.950.195	USD	2.143.742	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	27.348
	19/04/2022	USD	12.765	EUR	11.620	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(171)
	19/04/2022	USD	14.003	EUR	12.746	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(187)
	19/04/2022	USD	2.105.425	EUR	1.916.526	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28.167)
	19/04/2022	EUR	3.921.825	USD	4.335.471	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30.572
	19/04/2022	EUR	1.035.149	USD	1.144.329	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8.069
	19/04/2022	EUR	2.238.541	USD	2.474.646	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17.450
	19/04/2022	EUR	2.269	USD	2.509	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
	19/04/2022	CHF	52.816	USD	56.184	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.246
	19/04/2022	EUR	21.380	USD	23.526	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	276
	19/04/2022	EUR	13.519	USD	14.876	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	174

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Focus (continuación)								
	19/04/2022	USD	740.291	EUR	672.770	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.677)
	19/04/2022	EUR	86.698	USD	96.404	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	115
	19/04/2022	EUR	27.263	USD	30.315	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	36
	19/04/2022	EUR	20.133	USD	22.263	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	151
	19/04/2022	EUR	35.605	USD	39.371	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	267
	19/04/2022	USD	2.657.484	EUR	2.403.269	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17.988)
	19/04/2022	EUR	2.760.648	USD	3.054.535	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18.806
	19/04/2022	EUR	728.526	USD	806.081	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.963
	19/04/2022	EUR	1.531.182	USD	1.694.185	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10.431
	19/04/2022	EUR	1.597	USD	1.767	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
	19/04/2022	CHF	37.183	USD	39.880	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	551
	19/04/2022	EUR	255.897	USD	282.980	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.902
	19/04/2022	EUR	20.464	USD	22.630	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	152
	19/04/2022	USD	37.757	EUR	34.143	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(254)
	19/04/2022	USD	34.758	EUR	31.510	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(321)
	19/04/2022	EUR	31.348	USD	34.579	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	320
	19/04/2022	USD	231.297	EUR	209.686	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.138)
	19/04/2022	EUR	5.277	USD	5.821	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	54
	19/04/2022	USD	63.803	EUR	57.955	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(716)
	19/04/2022	EUR	28.347	USD	31.207	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	350
	19/04/2022	EUR	256.678	USD	282.580	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.172
	19/04/2022	USD	69.304	EUR	62.918	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(740)
	19/04/2022	USD	1.176	EUR	1.068	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/04/2022	EUR	51.680	USD	56.806	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	729
	19/04/2022	EUR	9.600	USD	10.552	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	135
	19/04/2022	USD	117.961	EUR	107.318	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.512)
	19/04/2022	EUR	56.720	USD	62.256	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	889
	19/04/2022	EUR	4.039	USD	4.434	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	63
	19/04/2022	EUR	53.827	USD	59.081	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	844
	19/04/2022	EUR	370.027	USD	406.141	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.798
	19/04/2022	USD	9.960	EUR	8.966	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(22)
	19/04/2022	EUR	44.521	USD	49.455	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	108
	19/04/2022	EUR	137.309	USD	152.527	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	334
	19/04/2022	EUR	2.209.034	USD	2.460.153	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(906)
	19/04/2022	EUR	580.267	USD	646.231	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(238)
	19/04/2022	EUR	1.163.645	USD	1.295.926	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(477)
	19/04/2022	EUR	17.303	USD	19.270	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/04/2022	CHF	30.103	USD	32.446	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	286
	19/04/2022	EUR	12.582	USD	14.053	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(46)
	19/04/2022	EUR	26.484	USD	29.580	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(97)
	19/04/2022	EUR	57.568	USD	64.299	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(211)
	19/04/2022	EUR	282.854	USD	315.927	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.035)
								1.874.184 USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities								
	19/04/2022	EUR	361.175	USD	397.756	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.328
	19/04/2022	EUR	868.556	USD	956.527	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10.408
	19/04/2022	EUR	543.774	USD	598.850	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.516
	19/04/2022	EUR	3.493	USD	3.837	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	51
	19/04/2022	EUR	28.164	USD	31.135	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	220
	19/04/2022	EUR	67.128	USD	74.208	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	523
	19/04/2022	EUR	42.076	USD	46.514	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	328
	19/04/2022	USD	674	EUR	613	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	19/04/2022	EUR	12.206	USD	13.536	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	52
	19/04/2022	EUR	29.100	USD	32.271	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	124
	19/04/2022	EUR	18.245	USD	20.234	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	78
	19/04/2022	USD	37.101	EUR	33.550	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(249)
	19/04/2022	EUR	80.803	USD	89.759	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	197
	19/04/2022	USD	1.813	EUR	1.623	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
								22.574 USD
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income								
	19/04/2022	SGD	1.000	USD	738	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	SGD	8.265	USD	6.085	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
	19/04/2022	SGD	56	USD	41	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SGD	99	USD	73	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SGD	13.071	USD	9.651	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/04/2022	SGD	139	USD	103	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SGD	1.183	USD	875	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SGD	4.883.787	USD	3.574.226	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	34.111
	19/04/2022	SGD	621.027	USD	454.502	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.338
	19/04/2022	SGD	569.836	USD	417.038	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.980
	19/04/2022	AUD	86.830	USD	62.470	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.750
	19/04/2022	EUR	50.144	USD	55.223	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	601
	19/04/2022	EUR	787	USD	867	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/04/2022	SGD	992	USD	727	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/04/2022	SGD	1.190	USD	871	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/04/2022	SGD	117.448	USD	86.623	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	153
	19/04/2022	SGD	14.929	USD	11.011	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	19/04/2022	SGD	13.698	USD	10.103	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
	19/04/2022	AUD	2.076	USD	1.521	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	38
	19/04/2022	EUR	1.213	USD	1.341	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/04/2022	EUR	19	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SGD	1.000	USD	739	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SGD	105.454	USD	77.784	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	130
	19/04/2022	SGD	13.408	USD	9.890	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/04/2022	SGD	12.299	USD	9.072	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
	19/04/2022	AUD	1.831	USD	1.355	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
	19/04/2022	EUR	1.074	USD	1.189	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/04/2022	EUR	17	USD	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								46.258 USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies								
	19/04/2022	CHF	814	EUR	788	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/04/2022	GBP	3.292.514	EUR	3.893.641	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(115)
	19/04/2022	CHF	30.987.820	EUR	30.013.695	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	252.754
	19/04/2022	GBP	646	EUR	764	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	31.546	GBP	26.580	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	114
	19/04/2022	EUR	2.672	GBP	2.246	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
	19/04/2022	CHF	39	EUR	38	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	GBP	156.281	EUR	186.213	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.405)
	19/04/2022	CHF	1.491.383	EUR	1.435.468	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21.195
	19/04/2022	GBP	31	EUR	37	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	GBP	11.565	EUR	13.762	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(86)
	19/04/2022	EUR	2.552	GBP	2.157	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	GBP	20.100	EUR	23.934	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(166)
	19/04/2022	CHF	27	EUR	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	GBP	106.307	EUR	126.475	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(763)
	19/04/2022	CHF	1.008.006	EUR	977.350	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7.190
	19/04/2022	GBP	21	EUR	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	529	GBP	443	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/04/2022	CHF	1.609.750	EUR	1.565.398	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.879
	19/04/2022	GBP	2.179	EUR	2.619	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42)
	19/04/2022	GBP	91.396	EUR	109.672	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.592)
	19/04/2022	GBP	172	EUR	206	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/04/2022	GBP	11.000	EUR	13.202	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(194)
	19/04/2022	GBP	703	EUR	838	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/04/2022	GBP	25	EUR	30	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	GBP	5.245	EUR	6.186	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
								283.806 EUR
Threadneedle (Lux) - American								
	19/04/2022	EUR	27.015.330	USD	29.751.577	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	323.725
	19/04/2022	EUR	22.081.907	USD	24.318.473	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	264.608
	19/04/2022	EUR	2.615.169	USD	2.880.046	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	31.338
	19/04/2022	EUR	661.970	USD	729.017	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7.932
	19/04/2022	EUR	804	USD	886	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/04/2022	EUR	66.746	USD	73.370	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	936
	19/04/2022	EUR	461.143	USD	506.910	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.467
	19/04/2022	USD	1.937	EUR	1.762	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(25)
	19/04/2022	EUR	62.341	USD	68.485	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	917
	19/04/2022	EUR	1.955	USD	2.148	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29
	19/04/2022	EUR	116.752	USD	128.260	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.717
	19/04/2022	EUR	243	USD	267	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/04/2022	EUR	4.151.513	USD	4.589.384	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	32.362
	19/04/2022	EUR	102.018	USD	112.778	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	795
	19/04/2022	EUR	1.233.632	USD	1.363.746	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9.617
	19/04/2022	EUR	994.024	USD	1.098.866	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7.749
	19/04/2022	EUR	117.303	USD	129.675	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	914
	19/04/2022	EUR	29.720	USD	32.855	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	232

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - American								
<i>(continuación)</i>	19/04/2022	EUR	36	USD	40	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	300.802	USD	330.991	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.882
	19/04/2022	USD	6.527	EUR	5.932	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(77)
	19/04/2022	USD	198	EUR	180	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/04/2022	EUR	106.812	USD	117.531	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.378
	19/04/2022	EUR	181.516	USD	201.836	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	240
	19/04/2022	EUR	1.723	USD	1.916	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/04/2022	EUR	512.735	USD	570.134	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	677
	19/04/2022	EUR	184.631	USD	204.161	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.383
	19/04/2022	USD	6.433	EUR	5.818	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(44)
	19/04/2022	EUR	40.972	USD	45.306	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	307
	19/04/2022	EUR	2.323.323	USD	2.570.654	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15.827
	19/04/2022	EUR	56.673	USD	62.706	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	386
	19/04/2022	EUR	688.055	USD	761.302	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.687
	19/04/2022	EUR	564.548	USD	624.647	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.846
	19/04/2022	EUR	65.369	USD	72.328	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	445
	19/04/2022	EUR	16.576	USD	18.341	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	113
	19/04/2022	EUR	20	USD	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	271.345	USD	300.063	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.017
	19/04/2022	EUR	1.060	USD	1.172	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/04/2022	EUR	6.518	USD	7.207	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	48
	19/04/2022	EUR	4.704	USD	5.202	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	35
	19/04/2022	EUR	23.053	USD	25.429	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	235
	19/04/2022	USD	602	EUR	545	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/04/2022	EUR	107.971	USD	118.867	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.334
	19/04/2022	EUR	909.405	USD	1.001.174	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11.237
	19/04/2022	EUR	4.106	USD	4.520	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	51
	19/04/2022	USD	123.490	EUR	112.111	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.319)
	19/04/2022	EUR	350	USD	386	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/04/2022	USD	2.920	EUR	2.651	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(31)
	19/04/2022	EUR	6.412	USD	7.063	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	75
	19/04/2022	EUR	92.473.535	USD	101.839.717	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.108.110
	19/04/2022	EUR	2.275.867	USD	2.506.378	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	27.272
	19/04/2022	EUR	1.291.324	USD	1.419.383	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18.208
	19/04/2022	EUR	656	USD	721	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/04/2022	USD	3.980	EUR	3.621	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(51)
	19/04/2022	EUR	13.003	USD	14.292	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	183
	19/04/2022	EUR	131.648	USD	144.496	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.063
	19/04/2022	EUR	326	USD	358	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/04/2022	USD	20.736	EUR	18.892	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(296)
	19/04/2022	USD	1.644	EUR	1.498	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23)
	19/04/2022	EUR	121.592	USD	135.069	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	296
	19/04/2022	EUR	98	USD	109	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	1.799.048	USD	1.998.444	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.381
	19/04/2022	EUR	2.603.261	USD	2.899.195	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.068)
	19/04/2022	EUR	62.322	USD	69.406	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26)
	19/04/2022	EUR	799.748	USD	890.662	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(328)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - American								
<i>(continuación)</i>	19/04/2022	EUR	635.129	USD	707.329	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(261)
	19/04/2022	EUR	72.683	USD	80.945	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30)
	19/04/2022	EUR	18.448	USD	20.545	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	19/04/2022	EUR	22	USD	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	20.682	USD	23.100	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(76)
	19/04/2022	EUR	1.651	USD	1.844	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/04/2022	EUR	943	USD	1.054	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/04/2022	EUR	1.011	USD	1.129	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
								1.894.412 USD
Threadneedle (Lux) - American Select								
	19/04/2022	EUR	735.990	USD	810.535	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8.819
	19/04/2022	EUR	317.008	USD	349.116	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.799
	19/04/2022	EUR	541.336	USD	596.165	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.487
	19/04/2022	EUR	769	USD	846	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/04/2022	EUR	324.992	USD	357.909	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.894
	19/04/2022	EUR	10.676	USD	11.758	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	128
	19/04/2022	EUR	17.179	USD	18.919	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	206
	19/04/2022	EUR	5.075	USD	5.575	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	75
	19/04/2022	USD	2.956	EUR	2.691	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40)
	19/04/2022	EUR	36.543	USD	40.398	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	285
	19/04/2022	EUR	15.584	USD	17.227	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	121
	19/04/2022	EUR	26.793	USD	29.619	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	209
	19/04/2022	EUR	38	USD	42	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	16.073	USD	17.768	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	125
	19/04/2022	EUR	528	USD	584	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/04/2022	EUR	850	USD	940	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/04/2022	EUR	19.725	USD	21.825	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	134
	19/04/2022	EUR	8.354	USD	9.244	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	57
	19/04/2022	EUR	14.436	USD	15.973	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	98
	19/04/2022	EUR	20	USD	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	8.654	USD	9.575	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	59
	19/04/2022	EUR	285	USD	315	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/04/2022	EUR	458	USD	507	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/04/2022	USD	51	EUR	47	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	690	USD	761	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/04/2022	EUR	949	USD	1.045	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
	19/04/2022	USD	5	EUR	5	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	5	USD	5	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	1.105	EUR	995	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/04/2022	EUR	19.524	USD	21.744	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	19/04/2022	EUR	8.205	USD	9.138	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/04/2022	EUR	14.407	USD	16.045	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/04/2022	EUR	20	USD	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	8.626	USD	9.606	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/04/2022	EUR	284	USD	316	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - American Select								
<i>(continuación)</i>	19/04/2022	EUR	457	USD	509	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	828	EUR	741	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
								24.480 USD
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies								
	19/04/2022	EUR	2.190.941	USD	2.412.850	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26.254
	19/04/2022	EUR	395.409	USD	435.458	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.738
	19/04/2022	EUR	9.207.395	USD	10.139.966	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	110.331
	19/04/2022	EUR	568.485	USD	626.064	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.812
	19/04/2022	EUR	24.542	USD	26.978	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	344
	19/04/2022	EUR	87.300	USD	96.507	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	681
	19/04/2022	EUR	15.744	USD	17.405	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	123
	19/04/2022	EUR	368.307	USD	407.153	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.871
	19/04/2022	EUR	22.680	USD	25.073	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	177
	19/04/2022	USD	65	EUR	59	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	10.134	USD	11.206	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	76
	19/04/2022	USD	10.036	EUR	9.116	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(113)
	19/04/2022	EUR	72.000	USD	79.308	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	848
	19/04/2022	EUR	51.313	USD	56.255	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	871
	19/04/2022	EUR	9.200	USD	10.086	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	156
	19/04/2022	EUR	218.238	USD	239.255	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.703
	19/04/2022	EUR	13.439	USD	14.733	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	228
	19/04/2022	EUR	11.553	USD	12.834	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	28
	19/04/2022	USD	1.681	EUR	1.505	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/04/2022	EUR	29.548	USD	33.003	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(108)
								158.026 USD
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity								
	19/04/2022	USD	1.509	SGD	2.047	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/04/2022	SGD	1.000	USD	738	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	USD	116	SGD	157	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SGD	19.419	USD	14.322	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25
	19/04/2022	SGD	44	USD	32	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	28	USD	31	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SGD	22.254	USD	16.427	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
	19/04/2022	SGD	50	USD	37	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	31	USD	35	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SGD	3.000	USD	2.215	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	SGD	444.498	USD	325.308	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.104
	19/04/2022	SGD	1.000	USD	732	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/04/2022	EUR	631	USD	695	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/04/2022	SGD	450	USD	329	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
								3.161 USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Asia Equities								
	19/04/2022	EUR	626	USD	689	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/04/2022	EUR	624	USD	687	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/04/2022	EUR	26	USD	28	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	26	USD	28	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	25	USD	28	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	25	USD	28	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								16 USD
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities								
	19/04/2022	EUR	618.844	USD	681.523	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7.416
	19/04/2022	EUR	6.337.884	USD	6.979.817	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	75.947
	19/04/2022	CHF	883	USD	942	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
	19/04/2022	GBP	686	USD	893	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/04/2022	EUR	5.947	USD	6.549	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	71
	19/04/2022	SGD	134.390.381	USD	98.354.336	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	938.653
	19/04/2022	USD	2.031	EUR	1.848	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26)
	19/04/2022	EUR	12.091	USD	13.282	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	178
	19/04/2022	EUR	13.562	USD	14.882	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	216
	19/04/2022	EUR	138.990	USD	152.515	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.218
	19/04/2022	CHF	19	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	GBP	15	USD	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	130	USD	143	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/04/2022	SGD	2.923.352	USD	2.145.999	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13.890
	19/04/2022	EUR	14.813	USD	16.375	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	115
	19/04/2022	EUR	152.087	USD	168.128	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.186
	19/04/2022	CHF	21	USD	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	GBP	16	USD	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	142	USD	157	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	SGD	3.211.295	USD	2.368.462	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.171
	19/04/2022	EUR	716	USD	797	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	USD	3.859	EUR	3.490	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26)
	19/04/2022	EUR	15.101	USD	16.708	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	103
	19/04/2022	EUR	155.188	USD	171.709	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.057
	19/04/2022	CHF	22	USD	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	GBP	17	USD	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	145	USD	161	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	SGD	3.308.422	USD	2.440.324	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.070
	19/04/2022	EUR	7.628	USD	8.414	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	78
	19/04/2022	USD	453	EUR	412	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	19/04/2022	EUR	2.957	USD	3.258	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	35
	19/04/2022	USD	1.842	EUR	1.676	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24)
	19/04/2022	EUR	6.203	USD	6.808	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	97
	19/04/2022	EUR	16.112	USD	17.745	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	192
	19/04/2022	EUR	166.769	USD	183.676	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.983
	19/04/2022	CHF	23	USD	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	GBP	18	USD	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SGD	3.606.885	USD	2.652.263	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12.651
	19/04/2022	EUR	898	USD	998	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/04/2022	EUR	3.462	USD	3.846	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities								
(continuación)	19/04/2022	EUR	185	USD	206	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	4.024	USD	4.495	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15)
								1.064.274 USD
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities								
	19/04/2022	EUR	831	USD	916	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/04/2022	EUR	300.227	USD	330.635	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.598
	19/04/2022	EUR	844	USD	930	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/04/2022	CHF	912	USD	973	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	19/04/2022	EUR	841	USD	927	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/04/2022	CHF	923	USD	984	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	19/04/2022	EUR	831	USD	915	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/04/2022	EUR	35	USD	39	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	12.645	USD	13.979	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	99
	19/04/2022	EUR	36	USD	39	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	CHF	39	USD	41	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	EUR	35	USD	39	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	CHF	39	USD	41	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	EUR	35	USD	39	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	18	USD	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	6.420	USD	7.103	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	44
	19/04/2022	EUR	18	USD	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	CHF	20	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	18	USD	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	CHF	20	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	18	USD	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	100.455	USD	110.592	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.242
	19/04/2022	EUR	204.173	USD	224.100	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.200
	19/04/2022	EUR	27	USD	31	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	15.993	USD	17.811	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/04/2022	EUR	28	USD	31	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	CHF	30	USD	33	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	28	USD	31	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	CHF	31	USD	33	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	19	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								8.256 USD
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities								
	19/04/2022	USD	1.162	EUR	1.054	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
	19/04/2022	USD	6.270	EUR	5.688	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(56)
	19/04/2022	SGD	29.698	EUR	19.869	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(159)
	19/04/2022	SGD	4.209	EUR	2.815	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21)
	19/04/2022	SGD	1.545	EUR	1.035	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/04/2022	EUR	994	SGD	1.485	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/04/2022	SGD	69.561	EUR	46.182	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16)
	19/04/2022	SGD	9.914	EUR	6.562	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities								
<i>(continuación)</i>	19/04/2022	SGD	8.144.155	EUR	5.414.615	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9.604)
	19/04/2022	USD	41.931	EUR	38.075	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(410)
	19/04/2022	USD	225.356	EUR	204.630	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.203)
	19/04/2022	SGD	9.225	EUR	6.153	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30)
	19/04/2022	USD	1.500	EUR	1.365	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	19/04/2022	SGD	139.939	EUR	93.243	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(370)
	19/04/2022	SGD	297.730	EUR	198.700	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.106)
	19/04/2022	USD	1.513	EUR	1.368	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
	19/04/2022	USD	8.176	EUR	7.396	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(52)
	19/04/2022	SGD	60.037	EUR	40.101	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(256)
	19/04/2022	SGD	11.604	EUR	7.707	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/04/2022	EUR	236.241	SGD	354.301	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.104
	19/04/2022	EUR	63.764	SGD	95.566	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	341
	19/04/2022	USD	1.000	EUR	904	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/04/2022	EUR	4.277	SGD	6.406	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26
	19/04/2022	SGD	225.252	EUR	150.474	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(981)
								(13.825) EUR
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities								
	19/04/2022	SGD	16.497.900	EUR	10.968.576	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19.451)
	19/04/2022	CHF	17.755	EUR	17.197	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	145
	19/04/2022	USD	415.760	EUR	377.523	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.064)
	19/04/2022	USD	13.743	EUR	12.479	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(134)
	19/04/2022	EUR	41.869	SGD	62.775	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	207
	19/04/2022	SGD	11.406	EUR	7.600	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30)
	19/04/2022	CHF	5.821	EUR	5.635	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	50
	19/04/2022	SGD	564.624	EUR	376.820	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.098)
	19/04/2022	CHF	913	EUR	878	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/04/2022	USD	14.339	EUR	12.971	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(91)
	19/04/2022	USD	473	EUR	428	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/04/2022	EUR	1.225	SGD	1.834	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/04/2022	SGD	3.550	EUR	2.358	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/04/2022	EUR	115.553	SGD	173.300	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	540
	19/04/2022	EUR	217.806	USD	240.845	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.468
	19/04/2022	USD	767	EUR	694	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	19/04/2022	SGD	379.150	EUR	252.831	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.201)
	19/04/2022	CHF	544	EUR	528	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/04/2022	USD	9.641	EUR	8.714	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(53)
	19/04/2022	USD	318	EUR	287	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/04/2022	EUR	32.660	SGD	48.949	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	174
	19/04/2022	SGD	14.935	EUR	9.972	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(60)
	19/04/2022	EUR	14.339	SGD	21.433	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	115
	19/04/2022	CHF	8.194	EUR	7.991	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/04/2022	EUR	4.647	SGD	6.949	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	35
	19/04/2022	EUR	1.649	SGD	2.463	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities <i>(continuación)</i>								
	19/04/2022	SGD	17.811	EUR	11.921	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(100)
	19/04/2022	EUR	3.567	USD	3.915	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	50
	19/04/2022	EUR	69.014	SGD	103.953	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24
	19/04/2022	EUR	44.815	SGD	67.711	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(123)
								(24.556) EUR
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies								
	19/04/2022	CHF	3.021.211	EUR	2.926.237	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24.643
	19/04/2022	USD	24.265.328	EUR	22.033.650	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(237.166)
	19/04/2022	CHF	9.198.008	EUR	8.908.862	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	75.024
	19/04/2022	USD	14.240.070	EUR	12.930.413	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(139.180)
	19/04/2022	CHF	227.401	EUR	220.252	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.855
	19/04/2022	USD	3.173.910	EUR	2.882.006	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(31.021)
	19/04/2022	USD	25.000	EUR	22.743	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(286)
	19/04/2022	EUR	13.252	CHF	13.616	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(47)
	19/04/2022	CHF	109.032	EUR	104.944	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.550
	19/04/2022	USD	875.108	EUR	791.614	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.543)
	19/04/2022	CHF	331.871	EUR	319.429	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.717
	19/04/2022	USD	513.672	EUR	464.662	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.254)
	19/04/2022	CHF	8.218	EUR	7.910	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	117
	19/04/2022	USD	114.497	EUR	103.573	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(725)
	19/04/2022	EUR	81.064	USD	89.200	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	940
	19/04/2022	EUR	12.618	CHF	13.106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(184)
	19/04/2022	CHF	121.854	EUR	118.132	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	886
	19/04/2022	EUR	99.267	CHF	102.395	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(744)
	19/04/2022	CHF	69.526	EUR	67.411	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	496
	19/04/2022	USD	567.541	EUR	512.936	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.139)
	19/04/2022	CHF	212.489	EUR	206.027	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.516
	19/04/2022	USD	331.423	EUR	299.536	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.833)
	19/04/2022	CHF	5.262	EUR	5.102	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	38
	19/04/2022	USD	74.317	EUR	67.166	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(411)
	19/04/2022	CHF	15.216	EUR	14.797	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	65
	19/04/2022	EUR	48.997	USD	54.047	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	449
	19/04/2022	USD	54.000	EUR	48.955	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(449)
	19/04/2022	EUR	167.902	USD	184.845	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.865
	19/04/2022	EUR	62.024	CHF	63.603	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(98)
	19/04/2022	EUR	28.788	USD	31.694	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	320
	19/04/2022	EUR	38.381	USD	42.276	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	406
	19/04/2022	EUR	47.211	CHF	48.376	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(39)
	19/04/2022	EUR	62.648	USD	69.007	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	663
	19/04/2022	EUR	71.421	CHF	73.152	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28)
	19/04/2022	EUR	509.043	USD	558.064	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7.762
	19/04/2022	EUR	205.216	CHF	210.190	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(81)
	19/04/2022	EUR	297.553	USD	326.208	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.536
	19/04/2022	EUR	5.162	CHF	5.288	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies (continuación)								
	19/04/2022	EUR	66.630	USD	73.047	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.016
	19/04/2022	CHF	1.698	EUR	1.655	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/04/2022	CHF	148.548	EUR	144.810	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	280
	19/04/2022	EUR	23.177	CHF	23.966	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(231)
	19/04/2022	CHF	114.813	EUR	111.196	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	945
	19/04/2022	USD	894.321	EUR	803.034	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	296
	19/04/2022	CHF	335.659	EUR	325.084	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.761
	19/04/2022	USD	526.679	EUR	472.919	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	174
	19/04/2022	CHF	8.380	EUR	8.116	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	69
	19/04/2022	USD	118.498	EUR	106.402	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	39
	19/04/2022	EUR	63.326	CHF	65.203	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(359)
	19/04/2022	EUR	70.296	USD	78.516	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(231)
								(291.620) EUR
Threadneedle (Lux) - European Select								
	19/04/2022	USD	407.394	EUR	369.926	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.982)
	19/04/2022	USD	890	EUR	808	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/04/2022	GBP	115.392	EUR	136.460	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/04/2022	GBP	7.782.339	EUR	9.203.193	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(273)
	19/04/2022	SGD	34.136.562	EUR	22.695.583	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40.247)
	19/04/2022	USD	4.764.429	EUR	4.326.245	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(46.567)
	19/04/2022	EUR	51.650	GBP	43.519	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	187
	19/04/2022	EUR	13.082	GBP	11.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	74
	19/04/2022	EUR	149	SGD	223	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	USD	15.402	EUR	13.933	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(98)
	19/04/2022	USD	34	EUR	30	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	GBP	4.356	EUR	5.190	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(39)
	19/04/2022	GBP	292.019	EUR	347.949	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.626)
	19/04/2022	SGD	1.285.456	EUR	857.891	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.775)
	19/04/2022	USD	180.168	EUR	162.979	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.141)
	19/04/2022	GBP	14	EUR	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SGD	2.810	EUR	1.877	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
	19/04/2022	SGD	2.500	EUR	1.660	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/04/2022	GBP	2.471	EUR	2.942	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/04/2022	SGD	10.000	EUR	6.668	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(31)
	19/04/2022	USD	9.939	EUR	8.983	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(55)
	19/04/2022	USD	22	EUR	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	GBP	2.780	EUR	3.308	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/04/2022	GBP	186.536	EUR	221.925	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.338)
	19/04/2022	SGD	827.370	EUR	551.721	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.621)
	19/04/2022	USD	116.280	EUR	105.093	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(643)
	19/04/2022	EUR	96.507	GBP	80.834	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	919
	19/04/2022	EUR	3.564	SGD	5.342	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	19/04/2022	EUR	7.357	GBP	6.121	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	119
	19/04/2022	SGD	992	EUR	662	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/04/2022	EUR	8.550	GBP	7.125	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	124

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - European Select <i>(continuación)</i>								
	19/04/2022	SGD	6.100	EUR	4.081	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(33)
	19/04/2022	SGD	51.590	EUR	34.498	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(259)
	19/04/2022	GBP	34.999	EUR	42.004	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(617)
	19/04/2022	EUR	70.719	SGD	105.586	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	646
	19/04/2022	EUR	4	GBP	3	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SGD	99	EUR	66	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/04/2022	EUR	2.304	USD	2.528	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	32
	19/04/2022	EUR	5.205	GBP	4.402	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/04/2022	GBP	4.214	EUR	4.970	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/04/2022	EUR	89.213	SGD	134.792	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(244)
								(103.527) EUR
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies								
	19/04/2022	CHF	366.608	EUR	355.084	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.990
	19/04/2022	CHF	10.204.410	EUR	9.883.627	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	83.233
	19/04/2022	CHF	1.392	EUR	1.348	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
	19/04/2022	CHF	12.936	EUR	12.451	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	184
	19/04/2022	CHF	360.536	EUR	347.019	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.124
	19/04/2022	CHF	49	EUR	47	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	CHF	8.919	EUR	8.618	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	94
	19/04/2022	CHF	820	EUR	793	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/04/2022	EUR	365.395	CHF	379.544	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.314)
	19/04/2022	EUR	25.031	CHF	26.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(364)
	19/04/2022	CHF	40.715	EUR	39.471	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	296
	19/04/2022	CHF	244.226	EUR	236.799	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.743
	19/04/2022	CHF	33	EUR	32	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	CHF	79.767	EUR	77.614	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	296
	19/04/2022	CHF	19	EUR	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	18	CHF	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	CHF	29	EUR	28	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	38.354	CHF	39.491	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(218)
								88.083 EUR
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income								
	19/04/2022	EUR	62.487	USD	69.078	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	487
	19/04/2022	EUR	29.386	USD	32.485	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	229
	19/04/2022	GBP	4.688	USD	6.175	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/04/2022	EUR	82.280	USD	91.248	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	352
	19/04/2022	EUR	38.660	USD	42.873	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	165
	19/04/2022	GBP	6.241	USD	8.211	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/04/2022	EUR	7.000	USD	7.784	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/04/2022	EUR	987	USD	1.092	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/04/2022	EUR	96	USD	107	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	EUR	4.000	USD	4.404	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	49
	19/04/2022	EUR	13.289	USD	14.638	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	156
	19/04/2022	EUR	3.500	USD	3.847	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	49

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income <i>(continuación)</i>								
	19/04/2022	USD	10.222	EUR	9.313	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(146)
	19/04/2022	EUR	10.000	USD	11.108	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24
	19/04/2022	USD	6.717	EUR	6.014	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
	19/04/2022	EUR	2.252.984	USD	2.481.178	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26.999
	19/04/2022	EUR	1.052.936	USD	1.159.583	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12.618
	19/04/2022	GBP	169.494	USD	220.807	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.329
	19/04/2022	EUR	4.988	USD	5.482	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	70
								43.422 USD
Threadneedle (Lux) - Global Technology								
	19/04/2022	EUR	1.205.109	USD	1.327.168	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14.441
	19/04/2022	USD	340.968	EUR	309.869	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.997)
	19/04/2022	EUR	199	USD	221	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	73.513	USD	81.742	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	97
	19/04/2022	EUR	93.270	USD	103.711	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	123
	19/04/2022	EUR	2.385	USD	2.637	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
	19/04/2022	EUR	48.435	USD	53.591	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	330
	19/04/2022	EUR	1.503.812	USD	1.663.901	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10.244
	19/04/2022	EUR	1.259.386	USD	1.393.455	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8.579
	19/04/2022	EUR	51.873	USD	57.395	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	353
	19/04/2022	CHF	44.523	USD	47.752	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	660
	19/04/2022	EUR	401	USD	444	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/04/2022	USD	89.227	EUR	80.688	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(599)
	19/04/2022	EUR	423	USD	467	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/04/2022	EUR	20.321	USD	22.416	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	207
	19/04/2022	EUR	1.764.616	USD	1.946.486	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18.004
	19/04/2022	EUR	17.977	USD	19.791	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	222
	19/04/2022	USD	102.149	EUR	92.737	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.091)
	19/04/2022	EUR	23.074	USD	25.416	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	272
	19/04/2022	EUR	57.967	USD	63.716	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	817
	19/04/2022	EUR	37.449.034	USD	41.242.059	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	448.752
	19/04/2022	EUR	43.205.989	USD	47.582.107	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	517.737
	19/04/2022	EUR	1.280.054	USD	1.409.704	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15.339
	19/04/2022	CHF	1.100.580	USD	1.174.251	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22.467
	19/04/2022	USD	212.055	EUR	192.910	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.704)
	19/04/2022	USD	8.980	EUR	8.174	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(120)
	19/04/2022	EUR	151.556	USD	166.493	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.229
	19/04/2022	USD	13.845.112	EUR	12.602.930	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(185.223)
	19/04/2022	EUR	40.822	USD	44.794	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	652
	19/04/2022	EUR	1.262.367	USD	1.385.204	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20.148
	19/04/2022	EUR	1.465.036	USD	1.607.595	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23.383
	19/04/2022	EUR	43.401	USD	47.624	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	693
	19/04/2022	CHF	37.378	USD	39.779	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	864
	19/04/2022	EUR	45.739	USD	50.563	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	357
	19/04/2022	EUR	1.429.398	USD	1.580.160	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11.143
	19/04/2022	EUR	1.184.309	USD	1.309.222	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9.232
	19/04/2022	EUR	48.948	USD	54.111	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	382

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Technology (continuación)								
	19/04/2022	CHF	42.100	USD	44.785	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	993
	19/04/2022	EUR	269.847	USD	296.608	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.805
	19/04/2022	EUR	55.773	USD	61.217	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	874
	19/04/2022	EUR	36.707	USD	40.429	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	436
	19/04/2022	EUR	1.140.978	USD	1.256.650	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13.565
	19/04/2022	EUR	1.009.035	USD	1.111.331	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11.995
	19/04/2022	EUR	39.682	USD	43.705	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	472
	19/04/2022	CHF	34.174	USD	36.616	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	543
	19/04/2022	EUR	499	USD	554	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	EUR	27.303	USD	30.329	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	66
	19/04/2022	EUR	1.398	USD	1.553	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/04/2022	USD	66.686	EUR	59.705	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	218
	19/04/2022	EUR	2.015	USD	2.251	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
								966.982 USD
Threadneedle (Lux) - UK Equities								
	19/04/2022	CHF	93.797	GBP	76.841	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	631
	19/04/2022	EUR	8.026.922	GBP	6.787.670	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	201
	19/04/2022	EUR	5.885.469	GBP	4.976.829	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	148
	19/04/2022	USD	926.397	GBP	711.114	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.423)
	19/04/2022	EUR	4.651.762	GBP	3.933.590	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	117
	19/04/2022	CHF	38.646	GBP	31.660	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	260
	19/04/2022	EUR	1.067.305	GBP	902.527	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	27
	19/04/2022	EUR	5.623.742	GBP	4.755.509	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	141
	19/04/2022	CHF	77.861	GBP	63.785	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	524
	19/04/2022	USD	4.456.243	GBP	3.420.670	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(35.706)
	19/04/2022	EUR	35.992	GBP	30.435	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	CHF	62.233	GBP	50.983	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	419
	19/04/2022	USD	949	GBP	729	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	19/04/2022	EUR	794	GBP	671	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	CHF	877	GBP	719	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/04/2022	USD	954	GBP	732	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	19/04/2022	EUR	793	GBP	671	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	CHF	877	GBP	718	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/04/2022	USD	954	GBP	732	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	19/04/2022	EUR	204.252	GBP	172.097	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	626
	19/04/2022	EUR	7.112	GBP	5.992	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
	19/04/2022	GBP	3.034	EUR	3.601	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/04/2022	EUR	43.243	GBP	36.435	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	133
	19/04/2022	GBP	3.614	USD	4.715	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	33
	19/04/2022	GBP	45.243	EUR	53.806	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(257)
	19/04/2022	EUR	4.731	GBP	3.978	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	19/04/2022	CHF	2.209	GBP	1.784	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	41
	19/04/2022	EUR	193.768	GBP	162.621	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.236
	19/04/2022	EUR	136.885	GBP	114.882	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	874
	19/04/2022	USD	21.808	GBP	16.555	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/04/2022	EUR	109.488	GBP	91.889	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	699

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - UK Equities (continuación)								
	19/04/2022	CHF	912	GBP	736	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/04/2022	EUR	25.018	GBP	20.997	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	160
	19/04/2022	EUR	133.384	GBP	111.943	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	851
	19/04/2022	CHF	1.838	GBP	1.484	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	34
	19/04/2022	USD	104.834	GBP	79.585	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	47
	19/04/2022	EUR	847	GBP	711	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/04/2022	CHF	1.469	GBP	1.186	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	27
	19/04/2022	USD	22	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	19	GBP	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	CHF	21	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	23	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	19	GBP	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	CHF	21	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	22	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	28.500	GBP	23.950	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	151
	19/04/2022	GBP	1.645	EUR	1.957	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
	19/04/2022	EUR	654	GBP	550	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/04/2022	GBP	17.713	EUR	20.956	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/04/2022	GBP	4.422	EUR	5.231	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/04/2022	EUR	440	GBP	372	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	GBP	10.010	EUR	11.920	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(70)
	19/04/2022	EUR	54.440	GBP	45.718	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	319
	19/04/2022	GBP	4.893	EUR	5.826	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(34)
	19/04/2022	EUR	300	GBP	251	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/04/2022	EUR	28.256	GBP	23.667	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	227
	19/04/2022	GBP	21.181	EUR	25.287	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(203)
	19/04/2022	GBP	12.094	EUR	14.535	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(198)
	19/04/2022	GBP	2.708	EUR	3.255	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(44)
	19/04/2022	EUR	33.934	GBP	28.279	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	417
	19/04/2022	EUR	14.177	GBP	11.815	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	174
	19/04/2022	EUR	17.424	GBP	14.521	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	214
	19/04/2022	GBP	15.015	EUR	17.971	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(181)
	19/04/2022	EUR	13.330	GBP	11.138	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	135
	19/04/2022	EUR	7.570	GBP	6.325	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	76
	19/04/2022	GBP	4.511	EUR	5.414	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(67)
	19/04/2022	EUR	322	GBP	269	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/04/2022	EUR	24.843	GBP	20.700	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	309
	19/04/2022	GBP	16.927	EUR	20.315	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(252)
	19/04/2022	EUR	8.000	GBP	6.712	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	54
	19/04/2022	EUR	9	GBP	7	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	GBP	3.231	EUR	3.851	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26)
	19/04/2022	EUR	7.400	GBP	6.259	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/04/2022	GBP	59.209	EUR	70.006	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/04/2022	EUR	62.381	GBP	52.760	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/04/2022	CHF	2.112	GBP	1.736	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/04/2022	EUR	187.286	GBP	158.846	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(470)
	19/04/2022	EUR	131.223	GBP	111.296	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(329)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - UK Equities (continuación)								
	19/04/2022	USD	21.911	GBP	16.697	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(53)
	19/04/2022	EUR	106.695	GBP	90.493	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(268)
	19/04/2022	CHF	881	GBP	724	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/04/2022	EUR	24.174	GBP	20.503	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(61)
	19/04/2022	EUR	128.190	GBP	108.723	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(322)
	19/04/2022	CHF	1.780	GBP	1.463	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/04/2022	USD	105.587	GBP	80.459	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(256)
	19/04/2022	EUR	819	GBP	694	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/04/2022	CHF	1.424	GBP	1.170	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/04/2022	USD	22	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	18	GBP	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	CHF	20	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	23	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	18	GBP	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	CHF	20	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	23	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	1.336	GBP	1.132	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/04/2022	GBP	1.455	EUR	1.716	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/04/2022	GBP	1.957	EUR	2.308	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
								(36.841) GBP
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income								
	19/04/2022	EUR	1.808.830	GBP	1.529.570	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	45
	19/04/2022	EUR	51.529	GBP	43.573	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	EUR	2.779.432	GBP	2.350.324	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	70
	19/04/2022	CHF	115.711	GBP	94.793	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	778
	19/04/2022	USD	6.153.764	GBP	4.723.708	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(49.308)
	19/04/2022	SGD	1.314	GBP	739	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/04/2022	EUR	534.251	GBP	451.770	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/04/2022	EUR	114.597	GBP	96.905	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/04/2022	EUR	299.928	GBP	253.623	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/04/2022	USD	1.565.049	GBP	1.201.351	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12.540)
	19/04/2022	USD	1.007	GBP	773	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	19/04/2022	EUR	2.425.712	GBP	2.051.214	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	61
	19/04/2022	CHF	323.779	GBP	265.248	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.178
	19/04/2022	USD	1.148.327	GBP	881.470	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9.201)
	19/04/2022	CHF	457.055	GBP	374.431	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.075
	19/04/2022	CHF	918	GBP	752	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/04/2022	USD	3.256.918	GBP	2.500.052	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26.097)
	19/04/2022	EUR	1.546.665	GBP	1.307.880	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	39
	19/04/2022	USD	26.434	GBP	20.291	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(212)
	19/04/2022	EUR	482.016	GBP	407.599	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
	19/04/2022	EUR	189.511	GBP	159.350	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	907
	19/04/2022	GBP	166.842	EUR	198.537	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.048)
	19/04/2022	EUR	44.902	GBP	37.838	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	133
	19/04/2022	EUR	1.276	GBP	1.075	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/04/2022	EUR	69.216	GBP	58.326	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	205

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income (continuación)								
	19/04/2022	CHF	2.907	GBP	2.363	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	38
	19/04/2022	USD	155.370	GBP	118.098	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(79)
	19/04/2022	SGD	33	GBP	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	17.941	GBP	15.118	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	53
	19/04/2022	EUR	2.838	GBP	2.391	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/04/2022	EUR	7.464	GBP	6.290	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
	19/04/2022	USD	39.612	GBP	30.109	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/04/2022	USD	26	GBP	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	60.249	GBP	50.770	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	179
	19/04/2022	CHF	8.117	GBP	6.598	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	106
	19/04/2022	USD	29.008	GBP	22.049	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15)
	19/04/2022	CHF	11.487	GBP	9.338	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	150
	19/04/2022	CHF	23	GBP	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	82.482	GBP	62.695	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42)
	19/04/2022	EUR	37.031	GBP	31.205	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	110
	19/04/2022	USD	670	GBP	509	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	12.004	GBP	10.115	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	36
	19/04/2022	USD	1.072	GBP	809	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/04/2022	GBP	27.126	EUR	32.465	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(327)
	19/04/2022	GBP	150.501	EUR	180.122	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.816)
	19/04/2022	EUR	99.996	GBP	83.318	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.243
	19/04/2022	EUR	1.024	GBP	866	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	58.791	GBP	49.864	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(147)
	19/04/2022	CHF	2.447	GBP	2.011	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/04/2022	EUR	6.324	GBP	5.363	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16)
	19/04/2022	USD	34.001	GBP	25.909	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(82)
	19/04/2022	USD	22	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	CHF	6.783	GBP	5.573	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29
	19/04/2022	USD	24.732	GBP	18.846	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(60)
	19/04/2022	CHF	9.694	GBP	7.965	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	41
	19/04/2022	CHF	19	GBP	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	70.948	GBP	54.063	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(171)
	19/04/2022	EUR	25.247	GBP	21.413	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(63)
	19/04/2022	USD	576	GBP	439	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/04/2022	EUR	10.197	GBP	8.649	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26)
	19/04/2022	EUR	200	GBP	170	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								(91.711) GBP
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha								
	19/04/2022	EUR	784.329	USD	863.770	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9.399
	19/04/2022	CHF	10.822	USD	11.547	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	221
	19/04/2022	GBP	19.960	USD	26.003	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	274
	19/04/2022	EUR	73.796	USD	81.271	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	884
	19/04/2022	EUR	2.552.407	USD	2.810.928	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30.586
	19/04/2022	GBP	1.901.156	USD	2.476.712	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26.126
	19/04/2022	GBP	10.971.443	USD	14.292.938	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	150.769

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha								
<i>(continuación)</i>	19/04/2022	GBP	29.984	USD	39.061	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	412
	19/04/2022	EUR	824	USD	907	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/04/2022	EUR	17.015	USD	18.704	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	239
	19/04/2022	EUR	2.804	USD	3.080	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	41
	19/04/2022	EUR	1.975	USD	2.173	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25
	19/04/2022	USD	5.723	EUR	5.147	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/04/2022	EUR	32.270	USD	35.683	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	242
	19/04/2022	USD	28.786	EUR	26.031	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(193)
	19/04/2022	EUR	4.087	USD	4.519	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30
	19/04/2022	USD	88.317	EUR	80.065	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(816)
	19/04/2022	GBP	492	USD	652	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	19/04/2022	EUR	565	USD	622	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/04/2022	EUR	4.243	USD	4.674	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	50
	19/04/2022	EUR	7.178	USD	7.890	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	101
	19/04/2022	EUR	7.220	USD	7.925	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	113
	19/04/2022	GBP	16.685	USD	21.829	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	137
	19/04/2022	EUR	14.399	USD	15.995	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	35
	19/04/2022	EUR	15.902	USD	17.762	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(58)
								218.622 USD
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities								
	19/04/2022	USD	2.114.701	EUR	1.920.212	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20.669)
	19/04/2022	GBP	349.716	EUR	413.565	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
	19/04/2022	GBP	9.391.745	EUR	11.106.434	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(329)
	19/04/2022	GBP	2.547.247	EUR	3.012.308	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(89)
	19/04/2022	GBP	1.753.207	EUR	2.073.297	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(61)
	19/04/2022	GBP	715	EUR	846	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	GBP	91.064	EUR	107.690	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/04/2022	EUR	3.612	GBP	3.044	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/04/2022	EUR	17	GBP	14	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	8.520	GBP	7.164	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	48
	19/04/2022	EUR	13.747	GBP	11.559	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	78
	19/04/2022	GBP	444	EUR	528	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/04/2022	EUR	12.560	GBP	10.616	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/04/2022	GBP	3.657	EUR	4.354	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30)
	19/04/2022	GBP	542	EUR	647	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/04/2022	EUR	22	GBP	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	3.433	GBP	2.856	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	55
	19/04/2022	EUR	48	GBP	40	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	GBP	9.725	EUR	11.670	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(169)
	19/04/2022	EUR	7	GBP	6	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	36.391	USD	40.085	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	385
	19/04/2022	GBP	2.206	EUR	2.640	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(31)
	19/04/2022	GBP	408	EUR	488	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/04/2022	EUR	14.057	GBP	11.718	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	200
	19/04/2022	EUR	28	GBP	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities (continuación)								
	19/04/2022	GBP	364	EUR	437	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/04/2022	GBP	793	EUR	952	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	19/04/2022	EUR	2	GBP	1	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	28.521	GBP	23.928	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	226
	19/04/2022	GBP	67	EUR	79	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/04/2022	EUR	18.781	USD	20.862	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	41
	19/04/2022	EUR	132	GBP	111	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	527	GBP	446	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	07/04/2022	EUR	686.443	GBP	576.336	Operaciones comerciales	Lloyds	4.613
	07/04/2022	EUR	8.146.868	USD	9.000.000	Operaciones comerciales	Lloyds	59.638
	07/04/2022	USD	517.260	EUR	471.229	Operaciones comerciales	Lloyds	(6.429)
	07/04/2022	GBP	6.213.650	EUR	7.397.000	Operaciones comerciales	Lloyds	(45.972)
	07/04/2022	USD	1.163.230	EUR	1.056.500	Operaciones comerciales	Lloyds	(11.242)
	07/04/2022	EUR	685.140	USD	756.469	Operaciones comerciales	Barclays	5.391
	07/04/2022	EUR	743.555	GBP	624.879	Operaciones comerciales	Barclays	4.295
	07/04/2022	USD	2.000.000	EUR	1.805.726	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(8.561)
	07/04/2022	EUR	455.117	USD	502.197	Operaciones comerciales	Barclays	3.853
	07/04/2022	USD	475.764	EUR	432.230	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(4.717)
	07/04/2022	EUR	2.271.267	USD	2.500.000	Operaciones comerciales	Lloyds	24.816
	07/04/2022	EUR	619.947	GBP	516.501	Operaciones comerciales	Barclays	8.905
	07/04/2022	USD	7.296.180	EUR	6.627.946	Operaciones comerciales	Barclays	(71.728)
	07/04/2022	EUR	599.276	USD	657.820	Operaciones comerciales	Lloyds	8.172
	07/04/2022	GBP	3.869.480	EUR	4.584.816	Operaciones comerciales	Barclays	(7.047)
	07/04/2022	USD	1.231.521	EUR	1.115.177	Operaciones comerciales	Barclays	(8.555)
	07/04/2022	EUR	955.113	GBP	810.677	Operaciones comerciales	Barclays	(3.955)
	07/04/2022	EUR	1.105.147	USD	1.231.915	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(1.831)
	07/04/2022	USD	394.690	EUR	355.644	Operaciones comerciales	Lloyds	(982)
	07/04/2022	USD	1.000.000	EUR	902.064	Operaciones comerciales	Lloyds	(3.481)
	07/04/2022	EUR	158.781.140	USD	176.280.378	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	378.769
	07/04/2022	EUR	231.982.624	GBP	192.510.711	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	4.234.866
	07/04/2022	GBP	969.798	EUR	1.176.736	Operaciones comerciales	Lloyds	(29.422)
	07/04/2022	GBP	780.380	EUR	939.504	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(16.280)
	07/04/2022	USD	1.213.431	EUR	1.113.076	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(22.708)
	07/04/2022	EUR	3.182.808	USD	3.500.000	Operaciones comerciales	Lloyds	37.776
								4.507.807 EUR
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities								
	19/04/2022	CHF	902	EUR	873	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/04/2022	USD	977	EUR	887	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
	19/04/2022	GBP	711	EUR	841	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	979	EUR	889	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
	19/04/2022	GBP	712	EUR	842	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	986	EUR	895	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
	19/04/2022	GBP	717	EUR	848	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	979	EUR	889	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities <i>(continuación)</i>								
	19/04/2022	CHF	898	EUR	870	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/04/2022	GBP	707	EUR	836	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	984	EUR	894	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
	19/04/2022	GBP	716	EUR	846	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SEK	8.339	EUR	791	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/04/2022	NOK	8.387	EUR	842	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	19/04/2022	NOK	8.435	EUR	847	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	19/04/2022	GBP	34.726.539	EUR	41.066.704	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.218)
	19/04/2022	USD	986	EUR	895	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
	19/04/2022	EUR	3.065.840	GBP	2.583.191	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11.124
	01/04/2022	USD	90.286	EUR	82.847	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(1.702)
	01/04/2022	EUR	362.124	USD	400.000	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	2.622
	01/04/2022	EUR	9.720.524	USD	10.920.599	Operaciones comerciales	Barclays	(94.420)
	01/04/2022	EUR	13.492.403	GBP	11.315.634	Operaciones comerciales	Barclays	102.093
	01/04/2022	GBP	1.032.720	EUR	1.238.192	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(16.126)
	01/04/2022	USD	70.111	EUR	63.104	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(92)
	01/04/2022	GBP	250.000	EUR	303.786	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(7.950)
	01/04/2022	GBP	52.634	EUR	63.874	Operaciones comerciales	Barclays	(1.590)
	01/04/2022	USD	300.000	EUR	273.026	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(3.400)
	01/04/2022	GBP	250.000	EUR	297.015	Operaciones comerciales	Barclays	(1.178)
	01/04/2022	GBP	500.000	EUR	595.283	Operaciones comerciales	Barclays	(3.610)
	01/04/2022	EUR	68.679	USD	75.769	Operaciones comerciales	Barclays	581
	01/04/2022	EUR	181.728	USD	200.000	Operaciones comerciales	Barclays	1.977
	01/04/2022	EUR	56.178	GBP	46.946	Operaciones comerciales	Barclays	625
	03/05/2022	EUR	9.998.486	USD	11.135.971	Operaciones comerciales	Barclays	208
	03/05/2022	EUR	10.955.487	GBP	9.277.227	Operaciones comerciales	Barclays	(9.307)
	03/05/2022	USD	378.960	EUR	341.154	Operaciones comerciales	Barclays	(910)
								(22.268) EUR
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha								
	19/04/2022	USD	25.235	EUR	22.914	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(247)
	19/04/2022	GBP	308.516	EUR	364.843	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/04/2022	GBP	10.695.841	EUR	12.648.625	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(375)
	19/04/2022	GBP	714	EUR	844	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	CHF	72.533	EUR	70.253	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	592
	19/04/2022	USD	632	EUR	570	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/04/2022	GBP	7.702	EUR	9.140	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32)
	19/04/2022	GBP	267.304	EUR	317.210	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.111)
	19/04/2022	GBP	18	EUR	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	CHF	1.804	EUR	1.739	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
	19/04/2022	EUR	125.004	GBP	104.703	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.190
	19/04/2022	GBP	5.899	EUR	7.078	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(103)
	19/04/2022	USD	649	EUR	583	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	GBP	6.585	EUR	7.764	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha								
<i>(continuación)</i>	19/04/2022	GBP	282.043	EUR	332.541	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	986
	19/04/2022	GBP	19	EUR	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	CHF	1.843	EUR	1.785	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
								947 EUR
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha								
	19/04/2022	EUR	2.160.688	USD	2.379.533	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25.892
	19/04/2022	EUR	8.831	USD	9.725	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	106
	19/04/2022	EUR	3.331	USD	3.668	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	40
	19/04/2022	USD	475	EUR	432	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/04/2022	EUR	760	USD	835	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
	19/04/2022	EUR	99.987	USD	110.533	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	779
	19/04/2022	EUR	409	USD	452	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/04/2022	EUR	154	USD	170	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	EUR	51.494	USD	56.975	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	351
	19/04/2022	EUR	210	USD	233	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	EUR	79	USD	88	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	USD	132.837	EUR	120.852	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.703)
	19/04/2022	EUR	45.350	USD	50.506	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
								25.457 USD
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha								
	19/04/2022	EUR	930.660	USD	1.024.922	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11.151
	19/04/2022	EUR	198.791	USD	218.925	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.382
	19/04/2022	USD	3.025	EUR	2.754	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40)
	19/04/2022	EUR	43.090	USD	47.635	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	336
	19/04/2022	EUR	9.216	USD	10.188	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	72
	19/04/2022	EUR	20.516	USD	22.752	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	88
	19/04/2022	EUR	4.392	USD	4.871	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	19/04/2022	EUR	22.975	USD	25.304	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	273
	19/04/2022	EUR	4.889	USD	5.385	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	58
								14.339 USD
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities								
	19/04/2022	EUR	4.072.735	USD	4.485.242	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	48.804
	19/04/2022	CHF	2.031.246	USD	2.167.215	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	41.465
	19/04/2022	GBP	1.051.211	USD	1.369.454	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14.446
	19/04/2022	EUR	1.807.315	USD	1.990.368	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21.657
	19/04/2022	EUR	8.657.886	USD	9.534.800	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	103.747
	19/04/2022	GBP	62.692.930	USD	81.672.588	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	861.526
	19/04/2022	SGD	11.028.411	USD	8.071.203	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	77.028
	19/04/2022	GBP	5.234.559	USD	6.819.269	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	71.933
	19/04/2022	EUR	203.392	USD	223.993	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.437

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities (continuación)								
	19/04/2022	CHF	1.176	USD	1.254	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24
	19/04/2022	EUR	17.220	USD	18.929	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	241
	19/04/2022	USD	61.586	GBP	(47.205)	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(559)
	19/04/2022	EUR	20.111	USD	22.106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	282
	19/04/2022	EUR	2.198	USD	2.417	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	31
	19/04/2022	USD	2.032	GBP	1.557	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	19/04/2022	SGD	438.757	USD	321.677	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.494
	19/04/2022	GBP	114.381	USD	149.226	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.355
	19/04/2022	USD	2.037	EUR	1.854	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(27)
	19/04/2022	GBP	54.806	USD	71.606	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	545
	19/04/2022	USD	57.847	EUR	52.657	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(774)
	19/04/2022	EUR	191.219	USD	210.066	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.812
	19/04/2022	USD	2.146.727	GBP	1.643.075	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16.354)
	19/04/2022	SGD	902.232	USD	660.426	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.179
	19/04/2022	USD	324.429	GBP	248.313	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.472)
	19/04/2022	USD	62.876	EUR	57.300	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(914)
	19/04/2022	USD	30.692	CHF	28.840	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(666)
	19/04/2022	USD	18.586	GBP	14.256	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(182)
	19/04/2022	USD	28.106	EUR	25.614	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(409)
	19/04/2022	USD	133.057	EUR	121.257	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.934)
	19/04/2022	USD	1.159.638	GBP	889.490	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11.361)
	19/04/2022	USD	119.909	SGD	163.344	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(776)
	19/04/2022	USD	98.944	GBP	75.894	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(969)
	19/04/2022	USD	3.125	EUR	2.848	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(45)
	19/04/2022	USD	18	CHF	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	51.375	EUR	46.473	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(362)
	19/04/2022	USD	24.552	CHF	23.080	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(544)
	19/04/2022	USD	15.780	GBP	11.979	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/04/2022	USD	22.319	EUR	20.190	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(157)
	19/04/2022	USD	111.144	EUR	100.539	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(783)
	19/04/2022	USD	908.093	GBP	689.377	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	541
	19/04/2022	USD	102.511	SGD	138.990	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(181)
	19/04/2022	USD	75.856	GBP	57.586	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	45
	19/04/2022	USD	2.555	EUR	2.311	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	19/04/2022	USD	14	CHF	13	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	50.882	EUR	46.241	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(596)
	19/04/2022	USD	121.831	GBP	93.046	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(662)
	19/04/2022	USD	20.093	EUR	18.261	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(236)
	19/04/2022	EUR	1.000	USD	1.100	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/04/2022	USD	17.969	GBP	13.724	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(98)
	19/04/2022	SGD	452.242	USD	332.383	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.752
	19/04/2022	USD	346.538	GBP	264.660	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.882)
	19/04/2022	EUR	113.272	USD	125.618	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	485
	19/04/2022	CHF	57.034	USD	60.977	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.040
	19/04/2022	GBP	27.295	USD	35.909	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24
	19/04/2022	EUR	49.195	USD	54.557	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	210

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities (continuación)								
	19/04/2022	EUR	248.337	USD	275.403	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.062
	19/04/2022	GBP	1.727.423	USD	2.272.598	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.523
	19/04/2022	SGD	363.220	USD	268.120	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	241
	19/04/2022	GBP	136.636	USD	179.758	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	120
	19/04/2022	EUR	5.704	USD	6.325	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24
	19/04/2022	CHF	33	USD	35	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	USD	106.199	EUR	95.507	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(126)
	19/04/2022	USD	526	GBP	400	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	11.483	EUR	10.327	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	19/04/2022	USD	34.994	EUR	31.471	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42)
	19/04/2022	USD	20.244	GBP	15.388	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15)
	19/04/2022	USD	133.149	SGD	180.297	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(62)
	19/04/2022	USD	161.775	GBP	122.972	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(116)
	19/04/2022	USD	133.775	EUR	120.978	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(906)
	19/04/2022	GBP	100	USD	132	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	EUR	36.578	USD	40.448	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	274
	19/04/2022	EUR	3.311	USD	3.661	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25
	19/04/2022	GBP	621	USD	818	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	SGD	177.081	USD	130.568	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	267
	19/04/2022	USD	20.093	GBP	15.259	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/04/2022	USD	71.619	EUR	64.764	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(481)
	19/04/2022	CHF	39.950	USD	42.962	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	478
	19/04/2022	USD	22.824	GBP	17.287	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	65
	19/04/2022	USD	1.659	EUR	1.500	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/04/2022	GBP	1.020	USD	1.347	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/04/2022	SGD	378.075	USD	278.965	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	372
	19/04/2022	GBP	123.397	USD	162.916	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(467)
	19/04/2022	EUR	780	USD	860	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/04/2022	GBP	400	USD	530	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/04/2022	EUR	6.240	USD	6.883	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	64
	19/04/2022	USD	1.518	EUR	1.376	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	19/04/2022	USD	4.493	GBP	3.389	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	31
	19/04/2022	SGD	221.572	USD	163.183	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	523
	19/04/2022	GBP	82.862	USD	109.856	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(770)
	19/04/2022	EUR	127.031	USD	139.551	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.869
	19/04/2022	CHF	69.599	USD	74.616	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.063
	19/04/2022	GBP	32.472	USD	42.810	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(61)
	19/04/2022	EUR	60.702	USD	66.684	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	893
	19/04/2022	EUR	299.568	USD	329.093	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.407
	19/04/2022	GBP	2.084.512	USD	2.748.135	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.913)
	19/04/2022	SGD	450.676	USD	331.970	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.008
	19/04/2022	GBP	165.136	USD	217.709	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(310)
	19/04/2022	EUR	6.901	USD	7.581	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	102
	19/04/2022	CHF	40	USD	43	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	EUR	8.454	USD	9.307	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	104
	19/04/2022	GBP	54.210	USD	71.615	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(248)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities (continuación)								
	19/04/2022	EUR	4.990	USD	5.494	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	62
	19/04/2022	USD	1.391.648	EUR	1.264.086	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15.610)
	19/04/2022	GBP	266	USD	352	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/04/2022	SGD	694.549	USD	511.551	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.610
	19/04/2022	GBP	102.805	USD	135.812	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(471)
	19/04/2022	EUR	26.797	USD	29.517	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	315
	19/04/2022	GBP	3.000	USD	3.955	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	19/04/2022	EUR	33.000	USD	36.349	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	388
	19/04/2022	USD	68.672	EUR	62.345	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(733)
	19/04/2022	USD	2.745.368	GBP	2.082.580	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.689
	19/04/2022	SGD	659.952	USD	486.083	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.516
	19/04/2022	GBP	7.902	USD	10.417	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	19/04/2022	EUR	41.037	USD	45.106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	579
	19/04/2022	GBP	10.498	USD	13.849	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28)
	19/04/2022	EUR	10.358	USD	11.385	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	146
	19/04/2022	USD	129.948	EUR	118.224	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.666)
	19/04/2022	USD	90.320	GBP	68.466	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	185
	19/04/2022	SGD	799.143	USD	588.331	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.108
	19/04/2022	GBP	106.742	USD	140.813	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(289)
	19/04/2022	USD	185	EUR	169	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/04/2022	GBP	2.841	USD	3.717	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	19/04/2022	EUR	47	USD	51	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	EUR	5.000	USD	5.488	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	78
	19/04/2022	USD	181.768	GBP	138.935	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.138)
	19/04/2022	SGD	1.064.937	USD	782.256	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.561
	19/04/2022	GBP	84.410	USD	110.433	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	691
	19/04/2022	USD	87.393	EUR	79.349	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(943)
	19/04/2022	USD	46.082	CHF	43.008	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(683)
	19/04/2022	USD	27.430	GBP	20.934	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(129)
	19/04/2022	USD	41.790	EUR	37.943	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(451)
	19/04/2022	USD	167.670	EUR	152.236	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.809)
	19/04/2022	USD	1.584.626	GBP	1.209.322	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.426)
	19/04/2022	USD	238.136	SGD	323.848	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.136)
	19/04/2022	USD	138.450	GBP	105.660	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(649)
	19/04/2022	USD	4.612	EUR	4.187	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(50)
	19/04/2022	USD	26	CHF	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	13.112	EUR	11.804	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(29)
	19/04/2022	GBP	1.500	USD	1.970	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/04/2022	USD	7.706	EUR	6.938	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	19/04/2022	USD	241	GBP	183	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/04/2022	SGD	443.607	USD	327.160	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	595
	19/04/2022	GBP	104.267	USD	136.947	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	318
	19/04/2022	USD	73.215	EUR	65.741	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	27
	19/04/2022	USD	38.673	CHF	35.880	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(341)
	19/04/2022	USD	23.014	GBP	17.537	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(73)
	19/04/2022	USD	35.019	EUR	31.444	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities (continuación)								
	19/04/2022	USD	141.991	EUR	127.497	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	52
	19/04/2022	USD	1.332.225	GBP	1.015.172	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.230)
	19/04/2022	USD	210.687	SGD	285.344	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(136)
	19/04/2022	USD	117.476	GBP	89.518	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(373)
	19/04/2022	USD	3.883	EUR	3.487	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/04/2022	USD	22	CHF	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/04/2022	USD	55.677	EUR	49.848	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	182
	19/04/2022	USD	3.993	GBP	3.031	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/04/2022	EUR	2.490	USD	2.781	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/04/2022	GBP	28.487	USD	37.524	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(22)
	19/04/2022	USD	321.457	SGD	434.843	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	177
	19/04/2022	USD	31.872	GBP	24.196	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	19/04/2022	EUR	90.128	USD	100.744	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(407)
	19/04/2022	CHF	48.637	USD	52.692	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	193
	19/04/2022	GBP	23.984	USD	31.507	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	68
	19/04/2022	EUR	43.046	USD	48.117	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(194)
	19/04/2022	EUR	175.484	USD	196.154	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(792)
	19/04/2022	GBP	1.387.442	USD	1.822.619	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.924
	19/04/2022	SGD	402.206	USD	297.359	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(193)
	19/04/2022	GBP	124.793	USD	163.934	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	353
	19/04/2022	EUR	4.798	USD	5.363	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(22)
	19/04/2022	CHF	28	USD	30	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								1.206.919 USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado USD	% del patrimonio neto
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Venta	EUR	1.300.000	20/06/2025	24.119	0,00
CDS	Goldman Sachs	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	3.300.000	20/12/2026	20.950	0,00
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Venta	EUR	1.770.000	20/12/2026	354.086	0,06
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	74.000	20/06/2022	(653)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	150.000	20/06/2022	(1.324)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	295.000	20/06/2022	(2.604)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	185.000	20/06/2022	(1.633)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	55.000	20/06/2022	(313)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	55.000	20/06/2022	(313)	(0,00)
CDS	Barclays	Banca BPM SPA	Compra	EUR	146.000	20/06/2022	(1.289)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	60.000	20/06/2022	(342)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	80.000	20/06/2022	(456)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	580.000	20/12/2023	(34.251)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	200.000	20/12/2023	(11.811)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	50.000	20/12/2023	(285)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Glencore International	Venta	EUR	1.100.000	20/06/2026	190.924	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	17.825.000	20/12/2026	(1.570.384)	(0,29)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	17.750.000	20/12/2026	(313.485)	(0,06)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	20.000.000	20/12/2026	(353.222)	(0,06)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	20.000.000	20/12/2026	353.222	0,05
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Compra	EUR	2.000.000	20/12/2026	(57.034)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Telia Co AB	Compra	EUR	2.500.000	20/12/2026	(75.950)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Compra	EUR	2.330.000	20/12/2026	(70.292)	(0,01)
CDS	Barclays	Standard Chartered plc	Compra	EUR	4.740.000	20/12/2026	(71.793)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Compra	EUR	1.200.000	20/12/2026	(8.757)	(0,00)
CDS	JPMorgan	SSE plc	Compra	EUR	1.400.000	20/12/2026	(29.613)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	17.750.000	20/12/2026	313.485	0,06
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	17.750.000	20/06/2027	(268.632)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	17.825.000	20/06/2027	(1.439.861)	(0,26)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	17.825.000	20/12/2026	1.570.384	0,29
							(1.487.127) USD	(0,29)

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	2.950.000	20/06/2027	(214.168)	(0,17)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	2.950.000	20/12/2026	233.582	0,18
CDS	JPMorgan	Glencore International	Venta	EUR	400.000	20/06/2026	62.398	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	21.830.000	20/12/2026	(346.508)	(0,27)

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	2.950.000	20/12/2026	(233.583)	(0,19)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	4.500.000	20/12/2026	71.429	0,06
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	4.500.000	20/12/2026	71.429	0,06
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	3.300.000	20/12/2026	(52.381)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	3.000.000	20/12/2026	(47.619)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	14.930.000	20/06/2027	(203.077)	(0,16)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	14.930.000	20/12/2026	236.984	0,19
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	4.200.000	20/12/2026	66.667	0,05
							(354.847) EUR	(0,28)

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	Goldman Sachs	Cellnex Telecom SA	Venta	EUR	300.000	20/06/2022	3.141	0,00
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 31	Venta	EUR	933.340	20/06/2022	6.969	0,01
							10.110 EUR	0,01

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	325.000	20/12/2023	(17.249)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Venta	EUR	900.000	20/06/2025	15.007	0,01
CDS	Goldman Sachs	Barclays plc	Compra	EUR	1.700.000	20/12/2026	25.090	0,01
CDS	Goldman Sachs	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	1.700.000	20/12/2026	9.700	0,01
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	61.000	20/06/2022	(484)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	120.000	20/06/2022	(952)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	245.000	20/06/2022	(1.943)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	150.000	20/06/2022	(1.190)	(0,00)
CDS	Barclays	Coöperatieve Rabobank U.A.	Compra	EUR	900.000	20/12/2026	1.728	0,00
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	165.000	20/06/2022	(845)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	165.000	20/06/2022	(845)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	124.000	20/06/2022	(984)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	165.000	20/06/2022	(845)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Venta	EUR	235.000	20/06/2022	(1.203)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Glencore International	Venta	EUR	600.000	20/06/2026	93.596	0,05
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Compra	USD	800.000	20/06/2023	(37.283)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	22.600.000	20/12/2026	(1.789.477)	(0,96)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	35.520.000	20/12/2026	(563.809)	(0,30)

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	4.000.000	20/12/2026	63.492	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 36	Compra	EUR	4.340.000	20/12/2026	78.749	0,04
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Compra	USD	17.730.000	20/12/2026	(273.748)	(0,15)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	8.700.000	20/12/2026	138.095	0,07
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	6.000.000	20/12/2026	95.238	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	5.800.000	20/12/2026	92.063	0,05
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	1.700.000	20/12/2026	134.607	0,07
CDS	Goldman Sachs	Fortum OYJ	Compra	EUR	1.100.000	20/12/2026	29.593	0,02
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Compra	EUR	1.750.000	20/12/2026	(44.852)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Electricite DE	Compra	EUR	1.300.000	20/12/2026	(7.753)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Diamler AG	Compra	EUR	537.500	20/12/2026	(8.789)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Compra	EUR	2.200.000	20/12/2026	(32.753)	(0,02)
CDS	Barclays	Standard Chartered plc	Compra	EUR	2.190.000	20/12/2026	(29.812)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Telia Co AB	Compra	EUR	1.700.000	20/12/2026	(46.417)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Compra	EUR	2.160.000	20/12/2026	(58.566)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Compra	EUR	800.000	20/12/2026	(5.247)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	5.000.000	20/12/2026	(395.902)	(0,21)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Venta	USD	6.200.000	20/12/2026	95.727	0,05
CDS	JPMorgan	SSE plc	Compra	EUR	1.870.000	20/12/2026	(35.549)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	3.730.000	20/12/2026	59.206	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	7.290.000	20/06/2027	(99.158)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	7.290.000	20/12/2026	115.714	0,06
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	25.900.000	20/06/2027	(1.880.322)	(1,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	25.900.000	20/12/2026	2.050.772	1,10
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	4.340.000	20/12/2026	(78.748)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 37	Compra	EUR	4.340.000	20/06/2027	114.399	0,06
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Compra	USD	11.530.000	20/06/2027	(166.254)	(0,09)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Venta	USD	11.530.000	20/12/2026	178.021	0,10
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Venta	USD	11.530.000	20/06/2027	166.255	0,08
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	7.290.000	20/06/2027	99.158	0,05
							(1.924.769) EUR	(1,03)

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado USD	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	3.600.000	20/12/2026	317.160	0,71
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Venta	USD	3.340.000	20/12/2026	57.378	0,13

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado USD	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Venta	USD	3.340.000	20/06/2027	53.586	0,12
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	3.600.000	20/06/2027	290.799	0,65
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Compra	USD	3.340.000	20/12/2026	(57.378)	(0,13)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	3.600.000	20/12/2026	(317.160)	(0,72)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	800.000	20/06/2027	(64.622)	(0,14)
							279.763 USD	0,62

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado USD	% del patrimonio neto
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	100.000	20/12/2023	(9.001)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	255.000	20/12/2026	(22.466)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	2.250.000	20/12/2026	(39.738)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Compra	EUR	70.000	20/12/2026	(1.996)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	870.000	20/12/2026	15.365	0,01
CDS	JPMorgan	Telia Co AB	Compra	EUR	90.000	20/12/2026	(2.734)	(0,00)
CDS	Barclays	Standard Chartered plc	Compra	EUR	130.000	20/12/2026	(1.969)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Barclays plc	Compra	EUR	80.000	20/12/2026	1.314	0,00
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Venta	EUR	40.000	20/12/2026	8.002	0,00
CDS	JPMorgan	SSE plc	Compra	EUR	70.000	20/12/2026	(1.481)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	800.000	20/12/2026	14.129	0,01
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Compra	USD	1.000.000	20/12/2026	(17.179)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Venta	USD	400.000	20/12/2026	6.872	0,00
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Venta	USD	600.000	20/12/2026	10.307	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	880.000	20/12/2026	15.542	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	880.000	20/06/2027	(13.318)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	255.000	20/06/2027	(20.598)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	255.000	20/12/2026	22.465	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	570.000	20/12/2026	10.067	0,01
							(26.417) USD	(0,02)

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de rentabilidad total:

Descripción	Contraparte	Subyacente/ Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
SRT	Bank of America Merrill Lynch	North America Equity Basket	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 16 acciones y recibe US-1M- LIBOR.	USD	3.018.372	20/04/2023	(32.644)	(0,13)
SRT	UBS	North America Equity Basket	Paga US-1M-LIBOR +0,30% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 13 acciones. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 42 acciones y recibe US-1M-LIBOR.	USD	9.302.106	26/06/2023	(107.980)	(0,44)
							(140.624) USD	(0,57)

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	100.000	20/06/2022	(793)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	2.855.000	20/06/2022	(22.646)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	5.810.000	20/06/2022	(46.086)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	3.645.000	20/06/2022	(28.913)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	1.477.000	20/06/2022	(11.716)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	3.765.000	20/06/2022	(19.273)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	3.765.000	20/06/2022	(19.273)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	3.765.000	20/06/2022	(19.273)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	2.853.000	20/06/2022	(22.631)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	5.185.000	20/06/2022	(26.542)	(0,00)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Compra	USD	21.150.000	20/12/2022	(601.867)	(0,06)
CDS	JPMorgan	Henkel AG & Co	Compra	EUR	17.700.000	20/12/2026	(585.477)	(0,06)
CDS	Goldman Sachs	Arcelormittal	Compra	EUR	7.500.000	20/12/2023	(562.146)	(0,06)
CDS	Goldman Sachs	Barclays plc	Compra	EUR	5.690.000	20/12/2026	83.976	0,01
CDS	Goldman Sachs	Coöperatieve Rabobank U.A.	Compra	EUR	14.200.000	20/12/2026	27.272	0,00
CDS	Goldman Sachs	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	10.220.000	20/12/2026	(202.936)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	24.700.000	20/12/2026	140.930	0,01
CDS	Goldman Sachs	Barclays plc	Compra	EUR	9.830.000	20/12/2026	(120.894)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Venta	EUR	4.000.000	20/12/2026	719.178	0,07
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	179.150.000	20/12/2026	(14.185.167)	(1,45)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	1.000.000	20/06/2022	(7.932)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Venta	EUR	3.950.000	20/06/2025	65.864	0,01
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues	Compra	EUR	500.000	20/06/2022	(2.560)	(0,00)
CDS	Barclays	Coöperatieve Rabobank U.A.	Compra	EUR	4.600.000	20/12/2026	8.834	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	400.000	20/06/2022	(3.173)	(0,00)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Compra	USD	600.000	20/12/2022	(17.074)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues	Compra	EUR	900.000	20/06/2022	(4.607)	(0,00)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Compra	USD	1.200.000	20/12/2022	(34.148)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	97.450.000	20/12/2026	(1.546.825)	(0,16)

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 36	Compra	EUR	22.180.000	20/12/2026	(265.224)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 36	Compra	EUR	25.090.000	20/12/2026	455.258	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	4.400.000	20/12/2026	(69.841)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Compra	USD	301.650.000	20/12/2026	(4.657.429)	(0,47)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	64.800.000	20/12/2026	1.028.571	0,10
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	64.800.000	20/12/2026	(1.028.571)	(0,10)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Compra	EUR	16.100.000	20/12/2026	(412.640)	(0,04)
CDS	JPMorgan	Electricite DE	Compra	EUR	6.250.000	20/12/2026	(37.273)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Bayerische Motoren Werke AG	Compra	EUR	10.860.000	20/12/2026	(206.912)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Diamler AG	Compra	EUR	19.355.000	20/12/2026	(316.498)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Compra	EUR	16.700.000	20/12/2026	(248.628)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Telia Co AB	Compra	EUR	15.800.000	20/12/2026	(431.406)	(0,04)
CDS	Barclays	Standard Chartered plc	Compra	EUR	13.500.000	20/12/2026	(183.773)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Compra	EUR	18.560.000	20/12/2026	(503.232)	(0,05)
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings	Compra	EUR	4.115.000	20/12/2026	(67.720)	(0,01)
CDS	Bank of America Merrill Lynch	ING Groep NV	Compra	EUR	7.500.000	20/12/2026	32.965	0,00
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings	Compra	EUR	22.210.000	20/12/2026	154.197	0,02
CDS	Barclays	Natwest Group	Compra	EUR	10.540.000	20/12/2026	98.990	0,01
CDS	Citigroup Global Markets	Westpac banking Corp.	Compra	USD	23.030.000	20/12/2026	(498.850)	(0,05)
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Compra	EUR	9.700.000	20/12/2026	(63.621)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Societe Generale SA	Compra	EUR	19.000.000	20/12/2026	(91.263)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	17.600.000	20/12/2026	(1.393.575)	(0,14)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Venta	USD	24.580.000	20/12/2026	379.511	0,04
CDS	Barclays	Sanofi SA	Compra	EUR	8.900.000	20/12/2026	(309.120)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	24.000.000	20/12/2026	380.952	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	40.000.000	20/12/2026	634.921	0,06
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	37.850.000	20/12/2026	600.794	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	37.850.000	20/06/2027	(514.833)	(0,05)
CDS	BNP Paribas	British Telecommunications plc	Compra	EUR	15.000.000	20/06/2027	(5.139)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	196.750.000	20/06/2027	(14.283.914)	(1,46)
CDS	BNP Paribas	Monitchem Holdco 3 S.A.	Compra	EUR	10.000.000	20/06/2027	(940.184)	(0,10)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	196.750.000	20/12/2026	15.578.742	1,58
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 36	Venta	EUR	25.090.000	20/12/2026	(455.258)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 37	Compra	EUR	25.090.000	20/06/2027	661.355	0,07
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 37	Compra	EUR	22.180.000	20/06/2027	(212.460)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 36	Venta	EUR	22.180.000	20/12/2026	265.224	0,03
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Compra	USD	277.070.000	20/06/2027	(3.995.158)	(0,41)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Venta	USD	277.070.000	20/12/2026	4.277.918	0,43

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Venta	USD	92.430.000	20/06/2027	1.332.776	0,14
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	37.850.000	20/06/2027	514.833	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	34.680.000	20/06/2027	471.713	0,05
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	200.000.000	15/06/2022	(789.219)	(0,08)
CDS	Barclays	TRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	200.000.000	15/06/2022	2.310.393	0,24
							(19.848.526) EUR	(2,02)

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	2.910.000	20/06/2027	(211.264)	(0,47)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	2.910.000	20/12/2026	230.415	0,52
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Compra	EUR	60.000	20/06/2023	(598)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Pearson PLC	Compra	EUR	40.000	20/06/2023	(336)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banca Popolare Di Milano	Compra	EUR	30.000	20/06/2023	(1.298)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues	Compra	EUR	30.000	20/06/2023	(773)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Compra	EUR	80.000	20/06/2023	(797)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Venta	EUR	350.000	20/06/2025	5.836	0,01
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Compra	EUR	60.000	20/06/2023	(598)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Barclays plc	Compra	EUR	590.000	20/12/2026	8.708	0,02
CDS	Goldman Sachs	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	700.000	20/12/2026	(13.900)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	2.600.000	20/12/2026	14.835	0,03
CDS	Goldman Sachs	Barclays plc	Compra	EUR	350.000	20/12/2026	(4.304)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Coöperatieve Rabobank U.A.	Compra	EUR	1.300.000	20/12/2026	2.497	0,01
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	30.000	20/06/2023	(773)	(0,00)
CDS	JPMorgan	United Utilities Group	Compra	EUR	80.000	20/12/2023	(1.186)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	30.000	20/06/2023	(1.298)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	145.000	20/12/2023	(7.696)	(0,02)
CDS	Barclays	Tesco plc	Compra	EUR	100.000	20/12/2023	(1.260)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Compra	EUR	260.000	20/12/2023	(3.277)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	250.000	20/12/2023	(13.269)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	2.910.000	20/12/2026	(230.415)	(0,52)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	7.320.000	20/12/2026	(116.190)	(0,26)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 36	Compra	EUR	1.250.000	20/12/2026	(14.947)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 36	Compra	EUR	3.810.000	20/12/2026	69.133	0,15
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	300.000	20/12/2026	4.762	0,01

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	2.100.000	20/12/2026	33.333	0,07
CDS	Goldman Sachs	Fortum OYJ	Compra	EUR	425.000	20/12/2026	11.433	0,03
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Compra	EUR	830.000	20/12/2026	(21.273)	(0,05)
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Venta	EUR	190.000	20/12/2026	34.161	0,08
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	200.000	20/12/2026	(3.175)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Compra	USD	15.250.000	20/12/2026	(235.458)	(0,53)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Venta	USD	1.580.000	20/12/2026	24.395	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	2.820.000	20/12/2026	44.762	0,10
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	2.200.000	20/12/2026	34.921	0,08
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	300.000	20/12/2026	(4.762)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	2.100.000	20/12/2026	(33.333)	(0,07)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	1.100.000	20/12/2026	17.460	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	300.000	20/12/2026	4.762	0,01
CDS	JPMorgan	Electricite DE	Compra	EUR	400.000	20/12/2026	(2.385)	(0,01)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Compra	USD	500.000	20/12/2026	(64.222)	(0,14)
CDS	JPMorgan	Bayerische Motoren Werke AG	Compra	EUR	600.000	20/12/2026	(11.432)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Diamler AG	Compra	EUR	1.077.500	20/12/2026	(17.620)	(0,04)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Compra	EUR	450.000	20/12/2026	(6.700)	(0,02)
CDS	Barclays	Standard Chartered plc	Compra	EUR	1.300.000	20/12/2026	(17.697)	(0,04)
CDS	JPMorgan	Telia Co AB	Compra	EUR	900.000	20/12/2026	(24.574)	(0,06)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Compra	EUR	850.000	20/12/2026	(23.047)	(0,05)
CDS	JPMorgan	Henkel AG & Co	Compra	EUR	1.300.000	20/12/2026	(43.001)	(0,10)
CDS	Barclays	Natwest Group	Compra	EUR	1.030.000	20/12/2026	9.674	0,02
CDS	Bank of America Merrill Lynch	ING Groep NV	Compra	EUR	740.000	20/12/2026	3.253	0,01
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings	Compra	EUR	735.000	20/12/2026	(12.096)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings	Compra	EUR	1.570.000	20/12/2026	10.900	0,02
CDS	Citigroup Global Markets	Westpac banking Corp.	Compra	USD	1.700.000	20/12/2026	(36.823)	(0,08)
CDS	JPMorgan	Societe Generale SA	Compra	EUR	1.000.000	20/12/2026	(4.803)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Compra	EUR	650.000	20/12/2026	(4.263)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	1.000.000	20/12/2026	15.873	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	1.200.000	20/12/2026	19.048	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	2.200.000	20/12/2026	34.921	0,08
CDS	JPMorgan	Natural Energy Group SA	Compra	EUR	800.000	20/12/2026	(6.038)	(0,01)
CDS	JPMorgan	SSE plc	Compra	EUR	960.000	20/12/2026	(18.250)	(0,04)
CDS	Barclays	Sanofi SA	Compra	EUR	1.100.000	20/12/2026	(38.206)	(0,09)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	3.300.000	20/12/2026	(52.381)	(0,12)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	3.300.000	20/06/2027	44.886	0,10

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 36	Venta	EUR	3.810.000	20/12/2026	(69.133)	(0,15)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 37	Compra	EUR	3.810.000	20/06/2027	100.429	0,23
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 37	Compra	EUR	1.250.000	20/06/2027	(11.975)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 36	Venta	EUR	1.250.000	20/12/2026	14.947	0,04
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Venta	USD	13.670.000	20/12/2026	211.063	0,47
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Compra	USD	13.670.000	20/06/2027	(197.113)	(0,44)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	1.300.000	20/06/2027	17.683	0,04
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Venta	USD	2.780.000	20/06/2027	40.086	0,09
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	2.180.000	20/06/2027	29.652	0,07
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	50.000.000	15/06/2022	(56.103)	(0,13)
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	50.000.000	15/06/2022	152.212	0,34
							(394.002) EUR	(0,88)

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de rentabilidad total:

Descripción	Contraparte	Subyacente/ Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
SRT	Goldman Sachs	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 4 acciones y recibe 1M EONIA -0,35%.	EUR	6.833.090	del 05/05/2027 al 24/10/2029	(78.503)	(0,06)
SRT	Goldman Sachs	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la acción subyacente y recibe 1M SONIA -0,35%.	GBP	1.550.134	18/05/2029	(74.572)	(0,06)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones y recibe 1M TOIS.	CHF	4.819.687	05/02/2024	155.534	0,13
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones y recibe 1M CIBOR.	DKK	22.971.273	05/02/2024	(32.848)	(0,03)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 16 acciones y recibe 1M EONIA.	EUR	23.458.053	05/02/2024	(332.756)	(0,28)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la acción subyacente y recibe 1M NIBOR.	NOK	24.987.392	05/02/2024	25.081	0,02
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 6 acciones y recibe 1M STIBOR.	SEK	125.868.661	05/02/2024	291.061	0,24
							(47.003) EUR	(0,04)

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de rentabilidad total:

Descripción	Contraparte	Subyacente/ Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nocional	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
SRT	Bank of America Merrill Lynch	North America Equity Basket	Paga US-1M-LIBOR +0,30% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 4 acciones. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 16 acciones y recibe US- 1M-LIBOR.	USD	31.305.403	20/04/2023	(211.444)	(0,17)
SRT	UBS	North America Equity Basket	Paga US-1M-LIBOR +0,30% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 13 acciones. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 42 acciones y recibe US- 1M-LIBOR.	USD	32.895.157	26/06/2023	(318.592)	(0,25)
							(530.036) USD	(0,42)

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de rentabilidad total:

Descripción	Contraparte	Subyacente/ Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nocional	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones y recibe AUD 1M LIBOR +0,40%.	AUD	4.003.187	10/01/2025	(254.367)	(0,26)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga 1M CIBOR +0,35% y recibe el rendimiento de la acción subyacente.	CHF	1.610.786	01/12/2022	106.599	0,11
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga DKDRA +0,30% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones.	DKK	2.451.500	08/01/2025	41.815	0,04
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga 1M EURIBOR +0,35% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 3 acciones. Paga el rendimiento de la acción subyacente y recibe 1M-EONIA.	EUR	1.854.311	10/01/2025	18.215	0,02
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga GBP 1M LIBOR +0,35% y recibe el rendimiento de la acción subyacente. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones y recibe GBP 1M LIBOR.	GBP	2.571.753	10/01/2025	(175.417)	(0,18)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga NOK 1M LIBOR y recibe el rendimiento de la acción subyacente.	NOK	8.472.153	10/03/2025	13.535	0,01

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/ Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga US 1M LIBOR +0,35% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 20 acciones. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 16 acciones y recibe US 1M LIBOR.	USD	45.548.569	10/01/2025	2.115.332	2,14
							1.865.712 USD	1,88

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de rentabilidad total:

Descripción	Contraparte	Subyacente/ Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
SRT	Citigroup	North America Commodities Basket	Paga el 0,14% y recibe el rendimiento de BCOMF3 Index.	USD	44.592.767	06/04/2022	1.627.423	0,30
SRT	Credit Suisse	North America Commodities Basket	Paga el 0,25% y recibe el rendimiento de BCOMF3 Index.	USD	42.144.562	04/04/2022	1.538.075	0,28
SRT	Goldman Sachs	North America Commodities Basket	Paga el 0,11% y recibe el rendimiento de BCOMF3 Index. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 3 índices y recibe el 0,11%.	USD	221.178.746	04/04/2022	5.805.622	1,05
SRT	JPMorgan	North America Commodities Basket	Paga del 0% al 0,27% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 24 índices. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 22 índices.	USD	1.397.179.007	del 31/03/2022 al 04/04/2022	3.701.658	0,68
SRT	Macquarie	North America Commodities Basket	Paga el 0,17% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 2 índices.	USD	144.458.250	04/04/2022	5.184.353	0,95
							17.857.131 USD	3,26

Notas a los estados financieros

(continuación)

11 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE FUTUROS

A 31 de marzo de 2022, la contraparte de los contratos de futuros pendientes es UBS.

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-BUND Future	Ventas	(258)	EUR	(27.470.848)	08/06/2022	2.433.054	0,48
Euro-BOBL Future	Ventas	(110)	EUR	(12.182.972)	08/06/2022	526.042	0,10
Euro-BUXL 30 Year Future	Ventas	(18)	EUR	(2.873.815)	08/06/2022	316.418	0,06
Euro-OAT Future	Ventas	(29)	EUR	(3.404.088)	08/06/2022	240.674	0,05
10-Year Australian Treasury Bond Future	Compras	10	AUD	951.777	15/06/2022	(37.262)	(0,01)
10-Year US Treasury Note	Compras	161	USD	16.318.859	21/06/2022	(690.839)	(0,13)
Government of Canada Bond Futures	Compras	58	CAD	4.249.802	21/06/2022	(220.987)	(0,04)
US Treasury Bond Future	Ventas	(47)	USD	(4.876.250)	21/06/2022	245.508	0,05
US Treasury Bond Future	Ventas	(259)	USD	(23.771.344)	21/06/2022	1.241.988	0,24
US Treasury Bond Future	Compras	86	USD	10.880.344	21/06/2022	(530.758)	(0,10)
UK Treasury Future	Ventas	(95)	GBP	(15.561.546)	28/06/2022	266.917	0,05
5-Year US Treasury Note	Compras	646	USD	59.956.875	30/06/2022	(2.035.940)	(0,40)
US Treasury Bond Future	Compras	27	USD	5.381.016	30/06/2022	(80.624)	(0,02)
						1.674.191 USD	0,33

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-BUND Future	Ventas	(67)	EUR	(6.411.632)	08/06/2022	550.994	0,43
Euro-BUXL 30 Year Future	Ventas	(8)	EUR	(1.147.936)	08/06/2022	121.332	0,10
10-Year US Treasury Note Future	Ventas	(4)	USD	(364.389)	21/06/2022	15.385	0,01
US Treasury Bond Future	Ventas	(12)	USD	(989.867)	21/06/2022	58.961	0,05
US Treasury Bond Future	Ventas	(5)	USD	(568.533)	21/06/2022	27.421	0,02
						774.093 EUR	0,61

Notas a los estados financieros

(continuación)

11 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE FUTUROS

(continuación)

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
10-Year US Treasury Note Future	Ventas	(31)	USD	(2.824.015)	21/06/2022	93.545	0,02
						93.545 EUR	0,02

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - European Social Bond tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-BUND Future	Ventas	(31)	EUR	(2.966.576)	08/06/2022	1.410	0,00
Euro-BTP Future	Ventas	(4)	EUR	(365.796)	08/06/2022	19.746	0,00
Short Euro-BTP Future	Ventas	(1)	EUR	(102.552)	08/06/2022	1.130	0,00
10-Year US Treasury Note Future	Ventas	(48)	USD	(4.372.669)	21/06/2022	182.255	0,05
UK Treasury Future	Ventas	(168)	GBP	(24.733.173)	28/06/2022	361.652	0,10
5-Year US Treasury Note Future	Ventas	(18)	USD	(1.501.483)	30/06/2022	52.928	0,01
US Treasury Bond Future	Ventas	(4)	USD	(716.476)	30/06/2022	10.751	0,00
						629.872 EUR	0,16

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-BUND Future	Ventas	(221)	EUR	(21.148.816)	08/06/2022	1.987.849	1,06
Euro-BOBL Future	Ventas	(166)	EUR	(16.523.806)	08/06/2022	797.923	0,43
Euro-BUXL 30 Year Future	Ventas	(24)	EUR	(3.443.808)	08/06/2022	406.057	0,22
Euro-SCHATZ Future	Ventas	(7)	EUR	(700.868)	08/06/2022	9.758	0,01
Euro-OAT Future	Compras	13	EUR	1.371.474	08/06/2022	(107.523)	(0,06)
10-Year US Treasury Note Future	Ventas	(31)	USD	(2.824.015)	21/06/2022	111.422	0,06
US Treasury Bond Future	Compras	3	USD	279.738	21/06/2022	(17.952)	(0,01)
US Treasury Bond Future	Ventas	(55)	USD	(4.536.888)	21/06/2022	227.542	0,12
US Treasury Bond Future	Compras	13	USD	1.478.186	21/06/2022	(72.108)	(0,04)
UK Treasury Future	Ventas	(63)	GBP	(9.274.940)	28/06/2022	159.087	0,09

Notas a los estados financieros

(continuación)

11 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE FUTUROS

(continuación)

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nocionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
5-Year US Treasury Note Future	Ventas	(8)	USD	(667.326)	30/06/2022	23.861	0,01
						3.525.916 EUR	1,89

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds tenía pendiente el siguiente contrato de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nocionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
10-Year US Treasury Note Future	Ventas	(45)	USD	(4.561.172)	21/06/2022	192.573	0,47
						192.573 USD	0,47

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nocionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
US Treasury Bond Future	Ventas	(3)	USD	(311.250)	21/06/2022	16.611	0,05
US Treasury Bond Future	Ventas	(6)	USD	(550.688)	21/06/2022	24.177	0,07
						40.788 USD	0,12

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nocionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
10-Year US Treasury Note	Ventas	(60)	USD	(6.081.563)	21/06/2022	198.170	0,22
5-Year US Treasury Note	Compras	95	USD	8.817.188	30/06/2022	(259.933)	(0,29)
						(61.763) USD	(0,07)

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond tenía pendientes el siguiente contrato de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nocionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
10-Year US Treasury Note	Ventas	(20)	USD	(2.027.188)	21/06/2022	66.057	0,11
						66.057 USD	0,11

Notas a los estados financieros

(continuación)

11 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE FUTUROS

(continuación)

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
SGX MSCI Taiwan Index Future	Compras	11	USD	683.935	28/04/2022	9.106	0,03
TOPIX Index	Compras	8	JPY	1.153.073	09/06/2022	103.167	0,31
KOSPI 200 Index	Compras	10	KRW	677.933	09/06/2022	35.291	0,10
FTSE 100 Index	Compras	9	GBP	797.268	17/06/2022	36.048	0,11
S&P 500 Future	Compras	12	USD	2.443.221	17/06/2022	169.007	0,50
						352.619 EUR	1,05

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia no realizada en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
SGX MSCI Taiwan Index Future	Compras	2	USD	138.360	28/04/2022	1.842	0,00
KOSPI 200 Index	Compras	2	KRW	15.086.039	09/06/2022	7.853	0,02
TOPIX Index	Compras	22	JPY	352.815.699	09/06/2022	315.669	0,70
S&P 500 Future	Ventas	(65)	USD	(14.724.938)	17/06/2022	(1.099.474)	(2,45)
FTSE 100 Index	Compras	9	GBP	887.080	17/06/2022	44.425	0,10
Euro Stoxx Future	Ventas	(55)	EUR	(2.339.514)	17/06/2022	(82.657)	(0,18)
						(812.342) USD	(1,81)

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-BUND Future	Ventas	(8)	EUR	(851.809)	08/06/2022	74.506	0,05
Euro-BOBL Future	Ventas	(7)	EUR	(775.280)	08/06/2022	35.275	0,02
Euro-OAT Future	Ventas	(1)	EUR	(117.382)	08/06/2022	8.299	0,01
S&P 500 Future	Compras	76	USD	17.216.850	17/06/2022	551.247	0,38
10-Year US Treasury Note Future	Compras	1	USD	101.359	21/06/2022	(4.291)	(0,00)
Government of Canada Bond Futures	Compras	2	CAD	146.545	21/06/2022	(7.620)	(0,01)
US Treasury Bond Future	Ventas	(5)	USD	(458.906)	21/06/2022	27.215	0,02
US Treasury Bond Future	Ventas	(1)	USD	(126.516)	21/06/2022	6.117	(0,00)
UK Treasury Future	Ventas	(3)	GBP	(491.417)	28/06/2022	8.429	0,01
5-Year US Treasury Note Future	Compras	5	USD	464.063	30/06/2022	(16.644)	(0,01)

Notas a los estados financieros

(continuación)

11 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE FUTUROS

(continuación)

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
US Treasury Bond Future	Compras	2	USD	398.594	30/06/2022	(5.972)	(0,00)
						676.561 USD	0,47

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha tenía pendiente el siguiente contrato de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
S&P 500 Future	Ventas	(53)	USD	(12.006.488)	17/06/2022	(894.660)	(3,62)
						(894.660) USD	(3,62)

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-BUND Future	Ventas	(567)	EUR	(54.259.632)	08/06/2022	4.678.310	0,48
Euro-BOBL Future	Ventas	(1.049)	EUR	(104.418.509)	08/06/2022	4.750.951	0,47
Euro-BUXL 30 Year Future	Ventas	(56)	EUR	(8.035.552)	08/06/2022	884.746	0,09
Euro-OAT Future	Ventas	(210)	EUR	(22.154.580)	08/06/2022	1.566.360	0,16
10-Year US Treasury Note	Ventas	(294)	USD	(26.782.597)	21/06/2022	1.080.009	0,11
US Treasury Bond Future	Ventas	(37)	USD	(3.450.097)	21/06/2022	190.005	0,02
US Treasury Bond Future	Ventas	(316)	USD	(26.066.485)	21/06/2022	1.427.029	0,15
US Treasury Bond Future	Ventas	(66)	USD	(7.504.634)	21/06/2022	361.955	0,04
UK Treasury Future	Ventas	(673)	GBP	(99.079.913)	28/06/2022	1.659.924	0,17
5-Year US Treasury Note	Compras	70	USD	5.839.100	30/06/2022	(4.738)	(0,00)
						16.594.551 EUR	1,69

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-BUND Future	Ventas	(62)	EUR	(5.933.152)	08/06/2022	470.591	1,04
Euro-BOBL Future	Ventas	(36)	EUR	(3.583.476)	08/06/2022	158.565	0,36
Euro-BUXL 30 Year Future	Ventas	(3)	EUR	(430.476)	08/06/2022	47.397	0,11
Euro-SCHATZ Future	Ventas	(2)	EUR	(200.248)	08/06/2022	2.528	0,01
Euro-OAT Future	Ventas	(8)	EUR	(843.984)	08/06/2022	59.671	0,13

Notas a los estados financieros

(continuación)

11 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE FUTUROS

(continuación)

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
10-Year US Treasury Note Future	Ventas	(11)	USD	(1.002.070)	21/06/2022	40.468	0,09
US Treasury Bond Future	Ventas	(3)	USD	(279.738)	21/06/2022	11.574	0,03
US Treasury Bond Future	Ventas	(28)	USD	(2.309.689)	21/06/2022	125.470	0,28
US Treasury Bond Future	Ventas	(3)	USD	(341.120)	21/06/2022	16.452	0,04
UK Treasury Future	Ventas	(39)	GBP	(5.741.629)	28/06/2022	98.525	0,22
5-Year US Treasury Note Future	Compras	6	USD	500.494	30/06/2022	(220)	(0,00)
						1.031.021 EUR	2,31

12 OPCIONES AL VALOR DE MERCADO

A 31 de marzo de 2022, Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income tenía pendientes las siguientes opciones:

Descripción	Contraparte	Precio de ejercicio	Divisa	Contratos	Fecha de vencimiento	Compromiso en la divisa base de la cartera	Valor de mercado en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Opciones sobre futuros								
Call S&P 500 Index	UBS	4.480,000	USD	(59)	08/04/2022	22.095.154*	(564.511)	(0,40)
Call DJ Euro Stoxx 50	UBS	3.925,000	EUR	(116)	14/04/2022	2.486.829*	(80.280)	(0,06)
Call FTSE 100 Index	UBS	7.475,000	GBP	(40)	14/04/2022	2.568.131*	(63.463)	(0,04)
						(708.254) USD	(0,50)	

* El compromiso en posiciones cortas de compra es ilimitado.

13 AGRUPACIÓN

La SICAV podrá invertir y administrar la totalidad o parte de los activos establecidos para dos o más Carteras («Carteras Participantes») de forma conjunta. Cualquier grupo de activos de este tipo se formará mediante la transferencia de efectivo u otros activos (sujeto a que dichos activos sean apropiados con respecto a la política de inversión del conjunto en cuestión) de cada una de las Carteras Participantes.

La participación de una Cartera Participante en un conjunto de activos se medirá por referencia a participaciones nacionales de igual valor en el conjunto de activos.

A 31 de marzo de 2022, la SICAV no tenía agrupación de activos. Sin embargo, la Cartera Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return, para fines de gestión de inversiones, se divide por clases de activos en diversas cestas que solo ella posee.

14 CAMBIOS EN LA COMPOSICIÓN DE ESTADOS DE LA CARTERA

Los cambios en los Estados de la Cartera están disponibles para los Accionistas previa solicitud y de forma gratuita en el domicilio social de la SICAV.

15 AJUSTE DE DILUCIÓN

Las Carteras pueden sufrir una reducción del Valor liquidativo por Acción debido a los diferenciales de negociación, los costes operativos y las tasas impositivas que surgen cuando las compras y las ventas de inversiones subyacentes las realiza el Subasesor para acomodar las entradas de efectivo y las salidas de capital, lo que se conoce como «dilución». Se podrá aplicar un ajuste de dilución para proteger a los Accionistas de las Carteras contrarrestando el impacto de la dilución (el «Ajuste de dilución»). Si la actividad neta de capital (incluidas suscripciones, reembolsos y conversiones en una Cartera determinada) en una Fecha de valoración determinada supera el umbral establecido ocasionalmente por la Sociedad Gestora para dicha Cartera, el Valor liquidativo de la Cartera podrá ajustarse al alza o a la baja para reflejar las entradas netas y las salidas netas, respectivamente.

Notas a los estados financieros

(continuación)

15 AJUSTE DE DILUCIÓN

(continuación)

El Valor liquidativo por Acción de cada Clase de Acciones de la Cartera se calcula por separado, pero cualquier Ajuste de dilución tendrá un efecto idéntico en el Valor liquidativo por Acción de cada Clase de Acciones de la Cartera. La Sociedad Gestora establecerá el importe del Ajuste de dilución para reflejar los diferenciales de negociación, los costes operativos y los impuestos estimados en los que pueda incurrir la Cartera; estos costes pueden variar en función de las condiciones del mercado y la composición de la cartera. Por lo tanto, el Ajuste de dilución puede modificarse ocasionalmente. Dichos Ajustes de dilución podrán variar de Cartera a Cartera y entre las entradas y salidas de capital diarias netas, pero no superarán el 2% del Valor liquidativo por Acción original, excepto en el caso de la Cartera Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*, para la cual el Ajuste de dilución no superará el 5% del Valor liquidativo por Acción original. Se realiza una revisión periódica para verificar la idoneidad de los Ajustes de dilución que se están aplicando. En el curso habitual de las actividades, la aplicación del Ajuste de dilución se activará de forma mecánica y coherente. Sin embargo, la Sociedad Gestora se reserva el derecho de realizar un Ajuste de dilución discrecional si, en su opinión, dicha acción redundante en el interés de los Accionistas existentes, incluso en circunstancias excepcionales. Estas circunstancias excepcionales incluyen, entre otros, periodos de elevada volatilidad del mercado y periodos de baja liquidez del mercado.

Se podrá aplicar un Ajuste de dilución en todas las Carteras con la excepción de la Cartera Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities.

En el sitio web www.columbiathreadneedle.com se publican las estimaciones del importe del Ajuste de dilución basado en los valores de cada Cartera y las condiciones de mercado en el momento de la emisión del Folleto, en noviembre de 2021.

A 31 de marzo de 2022, se ha aplicado el siguiente Ajuste de dilución:

Cartera	VL antes de la dilución	Ajuste de dilución	VL después de la dilución
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	475.145.184	(332.602)	474.812.582

* Consulte la nota 1.

16 COSTES OPERATIVOS

Para el ejercicio del informe, la SICAV incurrió en costes operativos relacionados con la compra o venta de valores mobiliarios o instrumentos del mercado monetario de la siguiente manera:

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond ¹	USD	n/d
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond ¹	EUR	n/d
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	EUR	7.224
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond ¹	EUR	n/d
Threadneedle (Lux) - European Social Bond ¹	EUR	n/d
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond ¹	EUR	n/d
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds ¹	USD	n/d
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt ¹	USD	n/d
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds ¹	USD	n/d
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond ¹	USD	n/d
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond ¹	USD	n/d
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	EUR	705
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	USD	13.836
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	USD	40.891
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	USD	9.744
Threadneedle (Lux) - Global Focus	USD	1.466.730
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	USD	168.383
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	USD	209.049
Threadneedle (Lux) - Global Select	USD	237.619
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	EUR	1.817.331
Threadneedle (Lux) - American	USD	212.331
Threadneedle (Lux) - American Select	USD	140.540
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	USD	150.428
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	USD	355.408
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	USD	804.959
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	USD	129.628
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	USD	14.361
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	EUR	694.762
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	EUR	102.396
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	EUR	376.652
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	EUR	1.153.129
Threadneedle (Lux) - European Select	EUR	1.111.256
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	EUR	434.055
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	USD	76.799
Threadneedle (Lux) - Global Technology	USD	162.082
Threadneedle (Lux) - UK Equities	GBP	667.317
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	GBP	279.775
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity ²	USD	60.597
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	USD	6.617
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities ¹	EUR	n/d

Notas a los estados financieros

(continuación)

16 COSTES OPERATIVOS

(continuación)

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities ¹	EUR	n/d
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	EUR	510.300
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	USD	34.905
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	USD	70.056
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	USD	2.790

Los costes operativos se incluyen en el coste total de inversión indicado en los Estados de la Cartera. El importe de los costes operativos soportados por la SICAV durante el ejercicio del informe se incluye en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto bajo el epígrafe «Ganancia/(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones» y «Cambio en la ganancia/(pérdida) neta no realizada en inversiones».

¹ Para los valores de renta fija, los costes operativos no son identificables por separado del precio de compra del valor y, por lo tanto, no se podrán indicar por separado.

² Consulte la nota 1.

17 INFORMACIÓN SOBRE GARANTÍAS

La siguiente tabla muestra los saldos de garantía en efectivo recibidos y pagados por las Carteras a 31 de marzo de 2022:

Carteras	Contraparte	Tipo de inversión	Divisa	Garantía en efectivo
Garantía pagada por la Cartera				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	USD	110.000
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	Barclays	Contratos a plazo	EUR	160.000
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	Lloyds	Contratos a plazo	EUR	10.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	EUR	20.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	JPM Chase	Contratos a plazo y swaps	EUR	210.000
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	80.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	EUR	200.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Lloyds	Contratos a plazo	EUR	570.000
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	Barclays	Contratos a plazo	USD	260.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	USD	10.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Lloyds	Contratos a plazo	USD	10.000
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	20.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	490.000
Threadneedle (Lux) - European Select	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	210.000
Threadneedle (Lux) - UK Equities	JPM Chase	Contratos a plazo	GBP	30.000
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	JPM Chase	Contratos a plazo	GBP	110.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Bank of America Merrill Lynch	Swaps	USD	140.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	UBS	Swaps	USD	310.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	JPM Chase	Contratos a plazo y swaps	EUR	80.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Goldman Sachs	Contratos a plazo y swaps	EUR	320.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Citigroup Global Markets	Swaps	EUR	550.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	BNP Paribas	Swaps	EUR	820.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	JPM Chase	Contratos a plazo y swaps	EUR	100.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Citigroup Global Markets	Contratos a plazo y swaps	EUR	130.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	EUR	250.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Goldman Sachs	Swaps	EUR	90.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	UBS	Swaps	USD	870.000
Garantía recibida por la Cartera				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Goldman Sachs	Contratos a plazo y swaps	USD	380.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Barclays	Contratos a plazo y swaps	USD	3.268.880
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPM Chase	Contratos a plazo y swaps	USD	5.030.000
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	EUR	50.000
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	Barclays	Contratos a plazo	EUR	1.250.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	Barclays	Contratos a plazo	EUR	470.000
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	HSBC	Contratos a plazo	EUR	340.000
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	400.000
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	430.000
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	630.000
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	150.000
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	110.000

Notas a los estados financieros

(continuación)

17 INFORMACIÓN SOBRE GARANTÍAS

(continuación)

Carteras	Contraparte	Tipo de inversión	Divisa	Garantía en efectivo
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Barclays	Contratos a plazo y swaps	USD	110.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPM Chase	Contratos a plazo y swaps	USD	1.080.000
Threadneedle (Lux) - Global Focus	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	2.450.000
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	80.000
Threadneedle (Lux) - American	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	2.490.000
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	130.000
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	840.000
Threadneedle (Lux) - Global Technology	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	740.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	240.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Bank of America Merrill Lynch	Swaps	EUR	120.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Barclays	Contratos a plazo y swaps	EUR	700.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	EUR	2.650.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Goldman Sachs	Swaps	EUR	70.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	UBS	Swaps	EUR	20.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Bank of America Merrill Lynch	Swaps	USD	99.000
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	UBS	Swaps	USD	1.920.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Credit Suisse	Swaps	USD	2.070.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Citigroup Global Markets	Swaps	USD	2.191.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Macquarie	Swaps	USD	7.050.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Goldman Sachs	Swaps	USD	8.050.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	JPM Chase	Contratos a plazo y swaps	USD	8.500.000

18 INVERSIÓN CRUZADA EN CARTERAS

A 31 de marzo de 2022, la Cartera Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return invierte en acciones de las siguientes Carteras:

Cartera de inversión cruzada	Divisa	Valor de mercado	% del patrimonio neto en la divisa base de la cartera de inversión cruzada
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	EUR	2.648.205	0,54
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	EUR	2.469.877	1,93
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	EUR	714.888	0,87
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	EUR	3.233.732	7,25
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	EUR	1.357.249	0,31
Threadneedle (Lux) - Global Focus	EUR	3.141.191	0,15
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	EUR	1.082.041	0,09
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	EUR	3.471.871	3,21

A 31 de marzo de 2022, la Cartera Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return invierte en acciones de las siguientes Carteras:

Cartera de inversión cruzada	Divisa	Valor de mercado	% del patrimonio neto en la divisa base de la cartera de inversión cruzada
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	USD	3.650.129	0,67
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	USD	68.290	0,07
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	USD	62.775	0,05

A 31 de marzo de 2022, la Cartera Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income invierte en acciones de las siguientes Carteras:

Cartera	Divisa	Valor de mercado	% del patrimonio neto en la divisa base de la cartera de inversión cruzada
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	USD	286.675	0,55
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	USD	214.969	0,24

El impacto de las transacciones de inversión cruzada se ha eliminado del Estado consolidado del patrimonio neto y del Estado de variaciones en el patrimonio neto.

Consulte también la nota 2 xi) sobre los reembolsos de comisiones de gestión de activos.

Notas a los estados financieros

(continuación)

19 DEPÓSITOS A PLAZO

La siguiente tabla muestra los depósitos a plazo que mantiene la SICAV a 31 de marzo de 2022:

Carteras	Contraparte	Divisa	Depósitos a plazo (en la divisa base de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	BNP Paribas Paris	EUR	641.677
	Total	EUR	641.677
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Sumitomo Bank Ltd London	EUR	22.045.718
	Total	EUR	22.045.718
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	ANZ Banking Group Ltd	USD	3.000.597
	Mitsubishi UFJ Securities	USD	3.001.034
	Total	USD	6.001.631

20 OTROS PASIVOS

Otros pasivos incluyen cualquier ajuste del valor razonable aplicado cuando ciertos mercados se cerraron al cierre del ejercicio para evitar la sincronización del mercado, sobre la base del procedimiento de fijación de precios en el fondo en vigor.

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

El Índice de Gastos Totales se calcula siguiendo la guía de la Swiss Funds & Asset Management Association (SFAMA).

La fórmula aplicada es la siguiente:

El IGT expresa la suma de todos los costes y comisiones cobrados de forma continua a cada clase de acciones (Gastos operativos) tomadas retrospectivamente como un porcentaje de su patrimonio neto, y se calcula utilizando la siguiente fórmula:

$$\% \text{ de IGT} = \frac{\text{Total de gastos operativos}}{\text{Patrimonio neto medio}} \times 100$$

Cuando un fondo invierte más del 10% en otras instituciones de inversión colectiva (fondos objetivo), el cálculo incluye la parte del fondo en los gastos de los fondos objetivo menos los reembolsos recibidos.

Los Índices de Gastos Totales durante el ejercicio cerrado a 31 de marzo de 2022 son los siguientes:

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	AEC	0,85%	
	AEH	0,85%	
	AKH	0,94%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ANH	0,95%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AU	0,85%	
	AUP	0,85%	
	DEC	1,60%	
	DEH	1,60%	
	DU	1,60%	
	DUP	1,60%	
	IEC	0,65%	
	IEH	0,65%	
	IEP	0,65%	
	IGC	0,65%	
	IGH	0,65%	
	IKH	0,65%	
	INH	0,59%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IU	0,65%	
	IUP	0,65%	
	NEC	0,45%	
	NEH	0,45%	
	NGC	0,45%	
	NGH	0,45%	
	NU	0,45%	
	NUP	0,45%	
	XEH	0,07%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	XFH	0,06%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
XGH	0,15%		
XU	0,06%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
ZEH	0,60%		
ZFH	0,67%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
ZGH	0,60%		
ZU	0,60%		
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	AE	1,20%	
	ANH	1,27%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,60%	
	IEP	0,60%	
	INH	0,55%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
XE	0,06%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond (continuación)	XFH	0,06%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	XGH	0,06%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	XUH	0,06%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZE	0,78%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZFH	0,76%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	1E	1,19%	
	1G	1,19%	
	2E	0,58%	
	2G	0,58%	
	3G	0,69%	
	4E	0,08%	
	4G	0,08%	
	8E	0,62%	
	8G	0,62%	
9G	0,65%		
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	AE	1,55%	
	AKH	1,69%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ANH	1,66%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,85%	
	IEP	0,85%	
	IKH	0,85%	
	INH	0,85%	
	XE	0,15%	
	ZE	0,90%	
	ZEP	0,90%	
	1E	1,38%	
	1EP	1,38%	
	1G	1,38%	
	1GP	1,38%	
	1UT	1,38%	
	2E	0,82%	
	2EP	0,82%	
	2FH	0,82%	
	2G	0,82%	
	2GP	0,82%	
	3E	0,77%	
	3EP	0,77%	
	3FC	0,77%	
	3FH	0,77%	
	3G	0,77%	
	3GP	0,77%	
	4E	0,07%	
4G	0,07%		
8E	0,86%		
8EP	0,86%		
8FH	0,86%		
8G	0,86%		
8GP	0,86%		
9E	0,73%		
9EP	0,73%		
9FC	0,73%		

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond (continuación)	9FH	0,73%	
	9G	0,60%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9GP	0,62%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	AE	0,90%	
	AEP	0,90%	
	AKH	0,84%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ANH	0,82%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,50%	
	IEP	0,50%	
	IGC	0,44%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IGH	0,44%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IKH	0,50%	
	INH	0,50%	
	XE	0,10%	
	XGC	0,10%	
	XGH	0,10%	
	ZE	0,55%	
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	AE	0,55%
AEP		0,55%	
AFH		0,47%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
AKH		0,49%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
ANH		0,47%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
ASC		0,55%	
ASH		0,55%	
AUC		0,50%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
AUH		0,50%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
ID		0,40%	
IE		0,40%	
IEP		0,40%	
IFH		0,40%	
IGH		0,40%	
IKH		0,40%	
INH		0,40%	
ISC		0,57%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
ISH		0,56%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
IUC		0,40%	
IUH		0,40%	
LE		0,40%	
NEP	0,40%		
ZD	0,45%		
ZE	0,45%		

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios	
Threadneedle (Lux) - European Social Bond (continuación)	ZEP	0,45%		
	ZFH	0,45%		
	ZGC	0,45%		
	ZGH	0,45%		
	ZUH	0,45%		
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	AE	1,15%		
	AEP	1,15%		
	AKH	1,27%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
	ANH	1,25%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
	AUH	1,15%		
	DE	1,70%		
	DEP	1,70%		
	DUH	1,70%		
	IE	0,55%		
	INH	0,47%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
	ZE	0,81%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase y a su reciente lanzamiento.	
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	AEC	1,65%	
		AEH	1,65%	
AKH		1,65%		
ANH		1,71%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
ASH		1,65%		
AU		1,65%		
AUP		1,65%		
DEC		1,75%		
DEH		1,75%		
DU		1,75%		
IEC		0,85%		
IEH		0,85%		
IU		0,85%		
W		1,30%		
WEH		1,30%		
XUP		0,06%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
ZU		0,97%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase y a su reciente lanzamiento.	
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	AEC	1,65%		
	AEH	1,65%		
	AKH	1,70%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
	ANH	1,65%		
	ASH	1,65%		
	AU	1,65%		
	AUP	1,65%		
	DEH	1,75%		
	DU	1,75%		
	IEH	0,85%		
	IU	0,96%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
	SU	1,80%		

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt (continuación)	SUP	1,80%	
	W	1,30%	
	XUP	0,06%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	0,90%	
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	AEC	1,60%	
	AEH	1,60%	
	AKH	1,60%	
	ANH	1,60%	
	ASC	1,60%	
	ASH	1,60%	
	AU	1,60%	
	AUP	1,60%	
	DEH	1,75%	
	DU	1,75%	
	IE	0,85%	
	IEH	0,85%	
	XU	0,15%	
	XUP	0,15%	
	ZEH	0,90%	
	ZU	0,97%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase y a su reciente lanzamiento.
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	AEC	1,55%	
	AEH	1,55%	
	AKH	1,55%	
	ANH	1,55%	
	ASH	1,55%	
	AU	1,55%	
	AUP	1,55%	
	DEC	1,75%	
	DEH	1,75%	
	DU	1,75%	
	IEC	0,59%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IEH	0,65%	
	IKH	0,59%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	INH	0,59%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ISC	0,65%	
	IU	0,65%	
	TEH	0,65%	
	XUP	0,06%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZFH	0,97%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZGH	0,95%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	0,90%	
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	AEH	1,15%	
	AKH	1,15%	
	AS	1,15%	
	ASC	1,15%	
	ASH	1,15%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond (continuación)	AU	1,15%	
	AUP	1,15%	
	AVC	1,26%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AVH	1,23%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	DEH	1,45%	
	IEH	0,55%	
	IGH	0,55%	
	ISH	0,50%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IU	0,55%	
	XU	0,15%	
	ZU	0,65%	
	ZUP	0,65%	
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	AE	1,63%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	AEP	1,72%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	DE	2,38%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	IE	0,93%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	IEP	0,93%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	LE	0,78%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	LEP	0,73%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	ZE	1,13%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	ZEP	1,18%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	AEC	1,65%	
	AEH	1,65%	
	AKH	1,65%	
	AU	1,65%	
	AUP	1,65%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IEH	1,01%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IGH	0,95%	
	IU	0,95%	
	W	1,75%	
	ZU	1,09%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase y a su reciente lanzamiento.

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	AE	1,55%	
	AEC	1,55%	
	AEH	1,55%	
	AEP	1,55%	
	AS	1,66%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ASC	1,55%	
	ASH	1,55%	
	ASP	1,55%	
	AU	1,55%	
	AUM	1,55%	
	AUP	1,55%	
	DEC	2,30%	
	DEH	2,30%	
	DEP	2,30%	
	DU	2,30%	
	DUP	2,30%	
	ZE	1,05%	
	ZEC	1,05%	
	ZEH	1,05%	
	ZFH	1,05%	
	ZU	1,05%	
	ZUP	1,05%	
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	AE	1,80%	
	AEC	1,80%	
	AEH	1,80%	
	AU	1,80%	
	AUP	1,80%	
	IE	0,86%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IEH	0,86%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IG	0,85%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IU	0,80%	
	LE	0,50%	
	LG	0,56%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	XU	0,15%	
	ZE	1,05%	
	ZEC	1,05%	
	ZEH	1,05%	
	ZU	1,05%	
	ZUP	1,05%	
Threadneedle (Lux) - Global Focus	AEH	1,80%	
	AEP	1,80%	
	AU	1,80%	
	AUP	1,80%	
	DEH	2,55%	
	DU	2,55%	
	IE	0,95%	
	IEH	0,95%	
	IU	0,95%	
	IUP	0,95%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Focus (continuación)	W	1,75%	
	XU	0,15%	
	ZE	1,05%	
	ZEH	1,05%	
	ZEP	1,05%	
	ZFH	1,05%	
	ZG	1,05%	
	ZU	1,05%	
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	AEH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,55%	
	DU	2,55%	
	IE	0,95%	
	IEH	0,95%	
	IU	0,95%	
	XU	0,05%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase y a su reciente lanzamiento.
	ZU	1,05%	
	1E	1,71%	
	1U	1,71%	
	2E	1,10%	
	2U	1,10%	
	8E	1,14%	
8U	1,14%		
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	AEC	1,80%	
	AUP	1,80%	
	DEC	2,30%	
	DUP	2,21%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	IU	0,95%	
	TE	1,19%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	1,05%	
	1E	1,68%	
	1EP	1,68%	
	1SC	1,68%	
	1SH	1,68%	
	1ST	1,68%	
	1U	1,68%	
	1UP	1,68%	
	1VT	1,68%	
	2E	1,07%	
	2EP	1,07%	
	2U	1,07%	
	2UP	1,07%	
	3E	0,93%	
	3EP	0,93%	
	3U	0,93%	
	3UP	0,93%	
	8E	1,11%	
	8EP	1,11%	
	8U	1,11%	
	8UP	1,11%	
	9E	0,89%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income (continuación)	9EP	0,89%	
	9U	0,89%	
	9UP	0,81%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - Global Select	IU	0,95%	
	ZU	1,05%	
	1E	1,68%	
	1U	1,68%	
	2E	1,07%	
	2U	1,07%	
	3U	0,90%	
	8E	1,11%	
	8U	1,11%	
	9U	0,86%	
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	AE	1,80%	
	AEP	1,80%	
	AK	1,80%	
	AUP	1,80%	
	DE	2,30%	
	IE	0,95%	
	IEP	0,95%	
	NE	0,75%	
	XE	0,15%	
	XFH	0,06%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	XG	0,15%	
	XGH	0,15%	
	XU	0,15%	
	ZE	1,05%	
	ZFH	1,05%	
	ZG	1,05%	
	ZGH	1,05%	
	ZU	1,05%	
Threadneedle (Lux) - American	AEH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,15%	
	DU	2,15%	
	IEH	0,90%	
	IU	0,90%	
	W	1,50%	
	ZE	1,00%	
	ZEH	1,00%	
	ZU	1,00%	
	1E	1,67%	
	1EH	1,67%	
	1EP	1,67%	
	1U	1,67%	
	2E	1,06%	
	2U	1,06%	
	3EH	0,88%	
	3U	0,88%	
	8E	1,10%	
	8U	1,10%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - American (continuación)	9EH	0,84%	
	9U	0,84%	
Threadneedle (Lux) - American Select	AD	1,80%	
	AEH	1,80%	
	AN	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,55%	
	DU	2,55%	
	ID	1,00%	
	IE	1,00%	
	IEH	1,00%	
	IN	1,00%	
	W	1,75%	
	ZEH	1,10%	
	ZU	1,10%	
	1E	1,67%	
	1EH	1,67%	
	1EP	1,67%	
	1U	1,67%	
	2EH	1,06%	
	2U	1,06%	
	3E	0,87%	
3U	0,87%		
8EH	1,10%		
8U	1,10%		
9E	0,83%		
9U	0,83%		
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	AEH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IE	0,95%	
	IU	0,95%	
	ZU	1,05%	
	1E	1,68%	
	1EP	1,68%	
	1U	1,68%	
	2U	1,07%	
	3EH	0,93%	
	3U	0,93%	
8U	1,11%		
9EH	0,89%		
9U	0,89%		
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	AE	1,80%	
	AF	1,89%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AS	1,80%	
	ASH	1,80%	
	AU	1,69%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	DE	2,55%	
	IF	0,95%	
	ISH	0,95%	
IU	0,95%		

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity (continuación)	XU	0,15%	
	XUP	0,15%	
	ZE	1,05%	
	ZEH	1,25%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	ZF	1,05%	
	ZG	1,05%	
	ZU	1,05%	
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	AE	1,87%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AEH	1,87%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	DE	2,35%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	DEH	2,38%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,95%	
	IU	0,95%	
	ZU	1,05%	
	1E	1,70%	
	1U	1,70%	
	2E	1,09%	
	2U	1,09%	
	3U	0,95%	
	8E	1,13%	
	8U	1,13%	
	9U	0,91%	
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	AEC	1,85%	
	AEH	1,85%	
	AU	1,85%	
	AUP	1,85%	
	DU	2,35%	
	IU	1,05%	
	XS	0,15%	
	XSH	0,15%	
	ZEH	1,10%	
	ZFH	1,10%	
	ZGH	1,10%	
	ZU	1,10%	
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	AE	0,70%	
	AEH	0,70%	
	AU	0,70%	
	AUP	0,70%	
	DE	0,90%	
	DEH	0,84%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	DU	0,90%	
	IE	0,35%	
	IEC	0,35%	
	IEH	0,35%	
	IFH	0,35%	
	IG	0,35%	
	IU	0,35%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities (continuación)	NE	0,10%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	NG	0,20%	
	NU	0,20%	
	XG	0,10%	
	ZEH	0,45%	
	ZFH	0,45%	
	ZU	0,45%	
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	AE	1,55%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ASH	1,55%	
	AUH	1,55%	
	DE	1,75%	
	IE	0,80%	
	W	1,75%	
	XE	0,15%	
	ZE	1,00%	
	ZUH	1,00%	
	1E	1,53%	
	1EP	1,59%	
	1G	1,53%	
	1GP	1,59%	
	2E	1,08%	
	2G	1,08%	
	2U	1,02%	
	3E	0,94%	
	3G	0,94%	
	3GP	0,94%	
	4E	0,08%	
	4G	0,08%	
8E	1,12%		
8G	1,12%		
8U	1,03%		
9E	0,90%		
9G	0,90%		
9GP	0,90%		
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	AE	1,80%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AEP	1,80%	
	AUP	1,86%	
	DE	2,15%	
	DEP	2,15%	
	IE	0,82%	
	IEP	0,65%	
	ZE	1,05%	
	ZEP	1,05%	
	1E	1,70%	
	1EP	1,70%	
	1G	1,70%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend (continuación)	1GP	1,70%	
	2E	1,09%	
	2EP	0,99%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	2G	1,02%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	2GP	1,02%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	3EP	0,95%	
	3G	0,95%	
	3GP	0,95%	
	4GP	0,09%	
	8E	1,13%	
	8EP	1,13%	
	8G	1,13%	
	8GP	1,13%	
	9EP	0,91%	
	9G	0,91%	
	9GP	0,91%	
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	AE	1,85%
ASH		1,85%	
AUH		1,85%	
DE		2,75%	
DUH		2,75%	
IE		1,10%	
W		1,90%	
XE		0,06%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase y a su reciente lanzamiento.
ZE		1,10%	
ZFH		1,10%	
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	IE	0,95%	
	ZE	1,10%	
	1E	1,72%	
	1EP	1,72%	
	1FH	1,72%	
	1G	1,72%	
	1UH	1,72%	
	2E	1,07%	
	2G	1,07%	
	3E	0,91%	
	3EP	0,91%	
	3FH	0,91%	
	3G	0,91%	
	3GP	0,91%	
	3UH	0,91%	
	4E	0,07%	
	4G	0,07%	
	8E	1,11%	
	8G	1,11%	
	9E	0,87%	
9EP	0,87%		
9FH	0,87%		
9G	0,87%		

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies (continuación)	9GP	0,87%	
	9UH	0,87%	
Threadneedle (Lux) - European Select	AE	1,80%	
	AGH	1,80%	
	AUH	1,80%	
	DUH	2,35%	
	IE	0,95%	
	ZE	1,18%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase y a su reciente lanzamiento.
	ZG	1,05%	
	ZGH	1,05%	
	1E	1,65%	
	1EP	1,65%	
	1SH	1,65%	
	1U	1,65%	
	1UH	1,65%	
	2E	1,06%	
	2EP	1,06%	
	3E	0,88%	
	3U	0,88%	
	8E	1,10%	
	8EP	1,10%	
	9E	0,84%	
	9U	0,84%	
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	IE	0,95%	
	ZE	1,10%	
	1E	1,72%	
	1EP	1,72%	
	1FH	1,72%	
	2E	1,07%	
	3E	0,93%	
	3EP	0,93%	
	3FH	0,93%	
	8E	1,11%	
	9E	0,89%	
	9EP	0,89%	
	9FH	0,89%	
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	AEH	1,80%	
	AU	1,80%	
	AUP	1,80%	
	DEH	2,55%	
	DU	2,55%	
	DUP	2,55%	
	IEP	0,95%	
	IU	0,95%	
	W	2,00%	
	XU	0,15%	
	XUP	0,15%	
	ZG	1,10%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZGH	1,05%	
	ZGP	1,10%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	1,05%	
	ZUP	1,05%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Technology	AEH	1,95%	
	AS	1,95%	
	AU	1,95%	
	AUP	1,95%	
	BU	2,35%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IE	1,05%	
	IEH	1,05%	
	IG	1,05%	
	IU	1,05%	
	ZEH	1,15%	
	ZFH	1,15%	
	ZG	1,06%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	ZU	1,15%	
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	AE	1,80%
AEH		1,80%	
AFH		1,80%	
AG		1,80%	
AGP		1,80%	
DEH		2,60%	
DG		2,60%	
IE		0,85%	
IEH		0,85%	
IG		0,85%	
IGP		0,85%	
NEH		0,62%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
NFH		0,63%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
NG		0,68%	
NGP		0,59%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
NUH		0,68%	
TEH		0,65%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
TFH		0,67%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
TG		0,63%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
TGP		0,62%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
TUH		0,72%	
ZE		1,05%	
ZEH		1,05%	
ZFH		1,05%	
ZG		1,05%	
ZGP		1,05%	
ZUH		1,05%	
3EH	0,87%		
3FH	0,87%		
3UH	0,87%		
9EH	0,83%		
9EP	0,83%		
9FH	0,83%		
9G	0,83%		
9UH	0,83%		

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	AE	1,80%	
	AEC	1,80%	
	AEH	1,80%	
	AG	1,80%	
	ASC	1,88%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AUC	1,80%	
	DE	2,55%	
	DEC	2,42%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	DEH	2,55%	
	DG	2,55%	
	DGP	2,60%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,85%	
	IEH	0,85%	
	IG	0,85%	
	IGP	0,85%	
	IU	0,85%	
	IUH	0,72%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	LG	0,70%	
	LGP	0,70%	
	ZE	1,05%	
	ZEH	1,05%	
	ZFH	1,05%	
	ZG	1,05%	
	ZGP	1,05%	
	ZUH	1,05%	
	1EH	1,64%	
	1FH	1,64%	
1UH	1,64%		
3EH	0,88%		
3FH	0,88%		
3UH	0,88%		
9EH	0,84%		
9FH	0,91%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
9G	0,84%		
9UH	0,84%		
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*	IU	0,96%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la interrupción de las comisiones de gestión de activos aplicadas a esta clase de acciones el 18 de junio de 2021 y a la significativa variación del VL medio.
	ZU	0,96%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la interrupción de las comisiones de gestión de activos aplicadas a esta clase de acciones el 18 de junio de 2021 y a la significativa variación del VL medio.
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	AEH	1,80%	
	AFH	1,80%	
	AGH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IEH	0,95%	
	IGH	0,95%/1,24%	
	IU	0,95%/1,26%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha (continuación)	XGH	0,15%	
	ZE	1,05%	
	ZEH	1,05%	
	ZGH	1,05%	
	ZU	1,05%/1,38%	
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	AE	1,00%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,49%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZE	0,70%	
	1E	1,17%	
	1EP	1,17%	
	1GH	1,17%	
	1UH	1,17%	
	2E	0,56%	
	2EP	0,56%	
	2GC	0,56%	
	2GH	0,56%	
	4GH	0,06%	
	8E	0,60%	
	8EP	0,60%	
8GC	0,60%		
8GH	0,60%		
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	AE	1,20%	
	AFH	1,20%	
	AKH	1,20%	
	ANH	1,26%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AUH	1,20%	
	DE	1,75%	
	IE	0,55%	
	IEP	0,55%	
	IGH	0,55%	
	INH	0,55%	
	IU	0,55%	
	IUH	0,55%	
	JE	0,45%	
	JGH	0,45%/0,40%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	JUH	0,45%	
	LE	0,40%	
	LEP	0,30%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	LGH	0,28%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	XE	0,15%	
	XGH	0,15%	
	XUH	0,15%	
	YE	0,71%/0,69%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
YGH	0,68%/0,60%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
YUH	0,74%/0,72%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
ZE	0,77%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
ZFH	0,70%		
ZGH	0,70%		
ZUH	0,76%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	AE	1,85%/2,08%	
	AEP	1,85%/2,03%	
	AUH	1,85%/2,46%	
	DE	2,35%/2,64%	
	IE	0,95%/1,72%	
	IGH	0,95%/1,81%	
	LE	0,575%/1,62%	
	XGH	0,15%	
	ZE	1,05%/1,50%	
	ZF	1,11%/0,96%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
ZFH	1,05%/1,90%		
ZGH	1,05%/1,64%		
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	AEH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IU	0,90%	
	ZU	1,05%	
	1E	1,69%	
	1EH	1,69%	
	1U	1,69%	
	2E	0,83%	
	2U	0,83%	
	3U	0,94%	
	8E	0,87%	
8U	0,87%		
9U	0,85%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	AEH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IU	0,90%	
	ZU	1,05%	
	1E	1,69%	
	1U	1,69%	
	2E	0,83%	
	2U	0,83%	
8E	0,87%		
8U	0,87%		
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	AEH	1,75%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la reducción de las comisiones aplicadas a esta clase de acciones el 1 de diciembre de 2021.
	AFH	1,74%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la reducción de las comisiones aplicadas a esta clase de acciones el 1 de diciembre de 2021.
	AGH	1,77%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la reducción de las comisiones aplicadas a esta clase de acciones el 1 de diciembre de 2021.
	ASH	1,67%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la reducción de las comisiones aplicadas a esta clase de acciones el 1 de diciembre de 2021.
	AU	1,65%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la reducción de las comisiones aplicadas a esta clase de acciones el 1 de diciembre de 2021.
	DEH	2,19%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la reducción de las comisiones aplicadas a esta clase de acciones el 1 de diciembre de 2021.
	DU	2,09%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la reducción de las comisiones aplicadas a esta clase de acciones el 1 de diciembre de 2021.
	IEH	0,95%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities (continuación)	IG	0,95%	
	IGH	0,95%	
	IU	1,00%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la reducción de las comisiones aplicadas a esta clase de acciones el 1 de diciembre de 2021.
	NG	0,68%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la reducción de las comisiones aplicadas a esta clase de acciones el 1 de diciembre de 2021 y a la significativa variación del VL medio.
	XU	0,15%	
	ZEH	1,05%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	ZFH	1,05%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	ZGH	1,00%	
	ZU	1,00%	

¹ El IGT incluye la comisión de rentabilidad.

* Consulte la nota 1.

22 INFORMACIÓN ADICIONAL

La pandemia provocada por la enfermedad del coronavirus 2019 y sus variantes (COVID-19) ha ocasionado —y posiblemente continúe ocasionando— importantes perturbaciones económicas y sociales a nivel mundial, así como la volatilidad del mercado debido a interrupciones en el acceso a este, la disponibilidad de recursos, la gestión operativa de instalaciones, la imposición de aranceles, los controles a la exportación y la interrupción en la cadena de suministro, entre otros factores. La imposición de cuarentenas y restricciones en los viajes y desplazamientos, las reestructuraciones laborales y la pérdida de recursos humanos y de otra índole pueden provocar y agravar estas interrupciones. Las repercusiones, así como la inquietud en torno a las repercusiones futuras de la COVID-19 —y de cualquier otro brote, epidemia y pandemia de enfermedades infecciosas que puedan surgir en adelante—, podrían perjudicar a las economías y los mercados mundiales de formas imprevisibles. Además, el impacto de los brotes y epidemias de enfermedades infecciosas en los países de mercados emergentes puede ser de mayor envergadura, dado que sus sistemas sanitarios, sus gobiernos y sus mercados financieros presentan, por lo general, un menor arraigo. Las crisis sanitarias debidas al brote de COVID-19 pueden agravar otros riesgos políticos, sociales y económicos preexistentes en determinados países o a nivel mundial. Las perturbaciones causadas por la COVID-19 podrían impedir que las Carteras tomen decisiones de inversión favorables de forma oportuna y podrían repercutir negativamente en la capacidad de las Carteras para alcanzar sus objetivos de inversión. Cualquiera de estos supuestos podría tener un efecto adverso significativo en el valor y en el perfil de riesgo de las Carteras.

La invasión a gran escala de Ucrania por parte de Rusia en febrero de 2022 ha dado lugar a sanciones y perturbaciones en el mercado, entre las que se incluyen la volatilidad de los mercados bursátiles y de materias primas regionales y mundiales e importantes devaluaciones de la divisa rusa. El alcance y la duración de la acción militar son imposibles de predecir, pero podrían ser considerables. La perturbación del mercado causada por la acción militar rusa y cualquier contramedida o respuesta a ella (incluidas las sanciones internacionales, una rebaja de la calificación crediticia del país, restricciones de compra y financiación, boicots, aranceles, cambios en las preferencias de los consumidores o compradores, ciberataques y espionaje) podrían tener un impacto adverso grave en los mercados regionales y/o mundiales de valores y materias primas, incluidos los mercados de petróleo y gas natural. Estos y otros acontecimientos relacionados podrían tener un impacto negativo en el rendimiento de la Cartera y en el valor de una inversión en las Carteras.

Exposición al riesgo global (sin auditar)

Exposición y apalancamiento global

La exposición global de los OICVM se gestiona mediante un enfoque de compromiso, un enfoque de valor en riesgo absoluto (VaR absoluto) o un enfoque de valor en riesgo relativo (VaR relativo).

La información de exposición al riesgo de mercado global durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2022 es la siguiente:

Enfoque de compromiso

Con el fin de controlar y medir la exposición global, todas las carteras que no están incluidas en el enfoque de VaR utilizan el enfoque de compromiso.

La exposición global de los subfondos se calcula según el enfoque de compromiso con arreglo a la metodología descrita en las directrices 10-788 de la AEVM. Utilizando el periodo de abril de 2021 a marzo de 2022:

Subfondos utilizando la base VaR	Método de cálculo*	Modelo VaR*	Cartera de referencia	Directrices internas de VaR (%)	Límite legal y contractual de VaR (%)	1 año consecutivo			Exposición promedio de compromiso	Suma promedio de nociones
						Utilización más baja del límite de VaR	Utilización más alta del límite de VaR	Utilización promedio del límite de VaR		
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	VaR relativo	Covarianza	Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (USD Hedged)	1,5 x bmk VaR	2,0 x bmk VaR	99,62%	109,03%	103,11%	51,17%	109,90%
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	VaR relativo	Covarianza	ICE BofA Custom Index 0-4 Year European Currency High Yield, BB-B, 3% Constrained, Excluding Subordinated Debt (EUR Hedged)	1,5 x bmk VaR	2,0 x bmk VaR	76,75%	113,00%	97,47%	1,38%	27,66%
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	VaR relativo	Covarianza	ICE BofA 1-7 Year All Euro Government Index (20%), ICE BofA 1-10 Year Euro Corporate Index (40%), ICE BofA European Currency High Yield Constrained Index (40%)	1,8 x bmk VaR	2,0 x bmk VaR	81,30%	101,42%	94,46%	82,34%	119,90%
Threadneedle (Lux) Flexible Asian Bond	VaR relativo	Covarianza	J.P. Morgan Asia Credit Index Diversified	1,8 x bmk VaR	2,0 x bmk VaR	88,68%	114,17%	98,27%	9,29%	13,91%
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	VaR relativo	Covarianza	MSCI ACWI Index (45%), ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained Index (USD Hedged) (30%), Bloomberg Global Aggregate Index (USD Hedged) (20%), 30-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR) (5%)	1,8 x bmk VaR	2,0 x bmk VaR	43,13%	118,24%	102,05%	21,82%	81,09%
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	VaR absoluto	Covarianza	N/D	8	20	2,46%	5,32%	3,47%	39,08%	82,11%

Exposición al riesgo global (sin auditar)*(continuación)*

Subfondos utilizando la base VaR	Método de cálculo*	Modelo VaR*	Cartera de referencia	Directrices internas de VaR (%)	Límite legal y contractual de VaR (%)	1 año consecutivo			Exposición promedio de compromiso	Suma promedio de nocio- nales
						Utilización más baja del límite de VaR	Utilización más alta del límite de VaR	Utilización promedio del límite de VaR		
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	VaR absoluto	Covarianza	N/D	10	20	4,63%	9,41%	6,63%	56,88%	56,88%
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	VaR absoluto	Covarianza	N/D	3,3	20	0,74%	1,17%	0,87%	197,46%	253,61%
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	VaR absoluto	Covarianza	N/D	4,7	20	0,82%	1,32%	1,01%	138,09%	181,26%
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	VaR relativo	Covarianza	MSCI ACWI Index	1,6 x bmk VaR	2,0 x bmk VaR	94,39%	122,42%	107,06%	98,26%	98,26%
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	VaR relativo	Covarianza	S&P 500 Index	1,6 x bmk VaR	2,0 x bmk VaR	95,24%	113,12%	103,96%	49,41%	49,41%
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	VaR relativo	Histórico	Bloomberg Commodity Index	1,3 x bmk VaR	1,3 x bmk VaR	90,37%	111,55%	101,14%	13,50%	516,91%

* Método de cálculo. El modelo VaR se basa en un intervalo de confianza del 99% a lo largo de un periodo de participación de 1 mes. El modelo de covarianza utiliza 2 años de datos, ponderados con una semivida de 6 meses, y se actualiza diariamente. El método histórico utiliza 1 año de datos diarios.

Información para los accionistas (sin auditar)

La SICAV es una sociedad de inversión organizada como una «*Société d'Investissement à Capital Variable*» en el Gran Ducado de Luxemburgo en virtud de la Ley de 10 de agosto de 1915, en su versión modificada, y se considera un organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios («OICVM») en virtud de la Parte I de la Ley del 17 de diciembre de 2010, en su versión modificada.

La SICAV se constituyó el 10 de febrero de 1995 por un periodo ilimitado. Los estatutos de la SICAV se publicaron por primera vez en el *Recueil des Sociétés et Associations* (Registro Mercantil) del Gran Ducado de Luxemburgo el 31 de marzo de 1995 y se modificaron por última vez el 14 de septiembre de 2018.

La SICAV está registrada en el Registro Mercantil de Luxemburgo con el número B-50216.

La junta general anual de Accionistas de la SICAV se celebrará en Luxemburgo, según se especifique en la convocatoria, dentro de los seis meses siguientes al cierre del ejercicio contable. La junta general anual podrá celebrarse en el extranjero si, a juicio absoluto y definitivo del Consejo, las circunstancias excepcionales así lo requieren. Las demás juntas de Accionistas podrán celebrarse en el lugar y plazo de la convocatoria que se especifique en las respectivas convocatorias. Las convocatorias de las juntas generales se realizan con arreglo a la legislación luxemburguesa y a las normas aplicables en los países pertinentes en los que las Acciones se ofrecen públicamente a la venta. En las convocatorias se especificarán el lugar y la hora de la junta, las condiciones de admisión, el orden del día, el quórum y los requisitos de votación.

El ejercicio contable de la SICAV finaliza el 31 de marzo de cada año.

El informe anual y los estados financieros auditados y el informe semestral sin auditar están disponibles en el domicilio social de la SICAV y en la oficina principal de cada agente de pagos y distribuidor. Las cuentas combinadas de la SICAV se expresan en dólares estadounidenses.

El Valor liquidativo y los precios de oferta y reembolso de las acciones de la SICAV se hacen públicos en el domicilio social de la SICAV.

Este informe no constituye una oferta o una solicitud de una oferta para comprar acciones en la SICAV. Las suscripciones se aceptan según el Folleto y el último informe anual disponible que contiene los estados financieros auditados a 31 de marzo y el último informe semestral disponible a 30 de septiembre, si se publican posteriormente.

Ciertas Carteras y/o clases de acciones contenidas en este informe pueden no estar autorizadas ni ofrecerse para la venta en todas las jurisdicciones en este momento.

Documento de datos fundamentales para el inversor («KIID»): requisitos de suscripción

El KIID es un documento precontractual y los inversores deberán confirmar que han leído el último KIID antes de hacer una suscripción. La Sociedad Gestora tiene el derecho de rechazar una suscripción si el inversor no confirma que ha leído el último KIID en el momento de la solicitud. El último KIID se podrá obtener en www.columbiathreadneedle.com.

Declaraciones de la remuneración

El grupo Threadneedle («el Grupo») cambió su denominación de Threadneedle Asset Management Holdings Sàrl, constituida en Luxemburgo, a TAM UK International Holdings Limited («UK HoldCo» o «la Sociedad»), constituida en Reino Unido, con efecto a partir del 16 de julio de 2021. Esta declaración se hace con respecto a la Política de remuneración del Grupo, tal como se aplica a Threadneedle Management Luxembourg S.A. («el Gestor») con respecto a la Directiva sobre Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios («OICVM») y otras normas y directrices aplicables.

La Política de remuneración se aplica a todas las entidades filiales a las que se aplican los requisitos de las Directivas sobre OICVM, y el Comité de remuneración la aprobó por última vez en diciembre de 2021.

1. El Comité de remuneración

El Comité de remuneración de UK HoldCo («el Comité») es un subcomité del Consejo de UK HoldCo que asume la responsabilidad de establecer la filosofía y los objetivos que regirán los programas de retribución y beneficios del Grupo; de revisar y aprobar los planes, las políticas y las prácticas de retribución y beneficios; y de supervisar y aprobar la remuneración del Grupo. Se ha determinado que sea independiente de la gestión ejecutiva diaria del Grupo y está formado por Consejeros del Grupo designados por Ameriprise Financial, la sociedad matriz del Grupo.

Los miembros actuales del Comité son el Sr. Walter Berman, el Sr. William Turner y la Sra. Karen Wilson-Thissen. Las juntas normalmente se celebran en enero, marzo, junio, septiembre y diciembre. El director de remuneraciones para EMEA y APAC actúa como secretario del Comité. El Comité puede invitar a asistir a las juntas a cualquier empleado del Grupo o experto funcional de la sociedad matriz que considere adecuado, a fin de permitirle cumplir con sus responsabilidades, incluido garantizar que la remuneración es coherente con la gestión de riesgos efectiva y no fomentar una asunción de riesgos excesiva.

Información para los accionistas (sin auditar)

(continuación)

2. Determinación de mancomunaciones de remuneración de incentivos

El Gestor tomó sus decisiones de Concesión anual de incentivos totales de mancomunaciones independientes que abarcan la actividad Inmobiliaria, la unidad de Distribución, las actividades de Inversión y las funciones de Apoyo, combinadas en definitiva para la gobernanza y la supervisión en el plano regional de EMEA. Tales mancomunaciones se determinan a discreción de la Sociedad, sujetas a la supervisión y a la aprobación finales del Comité de remuneración. Las mancomunaciones para los Planes de incentivos especiales («SIP», por sus siglas en inglés) para el sector Inmobiliario, la Distribución y las Inversiones se determinan con referencia a cuatro factores no ponderados, que son una evaluación «descendente» de los requisitos legales, normativos y de práctica de mercado y cualesquiera otros factores contextuales internos o externos; un cálculo «ascendente» con base en el rendimiento comercial frente al nivel del Plan e incentivo objetivo para la empresa (consulte el apartado «Pago por rendimiento» a continuación); el rendimiento estratégico y financiero general del Grupo; y el rendimiento estratégico y financiero de Ameriprise Financial como sociedad matriz y accionista del Grupo. La financiación de las funciones de apoyo forma parte del plan global de «AIA», y la financiación para cada región y actividad se determina mediante una Evaluación integral y equilibrada de las unidades de negocio en el contexto del rendimiento general del grupo Ameriprise Financial. Todas las mancomunaciones se establecen en el contexto del entorno de riesgo y control mantenido durante el ejercicio y pueden ajustarse de forma descendente para reflejar cualquier aspecto sustancial al respecto. El Comité también recibe informes continuos a lo largo del ejercicio de la función de Riesgo relativa a las evaluaciones de riesgos y otros temas o ámbitos de interés relacionados con el control de riesgos o las preocupaciones sobre el comportamiento relacionado con los riesgos.

El Comité tiene todos estos factores en cuenta a fin de tomar una decisión equilibrada sobre la supervisión y aprobación de las mancomunaciones de incentivos totales para el ejercicio en cuestión.

3. Determinación de concesiones individuales de incentivos totales

Las decisiones de remuneración individual en relación con todos los planes de incentivos son discrecionales en su totalidad, aunque están fundamentadas de forma sólida en la evaluación del rendimiento anual y los niveles de remuneración del mercado conocidos para puestos de trabajo equivalentes, así como en la financiación mancomunada disponible. El departamento de Riesgo y cumplimiento proporciona información crítica al ajuste de la calificación de rendimiento final, lo que garantiza que todo riesgo y toda preocupación pertinente sobre el comportamiento se reflejen en las evaluaciones de rendimiento y, posteriormente, en las recomendaciones de remuneración. Los directores de Riesgo y cumplimiento para EMEA también informan directamente al Comité de remuneración del proceso de concesión para garantizar que el Comité reciba un informe directo en el que se base al tomar sus decisiones finales de ajuste de riesgos.

Los salarios base se mantienen a un nivel competitivo de mercado a fin de garantizar que, si procede, sea posible conceder cero incentivos.

Pago por rendimiento

El elemento ascendente del proceso de determinación de la mancomunación de los Planes de incentivos especiales mide el rendimiento empresarial general y por equipos frente a los objetivos comerciales principales para cada ámbito del Grupo, incluido el rendimiento de las inversiones a largo plazo para las divisiones de Inversiones e Inmobiliaria y una combinación de ventas brutas y netas para la división de Distribución. El rendimiento de inversiones se evalúa respecto al índice de referencia de cada fondo y sus perfiles de riesgo. Tales impactos de las evaluaciones en el cálculo ascendente están limitados, y ponderados en mayor medida con los periodos de tiempo más largos, para que los gestores de incentivos no asuman un riesgo excesivo a fin de ofrecer mayores mancomunaciones de incentivos. Si bien los resultados estratégicos y financieros del Grupo y la sociedad matriz son factores importantes en la determinación de la mancomunación, el modelo se establece para garantizar que el logro de los objetivos principales de la actividad comercial, incluida la aportación de rendimiento de inversiones a sus clientes, sea un impulsor explícito y significativo de la determinación de la mancomunación para tales divisiones.

Las concesiones individuales discrecionales de la financiación disponible, en el contexto de niveles de remuneración competitivos de mercado para el puesto de trabajo en cuestión, están impulsadas por cada calificación individual frente a las metas (Objetivos) y las expectativas de la dirección sobre el comportamiento del Grupo (nuestros Valores), cada uno de los cuales está calificado de forma independiente sobre una escala de 5 puntos para garantizar que se otorga la debida importancia a la evaluación del comportamiento. Los objetivos se centran en los resultados clave para la función de ese año, en particular en la obtención de rendimiento de inversión para los empleados de la división de Inversiones y para la división de Inmuebles: todos los empleados también se gestionan en función de un Objetivo obligatorio de gestión de riesgos. El rendimiento de inversiones, si fuera relevante para la función, se evalúa frente al índice de referencia de cada fondo y sus perfiles de riesgo.

Se verifica la coherencia de las calificaciones en la actividad comercial con la información de los directores de Riesgo y cumplimiento para EMEA según sea necesaria para garantizar el equilibrio y el debido reflejo de la gestión de riesgos. Con respecto a los incentivos de las divisiones de Ventas, Inmobiliaria e Inversiones, no existe ninguna plantilla o fórmula predeterminada sobre las concesiones, que son discrecionales a fin de poder justificar y reflejar todos los factores pertinentes.

Información para los accionistas (sin auditar)

(continuación)

Prestación de incentivos totales

Threadneedle cree que las concesiones diferidas para los que ganan más y los que asumen riesgos son una cuestión de buenas prácticas y una parte importante de alinear los intereses del personal clave con los intereses a largo plazo de los clientes y accionistas. A tal respecto, las Concesiones de incentivos totales para todos los empleados del Grupo pueden otorgarse en parte en concesiones diferidas a través del programa de Concesión de incentivos a largo plazo de Ameriprise Financial («LTIA», por sus siglas en inglés) y, para aquel Personal de código/Personal identificado de la división de Inversiones, a través de un programa de diferimiento del fondo. Los diferimientos y la prestación de concesiones en instrumentos cumplirán con los requisitos normativos pertinentes en vigor en cada momento.

El personal calificado como Personal de código o Personal identificado y aquellos de un nivel comparable de antigüedad están sujetos a una tasa más alta de diferimiento. El 50% de la concesión de incentivos generales se ingresa en participaciones vinculadas al fondo sujetas a un periodo de participación después de la prestación. Las participaciones vinculadas al fondo están diseñadas para reflejar el rendimiento de una sección de productos y clases de activos dentro de la región.

4. Personal identificado

El Personal de código o Personal identificado se clasifica como Gestores sénior, personas con un impacto significativo en el perfil de riesgo de los OICVM, personas que ejercen funciones de control y otros empleados cuya remuneración total les sitúa en la misma categoría que la alta dirección y los que asumen riesgos, y cuyas actividades profesionales tienen un impacto significativo en los perfiles de riesgo del Gestor o de los fondos que este gestiona. En la práctica, esto incluirá los denominados Gestores de los Fondos de tales fondos del Gestor.

5. Declaración del pago de la remuneración

El periodo de rendimiento para la remuneración opera sobre la base del año calendario.

La remuneración total pagada por la Sociedad Gestora a 23 Gestores sénior del Personal de código de remuneración del OICVM V por sus actividades de OICVM en el año de resultados 2021 fue de 1,78 millones de libras esterlinas, de los cuales 0,72 millones fueron remuneraciones fijas y 1,06 millones fueron variables. La remuneración total pagada a otros miembros del Personal de código de remuneración del OICVM cuyas actividades tuvieron un impacto significativo en el perfil de riesgo del Gestor fue de 7,17 millones de libras esterlinas, de los cuales 2,60 millones fueron remuneraciones fijas y 4,57 millones fueron variables. La remuneración total pagada a los gestores delegados de los fondos regulados por los OICVM fue de 1,49 millones de libras esterlinas, de los cuales 0,25 millones fueron remuneraciones fijas y 1,24 millones fueron variables.

Información para inversores en Suiza (sin auditar)

El informe anual y los estados financieros auditados, el informe semestral sin auditar, el informe sobre los cambios en las participaciones de la Cartera correspondiente al ejercicio, los estatutos, el Folleto (versión suiza) y el KIID podrán obtenerse previa solicitud y sin coste alguno en las oficinas del Representante y agente de pagos suizo de la SICAV, RBC Investor Services Bank S.A., sito en Esch-sur-Alzette, Sucursal de Zúrich, Bleicherweg 7, 8027 Zúrich, Suiza, o en el domicilio social de la SICAV.

El rendimiento histórico no es un indicio del rendimiento actual o futuro, y los datos de rendimiento no tienen en cuenta las comisiones y los costes incurridos en la emisión y el reembolso de acciones.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond								
AEC	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-2,48%	8,26%	9,67%	12,51%	9,06%
AEH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-2,49%	8,26%	9,71%	12,51%	9,09%
AKH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-2,26%	8,26%	9,87%	12,51%	9,31%
ANH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de octubre de 2019	-0,79%	-1,75%	8,26%	10,06%	1,13%	0,68%
AU	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-1,57%	8,26%	11,36%	12,51%	12,32%
AUP	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-1,57%	8,26%	11,36%	12,51%	12,33%
DEC	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-3,21%	8,26%	8,90%	12,51%	8,07%
DEH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-3,22%	8,26%	8,85%	12,51%	8,27%
DU	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-2,30%	8,26%	10,53%	12,51%	11,46%
DUP	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-2,30%	8,26%	10,53%	12,51%	11,32%
IEC	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-2,29%	8,26%	9,92%	12,51%	9,21%
IEH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-2,29%	8,26%	9,86%	12,51%	9,25%
IEP	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	6,08%	8,26%	2,20%	12,51%	14,56%
IGC	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-1,63%	8,26%	10,24%	12,51%	10,47%
IGH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-1,61%	8,26%	10,25%	12,51%	10,55%
IKH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-1,95%	8,26%	10,10%	12,51%	9,40%
INH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de octubre de 2019	-0,79%	-1,47%	8,26%	10,39%	1,13%	0,79%
IU	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-1,37%	8,26%	11,58%	12,51%	12,52%
IUP	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-1,37%	8,26%	11,61%	12,51%	12,74%
NEC	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-2,09%	8,26%	10,16%	12,51%	9,47%
NEH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-2,10%	8,26%	10,08%	12,51%	9,54%
NGC	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-1,41%	8,26%	10,51%	12,51%	10,87%
NGH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-1,41%	8,26%	10,49%	12,51%	10,84%
NU	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-1,17%	8,26%	11,80%	12,51%	12,80%
NUP	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-1,17%	8,26%	11,82%	12,51%	12,80%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2020 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond								
<i>(continuación)</i>								
XEH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged	Rendimiento desde su lanzamiento el 16 de octubre de 2020	-0,79%	-1,80%	2,18%	2,27%	n/d	n/d
XFH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged	Rendimiento desde su lanzamiento el 16 de octubre de 2020	-0,79%	-2,07%	2,18%	2,21%	n/d	n/d
XGH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged	Rendimiento desde su lanzamiento el 17 de mayo de 2019	-0,79%	-1,11%	8,26%	10,81%	6,56%	5,91%
XU	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged	Rendimiento desde su lanzamiento el 16 de octubre de 2020	-0,79%	-0,87%	2,18%	2,48%	n/d	n/d
ZEH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-2,23%	8,26%	9,97%	12,51%	9,30%
ZFH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged	Rendimiento desde su lanzamiento el 14 de octubre de 2020	-0,79%	-2,66%	2,17%	2,11%	n/d	n/d
ZGH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-1,55%	8,26%	10,32%	12,51%	10,67%
ZU	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79%	-1,32%	8,26%	11,63%	12,51%	12,60%
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond								
AE	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08%	-1,81%	2,73%	3,76%	6,29%	5,91%
ANH	iBoxx EUR Corporate Bond	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de octubre de 2019	-1,08%	-1,20%	2,73%	4,48%	0,00%	0,30%
IE	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08%	-1,22%	2,73%	4,39%	6,29%	6,46%
IEP	iBoxx EUR Corporate Bond	Rendimiento desde su lanzamiento el 8 de abril de 2021	-0,66%	-0,97%	n/d	n/d	n/d	n/d
INH	iBoxx EUR Corporate Bond	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de octubre de 2019	-1,08%	-0,51%	2,73%	5,04%	0,00%	0,41%
XE	iBoxx EUR Corporate Bond	Rendimiento desde su lanzamiento el 16 de octubre de 2020	-1,08%	-0,73%	1,13%	1,53%	n/d	n/d
XFH	iBoxx EUR Corporate Bond	Rendimiento desde su lanzamiento el 16 de octubre de 2020	-1,08%	-1,05%	1,13%	1,48%	n/d	n/d
XGH	iBoxx EUR Corporate Bond	Rendimiento desde su lanzamiento el 16 de octubre de 2020	-1,08%	-0,20%	1,13%	1,65%	n/d	n/d
XUH	iBoxx EUR Corporate Bond	Rendimiento desde su lanzamiento el 16 de octubre de 2020	-1,08%	-0,04%	1,13%	1,72%	n/d	n/d
ZE	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08%	-1,45%	2,73%	4,29%	6,29%	6,33%
ZFH	iBoxx EUR Corporate Bond	Rendimiento desde su lanzamiento el 14 de octubre de 2020	-1,08%	-1,72%	1,27%	1,51%	n/d	n/d
1E	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08%	-1,80%	2,73%	3,78%	6,29%	5,91%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond								
<i>(continuación)</i>								
1G	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08%	-7,89%	2,73%	9,62%	6,29%	-0,43%
2E	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08%	-1,20%	2,73%	4,41%	6,29%	6,53%
2G	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08%	-7,36%	2,73%	10,26%	6,29%	0,55%
3G	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08%	-7,43%	2,73%	10,18%	6,29%	0,15%
4E	iBoxx EUR Corporate Bond	Rendimiento desde su lanzamiento el 8 de abril de 2020	-1,08%	-0,70%	9,46%	10,73%	n/d	n/d
4G	iBoxx EUR Corporate Bond	Rendimiento desde su lanzamiento el 4 de abril de 2019	-1,08%	-6,86%	2,73%	10,85%	2,82%	2,95%
8E	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08%	-1,24%	2,73%	4,37%	6,29%	6,75%
8G	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08%	-7,36%	2,73%	10,26%	6,29%	0,21%
9G	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08%	-7,46%	2,73%	10,22%	6,29%	0,48%
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond								
AE	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)	Rendimiento desde su lanzamiento el 6 de mayo de 2020	3,25%	1,46%	14,26%	11,30%	n/d	n/d
AKH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de octubre de 2019	3,25%	1,67%	2,82%	2,71%	2,12%	1,32%
ANH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de octubre de 2019	3,25%	2,17%	2,82%	2,68%	2,12%	1,71%
IE	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	2,27%	2,82%	3,43%	10,95%	9,68%
IEP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	2,27%	2,82%	3,43%	10,95%	9,53%
IKH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de octubre de 2019	3,25%	2,48%	2,82%	3,32%	2,12%	1,42%
INH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de octubre de 2019	3,25%	2,93%	2,82%	3,36%	2,12%	1,85%
XE	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de julio de 2019	3,25%	3,00%	2,82%	4,15%	2,73%	2,65%
ZE	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	2,22%	2,82%	3,38%	10,95%	9,67%
ZEP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	2,22%	2,82%	3,36%	10,95%	9,49%
1E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	1,73%	2,82%	2,88%	10,95%	9,13%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)*(continuación)*

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond								
<i>(continuación)</i>								
1EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	1,73%	2,82%	2,88%	10,95%	9,11%
1G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	-4,58%	2,82%	8,68%	10,95%	3,09%
1GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	-4,56%	2,82%	8,65%	10,95%	3,07%
1UT	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	2,47%	2,82%	4,25%	10,95%	12,25%
2E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	2,30%	2,82%	3,46%	10,95%	9,71%
2EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	2,33%	2,82%	3,50%	10,95%	9,74%
2FH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	1,99%	2,82%	3,12%	10,95%	9,26%
2G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	-4,11%	2,82%	9,29%	10,95%	3,71%
2GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	-3,99%	2,82%	9,36%	10,95%	3,68%
3E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	2,35%	2,82%	3,51%	10,95%	9,82%
3EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	2,35%	2,82%	3,51%	10,95%	9,80%
3FC	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	2,03%	2,82%	3,16%	10,95%	9,36%
3FH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	2,04%	2,82%	3,18%	10,95%	9,32%
3G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	-3,99%	2,82%	9,35%	10,95%	3,62%
3GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	-3,98%	2,82%	9,32%	10,95%	3,68%
4E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	3,07%	2,82%	4,24%	10,95%	10,61%
4G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	-3,32%	2,82%	10,12%	10,95%	4,40%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond								
<i>(continuación)</i>								
8E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	2,26%	2,82%	3,42%	10,95%	9,76%
8EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	2,26%	2,82%	3,42%	10,95%	9,66%
8FH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	1,95%	2,82%	3,09%	10,95%	9,28%
8G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	-4,08%	2,82%	9,25%	10,95%	3,60%
8GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	-4,06%	2,82%	9,22%	10,95%	3,57%
9E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	2,40%	2,82%	3,55%	10,95%	9,84%
9EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	2,40%	2,82%	3,55%	10,95%	9,85%
9FC	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	2,10%	2,82%	3,19%	10,95%	9,32%
9FH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	2,08%	2,82%	3,22%	10,95%	9,30%
9G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	-3,87%	2,82%	9,44%	10,95%	3,69%
9GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25%	-3,88%	2,82%	9,41%	10,95%	3,64%
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond								
AE	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de julio de 2019	n/d	1,82%	0,62%	1,31%	1,65%	1,21%
AEP	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de julio de 2019	n/d	1,82%	0,62%	1,31%	1,65%	1,21%
AKH	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de julio de 2019	n/d	2,11%	0,62%	1,43%	1,65%	1,27%
ANH	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de julio de 2019	n/d	2,55%	0,62%	1,64%	1,65%	2,08%
IE	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de julio de 2019	n/d	2,23%	0,62%	1,72%	1,65%	1,39%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones			31 de diciembre de 2021	31 de diciembre de 2020	31 de diciembre de 2019			
Nombre del índice de referencia	Comentarios	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond								
<i>(continuación)</i>								
IEP	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de julio de 2019	n/d	2,22%	0,62%	1,67%	1,65%	1,38%
IGC	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de julio de 2019	n/d	2,80%	0,62%	2,11%	1,65%	1,87%
IGH	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de julio de 2019	n/d	2,76%	0,62%	2,04%	1,65%	1,90%
IKH	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de octubre de 2019	n/d	2,49%	0,62%	1,82%	1,63%	0,94%
INH	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de octubre de 2019	n/d	2,92%	0,62%	2,02%	1,63%	1,34%
XE	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de julio de 2019	n/d	2,64%	0,62%	2,13%	1,65%	1,58%
XGC	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL	Rendimiento desde su lanzamiento el 27 de noviembre de 2019	n/d	3,19%	0,62%	2,48%	0,95%	0,76%
XGH	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de julio de 2019	n/d	3,17%	0,62%	2,52%	1,65%	2,04%
ZE	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de julio de 2019	n/d	2,16%	0,62%	1,66%	1,65%	1,38%
Threadneedle (Lux) - European Social Bond								
AE	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de septiembre de 2020	-1,46%	-2,38%	1,52%	1,36%	n/d	n/d
AEP	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de septiembre de 2020	-1,46%	-2,38%	1,52%	1,36%	n/d	n/d
AFH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	-0,62%	-1,19%	n/d	n/d	n/d	n/d
AKH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 14 de octubre de 2020	-1,46%	-1,93%	1,04%	1,03%	n/d	n/d
ANH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 14 de octubre de 2020	-1,46%	-1,46%	1,04%	1,12%	n/d	n/d
ASC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	-0,62%	-0,43%	n/d	n/d	n/d	n/d
ASH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	-0,62%	-0,44%	n/d	n/d	n/d	n/d

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - European Social Bond								
<i>(continuación)</i>								
AUC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	-0,62%	-0,36%	n/d	n/d	n/d	n/d
AUH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	-0,62%	-0,33%	n/d	n/d	n/d	n/d
ID	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 15 de noviembre de 2019	-1,46%	-2,31%	2,74%	2,77%	-0,19%	-0,20%
IE	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-1,46%	-2,23%	2,74%	3,16%	5,72%	5,82%
IEP	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-1,46%	-2,23%	2,74%	3,16%	5,72%	5,82%
IFH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-1,46%	-2,56%	2,74%	2,78%	5,72%	5,27%
IGH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	-0,62%	-0,45%	n/d	n/d	n/d	n/d
IKH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 13 de agosto de 2019	-1,46%	-1,88%	2,74%	3,33%	-1,01%	-1,03%
INH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de octubre de 2019	-1,46%	-1,41%	2,74%	3,69%	-0,26%	0,02%
ISC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	-0,62%	-0,42%	n/d	n/d	n/d	n/d
ISH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	-0,62%	-0,42%	n/d	n/d	n/d	n/d
IUC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	-0,62%	-0,35%	n/d	n/d	n/d	n/d
IUH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	-0,62%	-0,26%	n/d	n/d	n/d	n/d
LE	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-1,46%	-2,24%	2,74%	3,23%	5,72%	5,98%
NEP	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 13 de marzo de 2019	-1,46%	-2,23%	2,74%	3,23%	3,60%	3,91%
ZD	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 15 de noviembre de 2019	-1,46%	-2,36%	2,74%	2,71%	-0,19%	-0,22%
ZE	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-1,46%	-2,28%	2,74%	3,11%	5,72%	5,73%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021 Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	31 de diciembre de 2020 Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	31 de diciembre de 2019 Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - European Social Bond								
<i>(continuación)</i>								
ZEP	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de abril de 2019	-1,46%	-2,28%	2,74%	3,11%	2,60%	2,59%
ZFH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-1,46%	-2,60%	2,74%	2,76%	5,72%	5,32%
ZGC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 3 de abril de 2020	-1,46%	-1,75%	7,68%	7,77%	n/d	n/d
ZGH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 3 de abril de 2020	-1,46%	-1,75%	7,68%	7,78%	n/d	n/d
ZUH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 12 de junio de 2020	-1,46%	-1,58%	3,50%	3,92%	n/d	n/d
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond								
AE	ICE BofA Custom Index		0,86%	-0,63%	2,23%	5,38%	7,00%	6,73%
AEP	ICE BofA Custom Index		0,86%	-0,63%	2,23%	5,38%	7,00%	6,78%
AKH	ICE BofA Custom Index	Rendimiento desde su lanzamiento el 13 de agosto de 2019	0,86%	-0,54%	2,23%	5,56%	0,89%	0,83%
ANH	ICE BofA Custom Index	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de octubre de 2019	0,86%	-0,13%	2,23%	5,97%	0,73%	0,87%
AUH	ICE BofA Custom Index		0,86%	-0,02%	2,23%	6,72%	7,00%	9,78%
DE	ICE BofA Custom Index		0,86%	-1,18%	2,23%	4,80%	7,00%	6,17%
DEP	ICE BofA Custom Index		0,86%	-1,18%	2,23%	4,80%	7,00%	6,12%
DUH	ICE BofA Custom Index		0,86%	-0,65%	2,23%	6,04%	7,00%	9,00%
IE	ICE BofA Custom Index		0,86%	-0,04%	2,23%	6,01%	7,00%	7,38%
INH	ICE BofA Custom Index	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de octubre de 2019	0,86%	0,70%	2,23%	6,77%	0,73%	1,02%
ZE	ICE BofA Custom Index	Rendimiento desde su lanzamiento el 11 de noviembre de 2021	-0,42%	-0,40%	n/d	n/d	n/d	n/d
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds								
AEC	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91%	-2,47%	7,13%	6,21%	13,09%	8,77%
AEH	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91%	-2,43%	7,13%	6,22%	13,09%	8,77%
AKH	JPM CEMBI Broad Diversified	Rendimiento desde su lanzamiento el 27 de junio de 2019	0,91%	-2,12%	7,13%	6,31%	4,19%	2,30%
ANH	JPM CEMBI Broad Diversified	Rendimiento desde su lanzamiento el 27 de junio de 2019	0,91%	-1,71%	7,13%	6,15%	4,19%	3,25%
ASH	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91%	-1,60%	7,13%	7,35%	13,09%	11,18%
AU	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91%	-1,54%	7,13%	7,90%	13,09%	12,10%
AUP	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91%	-1,54%	7,13%	7,90%	13,09%	12,15%
DEC	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91%	-2,57%	7,13%	6,10%	13,09%	8,61%
DEH	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91%	-2,53%	7,13%	6,12%	13,09%	8,62%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds								
<i>(continuación)</i>								
DU	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91%	-1,64%	7,13%	7,79%	13,09%	11,97%
IEC	JPM CEMBI Broad Diversified	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	n/d	-1,16%	n/d	n/d	n/d	n/d
IEH	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91%	-1,65%	7,13%	7,09%	13,09%	9,63%
IU	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91%	-0,77%	7,13%	8,76%	13,09%	12,88%
W	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91%	-1,20%	7,13%	8,27%	13,09%	12,52%
WEH	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91%	-2,10%	7,13%	6,59%	13,09%	9,13%
XUP	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91%	0,07%	7,13%	9,66%	13,09%	13,86%
ZU	JPM CEMBI Broad Diversified	Rendimiento desde su lanzamiento el 11 de noviembre de 2021	n/d	0,01%	n/d	n/d	n/d	n/d
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt								
AEC	JPM EMBI Global		-1,51%	-3,92%	5,88%	5,56%	14,42%	9,61%
AEH	JPM EMBI Global		-1,51%	-3,91%	5,88%	5,55%	14,42%	9,68%
AKH	JPM EMBI Global	Rendimiento desde su lanzamiento el 27 de junio de 2019	-1,51%	-3,83%	5,88%	5,36%	3,58%	0,97%
ANH	JPM EMBI Global	Rendimiento desde su lanzamiento el 27 de junio de 2019	-1,51%	-3,40%	5,88%	4,87%	3,58%	1,90%
ASH	JPM EMBI Global		-1,51%	-3,08%	5,88%	6,61%	14,42%	12,16%
AU	JPM EMBI Global		-1,51%	-2,96%	5,88%	7,29%	14,42%	13,04%
AUP	JPM EMBI Global		-1,51%	-2,96%	5,88%	7,29%	14,42%	13,06%
DEH	JPM EMBI Global		-1,51%	-4,02%	5,88%	5,44%	14,42%	9,54%
DU	JPM EMBI Global		-1,51%	-3,06%	5,88%	7,18%	14,42%	12,93%
IEH	JPM EMBI Global		-1,51%	-3,16%	5,88%	6,41%	14,42%	10,50%
IU	JPM EMBI Global	Rendimiento desde su lanzamiento el 22 de mayo de 2019	-1,51%	-2,45%	5,88%	7,98%	7,09%	5,79%
SU	JPM EMBI Global		-1,51%	-3,11%	5,88%	7,12%	14,42%	12,89%
SUP	JPM EMBI Global		-1,51%	-3,11%	5,88%	7,13%	14,42%	12,84%
W	JPM EMBI Global		-1,51%	-2,62%	5,88%	7,66%	14,42%	13,43%
XUP	JPM EMBI Global		-1,51%	-1,59%	5,88%	8,91%	14,42%	14,79%
ZU	JPM EMBI Global		-1,51%	-2,34%	5,88%	8,07%	14,42%	13,89%
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds								
AEC	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19%	-2,58%	4,79%	2,68%	10,54%	3,91%
AEH	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19%	-2,59%	4,79%	2,69%	10,54%	4,01%
AKH	JPM EMBI Global 3-5 Yrs	Rendimiento desde su lanzamiento el 27 de junio de 2019	0,19%	-2,33%	4,79%	2,65%	2,70%	-0,66%
ANH	JPM EMBI Global 3-5 Yrs	Rendimiento desde su lanzamiento el 27 de junio de 2019	0,19%	-1,88%	4,79%	2,90%	2,70%	0,24%
ASC	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19%	-1,70%	4,79%	3,71%	10,54%	6,34%
ASH	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19%	-1,72%	4,79%	3,70%	10,54%	6,36%
AU	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19%	-1,65%	4,79%	4,22%	10,54%	7,23%
AUP	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19%	-1,65%	4,79%	4,22%	10,54%	7,20%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)*(continuación)*

Clase de Acciones			31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
Nombre del índice de referencia	Comentarios	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds								
<i>(continuación)</i>								
DEH	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19%	-2,73%	4,79%	2,54%	10,54%	3,81%
DU	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19%	-1,79%	4,79%	4,07%	10,54%	6,99%
IE	JPM EMBI Global 3-5 Yrs	Rendimiento desde su lanzamiento el 27 de noviembre de 2019	0,19%	6,62%	4,79%	-3,68%	1,34%	-0,83%
IEH	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19%	-1,84%	4,79%	3,45%	10,54%	4,74%
XU	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19%	-0,21%	4,79%	5,75%	10,54%	8,79%
XUP	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19%	-0,21%	4,79%	5,75%	10,54%	8,80%
ZEH	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19%	-1,90%	4,79%	3,38%	10,54%	4,67%
ZU	JPM EMBI Global 3-5 Yrs	Rendimiento desde su lanzamiento el 11 de noviembre de 2021	-1,11%	-0,74%	n/d	n/d	n/d	n/d
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond								
AEC	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27%	2,57%	6,10%	3,32%	14,40%	11,89%
AEH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27%	2,56%	6,10%	3,33%	14,40%	11,92%
AKH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de octubre de 2019	5,27%	2,89%	6,10%	3,11%	2,44%	1,64%
ANH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de octubre de 2019	5,27%	3,26%	6,10%	2,96%	2,44%	2,02%
ASH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27%	3,45%	6,10%	4,30%	14,40%	14,49%
AU	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27%	3,54%	6,10%	4,99%	14,40%	15,38%
AUP	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27%	3,54%	6,10%	4,99%	14,40%	15,41%
DEC	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27%	2,37%	6,10%	3,13%	14,40%	11,72%
DEH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27%	2,38%	6,10%	3,13%	14,40%	11,69%
DU	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27%	3,34%	6,10%	4,78%	14,40%	15,14%
IEC	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27%	3,48%	6,10%	4,30%	14,40%	12,84%
IEH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27%	3,49%	6,10%	4,22%	14,40%	12,93%
IKH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de octubre de 2019	5,27%	3,80%	6,10%	4,08%	2,44%	1,84%
INH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de octubre de 2019	5,27%	4,19%	6,10%	3,97%	2,44%	2,25%
ISC	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained	Rendimiento desde su lanzamiento el 29 de julio de 2021	1,38%	1,52%	n/d	n/d	n/d	n/d

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)*(continuación)*

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond								
<i>(continuación)</i>								
IU	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27%	4,48%	6,10%	5,94%	14,40%	16,46%
TEH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27%	3,48%	6,10%	4,22%	14,40%	13,04%
XUP	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27%	5,06%	6,10%	6,51%	14,40%	16,98%
ZFH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27%	2,91%	6,10%	3,70%	14,40%	12,03%
ZGH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27%	3,79%	6,10%	4,13%	14,40%	13,94%
ZU	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27%	4,22%	6,10%	5,67%	14,40%	16,15%
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond								
AEH	JPM Asia Credit Diversified		-0,61%	-0,82%	5,67%	2,44%	14,12%	11,69%
AKH	JPM Asia Credit Diversified	Rendimiento desde su lanzamiento el 13 de agosto de 2019	-0,61%	-0,50%	5,67%	2,68%	3,14%	1,89%
AS	JPM Asia Credit Diversified		-0,61%	2,06%	5,67%	2,32%	14,12%	13,55%
ASC	JPM Asia Credit Diversified		-0,61%	0,03%	5,67%	3,65%	14,12%	14,19%
ASH	JPM Asia Credit Diversified		-0,61%	0,01%	5,67%	3,61%	14,12%	14,13%
AU	JPM Asia Credit Diversified		-0,61%	0,07%	5,67%	4,10%	14,12%	15,13%
AUP	JPM Asia Credit Diversified		-0,61%	0,07%	5,67%	4,10%	14,12%	15,16%
AVC	JPM Asia Credit Diversified		-0,61%	-0,50%	5,67%	3,16%	14,12%	13,66%
AVH	JPM Asia Credit Diversified		-0,61%	-0,38%	5,67%	3,10%	14,12%	13,62%
DEH	JPM Asia Credit Diversified		-0,61%	-1,14%	5,67%	2,21%	14,12%	11,43%
IEH	JPM Asia Credit Diversified		-0,61%	-0,24%	5,67%	3,15%	14,12%	12,51%
IGH	JPM Asia Credit Diversified		-0,61%	0,41%	5,67%	3,60%	14,12%	13,86%
ISH	JPM Asia Credit Diversified		-0,61%	0,66%	5,67%	4,34%	14,12%	14,96%
IU	JPM Asia Credit Diversified		-0,61%	0,67%	5,67%	4,80%	14,12%	16,01%
XU	JPM Asia Credit Diversified		-0,61%	1,07%	5,67%	5,46%	14,12%	16,69%
ZU	JPM Asia Credit Diversified		-0,61%	0,57%	5,67%	4,70%	14,12%	15,86%
ZUP	JPM Asia Credit Diversified		-0,61%	0,55%	5,67%	4,63%	14,12%	15,71%
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return								
AE	MUICP (EU CPI)		4,76%	6,86%	-0,25%	5,21%	1,33%	12,23%
AEP	MUICP (EU CPI)		4,76%	6,81%	-0,25%	5,16%	1,33%	12,19%
DE	MUICP (EU CPI)		4,76%	6,06%	-0,25%	4,43%	1,33%	11,42%
IE	MUICP (EU CPI)		4,76%	7,61%	-0,25%	5,95%	1,33%	12,97%
IEP	MUICP (EU CPI)		4,76%	7,61%	-0,25%	5,92%	1,33%	13,04%
LE	MUICP (EU CPI)		4,76%	7,77%	-0,25%	6,11%	1,33%	13,14%
LEP	MUICP (EU CPI)		4,76%	7,82%	-0,25%	6,10%	1,33%	13,20%
ZE	MUICP (EU CPI)		4,76%	7,41%	-0,25%	5,74%	1,33%	12,82%
ZEP	MUICP (EU CPI)		4,76%	7,42%	-0,25%	5,75%	1,33%	12,78%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return								
AEC	US CPI		7,12%	-0,68%	n/d	9,60%	n/d	8,90%
AEH	US CPI		7,12%	-0,67%	n/d	9,60%	n/d	8,90%
AKH	US CPI	Rendimiento desde su lanzamiento el 13 de agosto de 2019	7,12%	-0,44%	n/d	9,59%	n/d	3,22%
AU	US CPI		7,12%	0,32%	n/d	11,46%	n/d	12,28%
AUP	US CPI		7,12%	0,32%	n/d	11,46%	n/d	12,30%
DEH	US CPI		7,12%	-1,32%	n/d	8,89%	n/d	8,19%
DU	US CPI		7,12%	-0,33%	n/d	10,74%	n/d	11,55%
IEH	US CPI	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de junio de 2019	7,12%	-0,09%	n/d	10,26%	n/d	2,91%
IGH	US CPI		7,12%	0,66%	n/d	10,78%	n/d	10,85%
IU	US CPI		7,12%	1,03%	n/d	12,24%	n/d	13,08%
W	US CPI		7,12%	0,22%	n/d	11,35%	n/d	12,15%
ZU	US CPI	Rendimiento desde su lanzamiento el 11 de noviembre de 2021	0,99%	-1,89%	n/d	n/d	n/d	n/d
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income								
AE	Índice de referencia compuesto		1,03%	15,61%	0,66%	-6,12%	2,39%	16,37%
AEC	Índice de referencia compuesto		1,03%	6,43%	0,66%	0,64%	2,39%	10,88%
AEH	Índice de referencia compuesto		1,03%	6,35%	0,66%	0,61%	2,39%	10,90%
AEP	Índice de referencia compuesto		1,03%	15,61%	0,66%	-6,12%	2,39%	16,38%
AS	Índice de referencia compuesto		1,03%	9,39%	0,66%	0,33%	2,39%	12,44%
ASC	Índice de referencia compuesto		1,03%	7,33%	0,66%	1,53%	2,39%	13,35%
ASH	Índice de referencia compuesto		1,03%	7,27%	0,66%	1,46%	2,39%	13,35%
ASP	Índice de referencia compuesto		1,03%	9,60%	0,66%	0,57%	2,39%	12,74%
AU	Índice de referencia compuesto		1,03%	7,45%	0,66%	2,33%	2,39%	14,27%
AUM	Índice de referencia compuesto	Rendimiento desde su lanzamiento el 6 de septiembre de 2019	1,03%	7,45%	0,66%	2,32%	0,63%	4,50%
AUP	Índice de referencia compuesto		1,03%	7,45%	0,66%	2,33%	2,39%	14,30%
DEC	Índice de referencia compuesto		1,03%	5,63%	0,66%	-0,14%	2,39%	9,99%
DEH	Índice de referencia compuesto		1,03%	5,55%	0,66%	-0,14%	2,39%	10,11%
DEP	Índice de referencia compuesto		1,03%	14,74%	0,66%	-6,82%	2,39%	15,56%
DU	Índice de referencia compuesto		1,03%	6,65%	0,66%	1,56%	2,39%	13,45%
DUP	Índice de referencia compuesto		1,03%	6,65%	0,66%	1,56%	2,39%	13,50%
ZE	Índice de referencia compuesto		1,03%	16,17%	0,66%	-5,65%	2,39%	17,04%
ZEC	Índice de referencia compuesto		1,03%	6,93%	0,66%	1,08%	2,39%	11,39%
ZEH	Índice de referencia compuesto		1,03%	6,91%	0,66%	1,11%	2,39%	11,40%
ZFH	Índice de referencia compuesto		1,03%	6,59%	0,66%	0,89%	2,39%	10,95%
ZU	Índice de referencia compuesto		1,03%	7,98%	0,66%	2,84%	2,39%	14,90%
ZUP	Índice de referencia compuesto		1,03%	7,90%	0,66%	2,72%	2,39%	14,79%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities								
AE	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-2,22%	-2,97%	20,31%	24,15%	n/d	n/d
AEC	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-2,22%	-10,90%	20,31%	29,65%	n/d	n/d
AEH	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-2,22%	-10,94%	20,31%	29,65%	n/d	n/d
AU	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-2,22%	-9,83%	20,31%	30,12%	n/d	n/d
AUP	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-2,22%	-9,84%	20,31%	30,12%	n/d	n/d
IE	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-2,22%	-2,10%	20,31%	24,47%	n/d	n/d
IEH	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-2,22%	-10,11%	20,31%	29,96%	n/d	n/d
IG	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-2,22%	-8,13%	20,31%	21,79%	n/d	n/d
IU	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-2,22%	-8,98%	20,31%	30,48%	n/d	n/d
LE	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-2,22%	-1,75%	20,31%	24,58%	n/d	n/d
LG	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-2,22%	-7,89%	20,31%	21,90%	n/d	n/d
XU	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-2,22%	-8,41%	20,31%	30,71%	n/d	n/d
ZE	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-2,22%	-2,23%	20,31%	24,40%	n/d	n/d
ZEC	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-2,22%	-10,21%	20,31%	29,89%	n/d	n/d
ZEH	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-2,22%	-10,24%	20,31%	29,89%	n/d	n/d
ZU	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-2,22%	-9,18%	20,31%	30,39%	n/d	n/d
ZUP	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-2,22%	-9,18%	20,31%	30,38%	n/d	n/d

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Focus								
AEH	MSCI AC World		19,04%	21,21%	16,82%	24,63%	27,30%	29,89%
AEP	MSCI AC World		19,04%	31,78%	16,82%	16,31%	27,30%	36,40%
AU	MSCI AC World		19,04%	22,48%	16,82%	26,78%	27,30%	33,90%
AUP	MSCI AC World		19,04%	22,48%	16,82%	26,78%	27,30%	33,86%
DEH	MSCI AC World		19,04%	20,31%	16,82%	23,70%	27,30%	28,94%
DU	MSCI AC World		19,04%	21,57%	16,82%	25,84%	27,30%	32,90%
IE	MSCI AC World		19,04%	32,91%	16,82%	17,30%	27,30%	37,49%
IEH	MSCI AC World		19,04%	22,24%	16,82%	25,69%	27,30%	31,69%
IU	MSCI AC World		19,04%	23,53%	16,82%	27,86%	27,30%	35,01%
IUP	MSCI AC World		19,04%	23,52%	16,82%	27,82%	27,30%	34,94%
W	MSCI AC World		19,04%	22,54%	16,82%	26,85%	27,30%	33,96%
XU	MSCI AC World		19,04%	24,52%	16,82%	28,89%	27,30%	36,15%
ZE	MSCI AC World		19,04%	32,77%	16,82%	17,19%	27,30%	37,44%
ZEH	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 16 de septiembre de 2020	19,04%	22,14%	12,83%	9,88%	n/d	n/d
ZEP	MSCI AC World		19,04%	32,77%	16,82%	17,19%	27,30%	37,42%
ZFH	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 16 de septiembre de 2020	19,04%	21,76%	12,83%	9,80%	n/d	n/d
ZG	MSCI AC World		19,04%	24,54%	16,82%	23,79%	27,30%	29,72%
ZU	MSCI AC World		19,04%	23,40%	16,82%	27,74%	27,30%	34,91%
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities								
AEH	MSCI Emerging Markets		-2,22%	-10,32%	18,69%	31,52%	18,88%	26,38%
AU	MSCI Emerging Markets		-2,22%	-9,25%	18,69%	33,80%	18,88%	30,53%
DEH	MSCI Emerging Markets		-2,22%	-10,97%	18,69%	30,51%	18,88%	25,53%
DU	MSCI Emerging Markets		-2,22%	-9,93%	18,69%	32,80%	18,88%	29,55%
IE	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 6 de mayo de 2020	-2,22%	-1,53%	46,87%	47,45%	n/d	n/d
IEH	MSCI Emerging Markets		-2,22%	-9,54%	18,69%	32,58%	18,88%	27,57%
IU	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 22 de mayo de 2019	-2,22%	-8,48%	18,69%	34,94%	14,81%	19,39%
ZU	MSCI Emerging Markets		-2,22%	-8,57%	18,69%	34,80%	18,88%	31,40%
1E	MSCI Emerging Markets		-2,22%	-2,27%	18,69%	22,86%	18,88%	32,53%
1U	MSCI Emerging Markets		-2,22%	-9,17%	18,69%	33,92%	18,88%	30,89%
2E	MSCI Emerging Markets		-2,22%	-1,68%	18,69%	23,61%	18,88%	33,89%
2U	MSCI Emerging Markets		-2,22%	-8,60%	18,69%	34,80%	18,88%	31,49%
8E	MSCI Emerging Markets		-2,22%	-1,71%	18,69%	23,56%	18,88%	34,03%
8U	MSCI Emerging Markets		-2,22%	-8,65%	18,69%	34,69%	18,88%	31,50%
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income								
AEC	MSCI AC World		19,04%	14,84%	16,82%	1,52%	27,30%	18,13%
AUP	MSCI AC World		19,04%	16,13%	16,82%	3,23%	27,30%	21,98%
DEC	MSCI AC World		19,04%	14,27%	16,82%	0,97%	27,30%	17,54%
DUP	MSCI AC World		19,04%	15,58%	16,82%	2,71%	27,30%	21,13%
IU	MSCI AC World		19,04%	17,04%	16,82%	4,09%	27,30%	22,87%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income								
<i>(continuación)</i>								
TE	MSCI AC World		19,04%	25,75%	16,82%	-4,66%	27,30%	25,08%
ZU	MSCI AC World		19,04%	16,99%	16,82%	4,02%	27,30%	22,82%
1E	MSCI AC World		19,04%	25,12%	16,82%	-5,14%	27,30%	24,34%
1EP	MSCI AC World		19,04%	25,12%	16,82%	-5,14%	27,30%	24,27%
1SC	MSCI AC World		19,04%	15,95%	16,82%	2,22%	27,30%	20,86%
1SH	MSCI AC World		19,04%	15,95%	16,82%	2,18%	27,30%	21,00%
1ST	MSCI AC World		19,04%	15,98%	16,82%	2,19%	27,30%	20,88%
1U	MSCI AC World		19,04%	16,29%	16,82%	3,40%	27,30%	22,09%
1UP	MSCI AC World		19,04%	16,29%	16,82%	3,40%	27,30%	22,01%
1VT	MSCI AC World		19,04%	15,25%	16,82%	0,40%	27,30%	20,44%
2E	MSCI AC World		19,04%	25,88%	16,82%	-4,56%	27,30%	25,02%
2EP	MSCI AC World		19,04%	25,84%	16,82%	-4,53%	27,30%	25,09%
2U	MSCI AC World		19,04%	17,00%	16,82%	4,04%	27,30%	22,81%
2UP	MSCI AC World		19,04%	17,03%	16,82%	4,03%	27,30%	22,76%
3E	MSCI AC World		19,04%	26,06%	16,82%	-4,43%	27,30%	25,19%
3EP	MSCI AC World		19,04%	26,06%	16,82%	-4,42%	27,30%	25,28%
3U	MSCI AC World		19,04%	17,16%	16,82%	4,18%	27,30%	23,04%
3UP	MSCI AC World		19,04%	17,16%	16,82%	4,18%	27,30%	22,97%
8E	MSCI AC World		19,04%	25,83%	16,82%	-4,60%	27,30%	25,00%
8EP	MSCI AC World		19,04%	25,83%	16,82%	-4,63%	27,30%	24,97%
8U	MSCI AC World		19,04%	16,95%	16,82%	3,99%	27,30%	22,76%
8UP	MSCI AC World		19,04%	16,95%	16,82%	3,99%	27,30%	22,71%
9E	MSCI AC World		19,04%	26,09%	16,82%	-4,33%	27,30%	25,36%
9EP	MSCI AC World		19,04%	26,10%	16,82%	-4,31%	27,30%	25,41%
9U	MSCI AC World		19,04%	17,22%	16,82%	4,33%	27,30%	23,25%
9UP	MSCI AC World		19,04%	17,31%	16,82%	4,27%	27,30%	23,19%
Threadneedle (Lux) - Global Select								
IU	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	19,04%	13,86%	16,82%	21,20%	19,61%	24,55%
ZU	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	19,04%	13,80%	16,82%	21,08%	19,61%	24,48%
1E	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de enero de 2019	19,04%	21,61%	16,82%	10,40%	19,61%	25,50%
1U	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de enero de 2019	19,04%	13,03%	16,82%	20,34%	19,61%	23,81%
2E	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	19,04%	22,39%	16,82%	11,10%	19,61%	24,60%
2U	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	19,04%	13,72%	16,82%	21,07%	19,61%	24,47%
3U	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de enero de 2019	19,04%	13,91%	16,82%	21,28%	19,61%	24,52%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021 Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	31 de diciembre de 2020 Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	31 de diciembre de 2019 Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Select								
<i>(continuación)</i>								
8E	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de enero de 2019	19,04%	22,31%	16,82%	11,03%	19,61%	26,25%
8U	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de enero de 2019	19,04%	13,67%	16,82%	21,03%	19,61%	24,54%
9U	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	19,04%	13,96%	16,82%	21,33%	19,61%	24,70%
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies								
AE	MSCI World Small Cap		25,00%	22,14%	6,85%	27,53%	29,12%	38,43%
AEP	MSCI World Small Cap		25,00%	22,14%	6,85%	27,53%	29,12%	38,50%
AK	MSCI World Small Cap	Rendimiento desde su lanzamiento el 10 de enero de 2020	25,00%	25,15%	5,98%	19,04%	n/d	n/d
AUP	MSCI World Small Cap		25,00%	13,53%	6,85%	39,00%	29,12%	35,77%
DE	MSCI World Small Cap		25,00%	21,53%	6,85%	26,89%	29,12%	37,71%
IE	MSCI World Small Cap		25,00%	23,19%	6,85%	28,62%	29,12%	39,61%
IEP	MSCI World Small Cap	Rendimiento desde su lanzamiento el 29 de julio de 2020	25,00%	23,19%	22,69%	25,47%	n/d	n/d
NE	MSCI World Small Cap	Rendimiento desde su lanzamiento el 3 de julio de 2019	25,00%	23,43%	6,85%	28,88%	9,42%	11,22%
XE	MSCI World Small Cap		25,00%	24,17%	6,85%	29,65%	29,12%	40,80%
XFH	MSCI World Small Cap	Rendimiento desde su lanzamiento el 11 de noviembre de 2020	25,00%	23,86%	8,50%	9,06%	n/d	n/d
XG	MSCI World Small Cap		25,00%	16,50%	6,85%	36,89%	29,12%	32,70%
XGH	MSCI World Small Cap		25,00%	24,53%	6,85%	28,85%	29,12%	42,02%
XU	MSCI World Small Cap	Rendimiento desde su lanzamiento el 11 de noviembre de 2020	25,00%	15,41%	8,50%	12,89%	n/d	n/d
ZE	MSCI World Small Cap		25,00%	23,06%	6,85%	28,49%	29,12%	39,43%
ZFH	MSCI World Small Cap		25,00%	22,60%	6,85%	28,16%	29,12%	38,92%
ZG	MSCI World Small Cap		25,00%	15,43%	6,85%	35,73%	29,12%	31,71%
ZGH	MSCI World Small Cap		25,00%	23,29%	6,85%	27,70%	29,12%	40,75%
ZU	MSCI World Small Cap		25,00%	14,38%	6,85%	40,06%	29,12%	36,82%
Threadneedle (Lux) - American								
AEH	S&P 500		28,71%	23,73%	18,40%	18,60%	31,49%	27,22%
AU	S&P 500		28,71%	24,99%	18,40%	20,51%	31,49%	31,14%
DEH	S&P 500		28,71%	23,30%	18,40%	18,17%	31,49%	26,76%
DU	S&P 500		28,71%	24,56%	18,40%	20,08%	31,49%	30,66%
IEH	S&P 500		28,71%	24,85%	18,40%	19,66%	31,49%	28,35%
IU	S&P 500		28,71%	26,12%	18,40%	21,59%	31,49%	32,32%
W	S&P 500		28,71%	25,37%	18,40%	20,87%	31,49%	31,53%
ZE	S&P 500		28,71%	35,57%	18,40%	11,43%	31,49%	34,55%
ZEH	S&P 500		28,71%	24,73%	18,40%	19,56%	31,49%	28,20%
ZU	S&P 500		28,71%	26,02%	18,40%	21,42%	31,49%	32,14%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - American								
<i>(continuación)</i>								
1E	S&P 500		28,71%	34,66%	18,40%	10,70%	31,49%	33,71%
1EH	S&P 500		28,71%	23,90%	18,40%	18,71%	31,49%	27,39%
1EP	S&P 500		28,71%	34,65%	18,40%	10,70%	31,49%	33,72%
1U	S&P 500		28,71%	25,15%	18,40%	20,66%	31,49%	31,25%
2E	S&P 500		28,71%	35,48%	18,40%	11,37%	31,49%	34,59%
2U	S&P 500		28,71%	25,92%	18,40%	21,40%	31,49%	32,09%
3EH	S&P 500		28,71%	24,90%	18,40%	19,63%	31,49%	28,30%
3U	S&P 500		28,71%	26,15%	18,40%	21,62%	31,49%	32,38%
8E	S&P 500		28,71%	35,43%	18,40%	11,33%	31,49%	34,51%
8U	S&P 500		28,71%	25,87%	18,40%	21,35%	31,49%	32,14%
9EH	S&P 500		28,71%	24,99%	18,40%	19,78%	31,49%	28,47%
9U	S&P 500		28,71%	26,20%	18,40%	21,67%	31,49%	32,39%
Threadneedle (Lux) - American Select								
AD	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 27 de junio de 2019	28,71%	29,73%	18,40%	13,52%	11,87%	14,46%
AEH	S&P 500		28,71%	19,50%	18,40%	22,24%	31,49%	28,61%
AN	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 27 de junio de 2019	28,71%	24,30%	18,40%	21,04%	11,87%	16,73%
AU	S&P 500		28,71%	20,68%	18,40%	24,22%	31,49%	32,67%
DEH	S&P 500		28,71%	18,57%	18,40%	21,33%	31,49%	27,65%
DU	S&P 500		28,71%	19,78%	18,40%	23,29%	31,49%	31,72%
ID	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 27 de junio de 2019	28,71%	30,76%	18,40%	14,42%	11,87%	14,90%
IE	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de junio de 2019	28,71%	30,84%	18,40%	14,82%	10,81%	14,89%
IEH	S&P 500		28,71%	20,45%	18,40%	23,20%	31,49%	29,69%
IN	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 27 de junio de 2019	28,71%	25,26%	18,40%	21,96%	11,87%	17,13%
W	S&P 500		28,71%	20,74%	18,40%	24,28%	31,49%	32,76%
ZEH	S&P 500		28,71%	20,30%	18,40%	23,14%	31,49%	29,68%
ZU	S&P 500		28,71%	21,52%	18,40%	25,09%	31,49%	33,67%
1E	S&P 500		28,71%	30,01%	18,40%	14,11%	31,49%	35,39%
1EH	S&P 500		28,71%	19,66%	18,40%	22,39%	31,49%	28,63%
1EP	S&P 500		28,71%	30,00%	18,40%	14,11%	31,49%	35,33%
1U	S&P 500		28,71%	20,83%	18,40%	24,38%	31,49%	32,98%
2EH	S&P 500		28,71%	20,44%	18,40%	23,19%	31,49%	29,56%
2U	S&P 500		28,71%	21,59%	18,40%	25,16%	31,49%	33,57%
3E	S&P 500		28,71%	31,05%	18,40%	15,02%	31,49%	36,21%
3U	S&P 500		28,71%	21,80%	18,40%	25,37%	31,49%	33,71%
8EH	S&P 500		28,71%	20,29%	18,40%	23,12%	31,49%	29,78%
8U	S&P 500		28,71%	21,52%	18,40%	25,09%	31,49%	33,63%
9E	S&P 500		28,71%	31,17%	18,40%	15,12%	31,49%	36,42%
9U	S&P 500		28,71%	21,87%	18,40%	25,46%	31,49%	34,01%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones			31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
Nombre del índice de referencia	Comentarios	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies								
AEH	Russell 2500		18,18%	22,12%	19,99%	28,44%	27,77%	26,00%
AU	Russell 2500		18,18%	23,60%	19,99%	30,64%	27,77%	30,06%
DEH	Russell 2500		18,18%	21,51%	19,99%	27,81%	27,77%	25,40%
DU	Russell 2500		18,18%	22,99%	19,99%	30,06%	27,77%	29,42%
IE	Russell 2500	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de junio de 2019	18,18%	34,11%	19,99%	20,86%	9,14%	8,53%
IU	Russell 2500		18,18%	24,66%	19,99%	31,79%	27,77%	31,07%
ZU	Russell 2500		18,18%	24,54%	19,99%	31,71%	27,77%	31,12%
1E	Russell 2500		18,18%	33,15%	19,99%	20,05%	27,77%	32,57%
1EP	Russell 2500		18,18%	33,14%	19,99%	20,06%	27,77%	32,70%
1U	Russell 2500		18,18%	23,75%	19,99%	30,86%	27,77%	30,30%
2U	Russell 2500		18,18%	24,51%	19,99%	31,66%	27,77%	30,96%
3EH	Russell 2500		18,18%	23,19%	19,99%	29,63%	27,77%	27,18%
3U	Russell 2500		18,18%	24,68%	19,99%	31,84%	27,77%	31,15%
8U	Russell 2500		18,18%	24,46%	19,99%	31,61%	27,77%	30,96%
9EH	Russell 2500		18,18%	23,20%	19,99%	29,69%	27,77%	27,31%
9U	Russell 2500		18,18%	24,73%	19,99%	31,89%	27,77%	31,25%
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity								
AE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	-0,40%	22,75%	13,91%	19,48%	24,85%
AF	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	-4,62%	22,75%	13,34%	19,48%	20,39%
AS	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	-5,58%	22,75%	21,97%	19,48%	20,69%
ASH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	-7,80%	22,75%	22,68%	19,48%	21,25%
AU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	-7,43%	22,75%	24,14%	19,48%	22,53%
DE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	-1,14%	22,75%	13,04%	19,48%	23,87%
IF	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	-3,76%	22,75%	14,26%	19,48%	21,41%
ISH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	-7,00%	22,75%	23,72%	19,48%	22,24%
IU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	-6,64%	22,75%	25,20%	19,48%	23,64%
XU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 17 de mayo de 2019	-2,65%	-5,89%	22,75%	26,21%	10,94%	12,45%
XUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	-5,89%	22,75%	26,21%	19,48%	24,64%
ZE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	0,35%	22,75%	14,75%	19,48%	25,78%
ZEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	-7,83%	22,75%	22,88%	19,48%	19,64%
ZF	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	-3,87%	22,75%	14,21%	19,48%	21,33%
ZG	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	-5,85%	22,75%	21,19%	19,48%	18,76%
ZU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	-6,73%	22,75%	25,08%	19,48%	23,46%
Threadneedle (Lux) - Asia Equities								
AE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 10 de junio de 2021	-8,64%	-3,78%	n/d	n/d	n/d	n/d
AEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 10 de junio de 2021	-8,64%	-10,74%	n/d	n/d	n/d	n/d
DE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 10 de junio de 2021	-8,64%	-4,02%	n/d	n/d	n/d	n/d

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021 Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	31 de diciembre de 2020 Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	31 de diciembre de 2019 Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - Asia Equities								
<i>(continuación)</i>								
DEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 10 de junio de 2021	-8,64%	-10,98%	n/d	n/d	n/d	n/d
IE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de junio de 2019	-2,65%	2,96%	22,75%	17,53%	6,89%	13,26%
IU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	-2,65%	-4,31%	22,75%	28,11%	12,84%	19,48%
ZU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	-2,65%	-4,40%	22,75%	27,99%	12,84%	19,41%
1E	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de enero de 2019	-2,65%	2,19%	22,75%	16,65%	12,84%	20,60%
1U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de enero de 2019	-2,65%	-5,02%	22,75%	27,15%	12,84%	18,94%
2E	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	-2,65%	2,82%	22,75%	17,36%	12,84%	21,27%
2U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	-2,65%	-4,44%	22,75%	27,93%	12,84%	19,43%
3U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de enero de 2019	-2,65%	-4,31%	22,75%	28,11%	12,84%	19,53%
8E	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de enero de 2019	-2,65%	2,78%	22,75%	17,25%	12,84%	21,04%
8U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de enero de 2019	-2,65%	-4,48%	22,75%	27,88%	12,84%	19,43%
9U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	-2,65%	-4,27%	22,75%	28,16%	12,84%	19,63%
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities								
AEC	S&P 500		28,71%	20,75%	18,40%	18,72%	31,49%	26,94%
AEH	S&P 500		28,71%	20,75%	18,40%	18,55%	31,49%	26,93%
AU	S&P 500		28,71%	22,01%	18,40%	20,48%	31,49%	30,86%
AUP	S&P 500		28,71%	22,01%	18,40%	20,48%	31,49%	30,89%
DU	S&P 500		28,71%	21,40%	18,40%	19,88%	31,49%	30,18%
IU	S&P 500		28,71%	22,99%	18,40%	21,45%	31,49%	31,91%
XS	S&P 500		28,71%	26,59%	18,40%	20,54%	31,49%	31,47%
XSH	S&P 500		28,71%	23,81%	18,40%	21,24%	31,49%	31,86%
ZEH	S&P 500		28,71%	21,65%	18,40%	19,39%	31,49%	27,89%
ZFH	S&P 500		28,71%	21,29%	18,40%	19,27%	31,49%	27,60%
ZGH	S&P 500		28,71%	22,11%	18,40%	18,83%	31,49%	29,21%
ZU	S&P 500		28,71%	22,93%	18,40%	21,39%	31,49%	31,81%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities								
AE	S&P 500		28,71%	43,84%	18,40%	-0,94%	31,49%	25,94%
AEH	S&P 500		28,71%	32,34%	18,40%	6,15%	31,49%	19,94%
AU	S&P 500		28,71%	33,69%	18,40%	7,97%	31,49%	23,65%
AUP	S&P 500		28,71%	33,70%	18,40%	7,97%	31,49%	23,73%
DE	S&P 500		28,71%	43,55%	18,40%	-1,14%	31,49%	25,72%
DEH	S&P 500		28,71%	32,08%	18,40%	5,98%	31,49%	19,65%
DU	S&P 500		28,71%	33,42%	18,40%	7,76%	31,49%	23,47%
IE	S&P 500		28,71%	44,35%	18,40%	-0,64%	31,49%	26,29%
IEC	S&P 500		28,71%	32,81%	18,40%	6,54%	31,49%	20,37%
IEH	S&P 500		28,71%	32,84%	18,40%	6,50%	31,49%	20,31%
IFH	S&P 500		28,71%	32,50%	18,40%	6,38%	31,49%	20,06%
IG	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 8 de mayo de 2019	28,71%	35,45%	18,40%	5,05%	11,67%	7,30%
IU	S&P 500		28,71%	34,19%	18,40%	8,35%	31,49%	24,07%
NE	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de septiembre de 2020	28,71%	44,70%	12,39%	7,24%	n/d	n/d
NG	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de septiembre de 2020	28,71%	35,62%	12,39%	5,28%	n/d	n/d
NU	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de septiembre de 2020	28,71%	34,41%	12,39%	11,13%	n/d	n/d
XG	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 20 de mayo de 2020	28,71%	35,73%	29,86%	5,63%	n/d	n/d
ZEH	S&P 500		28,71%	32,69%	18,40%	6,44%	31,49%	20,21%
ZFH	S&P 500		28,71%	32,38%	18,40%	6,24%	31,49%	19,88%
ZU	S&P 500		28,71%	34,02%	18,40%	8,24%	31,49%	23,98%
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities								
AE	MSCI Europe		25,85%	28,58%	-2,82%	6,41%	26,88%	31,29%
ASH	MSCI Europe		25,85%	29,32%	-2,82%	6,82%	26,88%	33,85%
AUH	MSCI Europe		25,85%	29,60%	-2,82%	7,77%	26,88%	35,07%
DE	MSCI Europe		25,85%	28,32%	-2,82%	6,08%	26,88%	30,85%
IE	MSCI Europe		25,85%	29,55%	-2,82%	7,29%	26,88%	32,39%
W	MSCI Europe		25,85%	28,32%	-2,82%	6,40%	26,88%	31,36%
XE	MSCI Europe		25,85%	30,39%	-2,82%	8,12%	26,88%	33,46%
ZE	MSCI Europe	Rendimiento desde su lanzamiento el 15 de julio de 2021	6,81%	9,50%	n/d	n/d	n/d	n/d
ZUH	MSCI Europe		25,85%	30,33%	-2,82%	8,53%	26,88%	36,01%
1E	MSCI Europe		25,85%	28,61%	-2,82%	6,47%	26,88%	31,39%
1EP	MSCI Europe		25,85%	28,57%	-2,82%	6,41%	26,88%	31,26%
1G	MSCI Europe		25,85%	20,63%	-2,82%	12,48%	26,88%	24,03%
1GP	MSCI Europe		25,85%	20,59%	-2,82%	12,43%	26,88%	23,95%
2E	MSCI Europe		25,85%	29,19%	-2,82%	7,11%	26,88%	32,24%
2G	MSCI Europe		25,85%	21,18%	-2,82%	13,15%	26,88%	24,82%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)*(continuación)*

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities								
<i>(continuación)</i>								
2U	MSCI Europe		25,85%	20,14%	-2,82%	16,81%	26,88%	29,92%
3E	MSCI Europe		25,85%	29,36%	-2,82%	7,26%	26,88%	32,47%
3G	MSCI Europe		25,85%	21,35%	-2,82%	13,31%	26,88%	25,05%
3GP	MSCI Europe		25,85%	21,38%	-2,82%	13,26%	26,88%	24,98%
4E	MSCI Europe		25,85%	30,48%	-2,82%	8,19%	26,88%	33,53%
4G	MSCI Europe		25,85%	22,45%	-2,82%	14,32%	26,88%	26,13%
8E	MSCI Europe		25,85%	29,13%	-2,82%	7,07%	26,88%	32,11%
8G	MSCI Europe		25,85%	21,13%	-2,82%	13,11%	26,88%	24,76%
8U	MSCI Europe		25,85%	20,13%	-2,82%	16,78%	26,88%	29,89%
9E	MSCI Europe		25,85%	29,42%	-2,82%	7,45%	26,88%	32,57%
9G	MSCI Europe		25,85%	21,38%	-2,82%	13,41%	26,88%	25,21%
9GP	MSCI Europe		25,85%	21,39%	-2,82%	13,41%	26,88%	25,21%
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend								
AE	MSCI Europe		25,85%	20,28%	-2,82%	0,02%	26,88%	24,76%
AEP	MSCI Europe		25,85%	20,27%	-2,82%	0,05%	26,88%	24,75%
AUP	MSCI Europe		25,85%	11,75%	-2,82%	8,99%	26,88%	22,51%
DE	MSCI Europe		25,85%	19,85%	-2,82%	-0,35%	26,88%	24,33%
DEP	MSCI Europe		25,85%	19,85%	-2,82%	-0,32%	26,88%	24,36%
IE	MSCI Europe		25,85%	21,42%	-2,82%	0,86%	26,88%	25,72%
IEP	MSCI Europe		25,85%	21,42%	-2,82%	0,89%	26,88%	25,72%
ZE	MSCI Europe		25,85%	21,18%	-2,82%	0,80%	26,88%	25,79%
ZEP	MSCI Europe		25,85%	21,18%	-2,82%	0,76%	26,88%	25,79%
1E	MSCI Europe		25,85%	20,39%	-2,82%	0,15%	26,88%	25,22%
1EP	MSCI Europe		25,85%	20,38%	-2,82%	0,15%	26,88%	24,77%
1G	MSCI Europe		25,85%	12,93%	-2,82%	5,79%	26,88%	18,14%
1GP	MSCI Europe		25,85%	12,92%	-2,82%	5,78%	26,88%	17,46%
2E	MSCI Europe		25,85%	21,13%	-2,82%	0,76%	26,88%	25,72%
2EP	MSCI Europe		25,85%	21,24%	-2,82%	0,78%	26,88%	25,73%
2G	MSCI Europe		25,85%	13,71%	-2,82%	6,50%	26,88%	18,76%
2GP	MSCI Europe		25,85%	13,72%	-2,82%	6,48%	26,88%	18,76%
3EP	MSCI Europe		25,85%	21,30%	-2,82%	0,90%	26,88%	25,82%
3G	MSCI Europe		25,85%	13,77%	-2,82%	6,59%	26,88%	19,07%
3GP	MSCI Europe		25,85%	13,78%	-2,82%	6,58%	26,88%	19,11%
4GP	MSCI Europe		25,85%	14,76%	-2,82%	7,50%	26,88%	20,56%
8E	MSCI Europe		25,85%	21,08%	-2,82%	0,72%	26,88%	25,58%
8EP	MSCI Europe		25,85%	21,08%	-2,82%	0,71%	26,88%	25,60%
8G	MSCI Europe		25,85%	13,57%	-2,82%	6,40%	26,88%	18,33%
8GP	MSCI Europe		25,85%	13,57%	-2,82%	6,38%	26,88%	18,82%
9EP	MSCI Europe		25,85%	21,37%	-2,82%	1,04%	26,88%	26,06%
9G	MSCI Europe		25,85%	13,83%	-2,82%	6,65%	26,88%	18,80%
9GP	MSCI Europe		25,85%	13,78%	-2,82%	6,69%	26,88%	18,85%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities								
AE	EMIX Smaller European Companies		23,41%	22,58%	7,78%	13,08%	29,30%	37,00%
ASH	EMIX Smaller European Companies		23,41%	23,34%	7,78%	13,61%	29,30%	39,80%
AUH	EMIX Smaller European Companies		23,41%	23,69%	7,78%	14,73%	29,30%	40,82%
DE	EMIX Smaller European Companies		23,41%	21,48%	7,78%	12,07%	29,30%	35,76%
DUH	EMIX Smaller European Companies		23,41%	22,60%	7,78%	13,74%	29,30%	39,55%
IE	EMIX Smaller European Companies		23,41%	23,50%	7,78%	13,93%	29,30%	38,01%
W	EMIX Smaller European Companies		23,41%	22,52%	7,78%	13,03%	29,30%	36,92%
ZE	EMIX Smaller European Companies		23,41%	23,50%	7,78%	13,93%	29,30%	38,01%
ZFH	EMIX Smaller European Companies		23,41%	23,07%	7,78%	13,72%	29,30%	37,40%
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies								
IE	EMIX Smaller European Companies	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de junio de 2019	23,41%	20,83%	7,78%	9,80%	13,26%	13,84%
ZE	EMIX Smaller European Companies		23,41%	20,65%	7,78%	9,63%	29,30%	37,23%
1E	EMIX Smaller European Companies		23,41%	19,91%	7,78%	8,96%	29,30%	36,47%
1EP	EMIX Smaller European Companies		23,41%	19,91%	7,78%	8,96%	29,30%	36,46%
1FH	EMIX Smaller European Companies		23,41%	19,48%	7,78%	8,77%	29,30%	36,04%
1G	EMIX Smaller European Companies		23,41%	12,47%	7,78%	15,10%	29,30%	28,81%
1UH	EMIX Smaller European Companies		23,41%	20,95%	7,78%	10,56%	29,30%	40,45%
2E	EMIX Smaller European Companies		23,41%	20,69%	7,78%	9,67%	29,30%	37,30%
2G	EMIX Smaller European Companies		23,41%	13,25%	7,78%	15,91%	29,30%	29,63%
3E	EMIX Smaller European Companies		23,41%	20,88%	7,78%	9,84%	29,30%	37,61%
3EP	EMIX Smaller European Companies		23,41%	20,88%	7,78%	9,84%	29,30%	37,56%
3FH	EMIX Smaller European Companies		23,41%	20,44%	7,78%	9,65%	29,30%	37,19%
3G	EMIX Smaller European Companies		23,41%	13,39%	7,78%	16,03%	29,30%	29,86%
3GP	EMIX Smaller European Companies		23,41%	13,39%	7,78%	16,02%	29,30%	29,85%
3UH	EMIX Smaller European Companies		23,41%	21,93%	7,78%	11,45%	29,30%	41,40%
4E	EMIX Smaller European Companies		23,41%	21,90%	7,78%	10,77%	29,30%	38,65%
4G	EMIX Smaller European Companies		23,41%	14,34%	7,78%	17,01%	29,30%	30,91%
8E	EMIX Smaller European Companies		23,41%	20,64%	7,78%	9,62%	29,30%	37,25%
8G	EMIX Smaller European Companies		23,41%	13,16%	7,78%	15,80%	29,30%	29,54%
9E	EMIX Smaller European Companies		23,41%	20,93%	7,78%	9,89%	29,30%	37,70%
9EP	EMIX Smaller European Companies		23,41%	20,99%	7,78%	9,99%	29,30%	37,79%
9FH	EMIX Smaller European Companies		23,41%	20,47%	7,78%	9,72%	29,30%	37,27%
9G	EMIX Smaller European Companies		23,41%	13,43%	7,78%	16,08%	29,30%	29,98%
9GP	EMIX Smaller European Companies		23,41%	13,48%	7,78%	16,16%	29,30%	29,98%
9UH	EMIX Smaller European Companies		23,41%	21,99%	7,78%	11,48%	29,30%	41,58%
Threadneedle (Lux) - European Select								
AE	FTSE World Europe ex UK		25,16%	25,17%	2,83%	8,47%	27,59%	32,63%
AGH	FTSE World Europe ex UK		25,16%	25,60%	2,83%	8,30%	27,59%	33,91%
AUH	FTSE World Europe ex UK		25,16%	26,16%	2,83%	9,89%	27,59%	36,39%
DUH	FTSE World Europe ex UK		25,16%	25,49%	2,83%	9,28%	27,59%	35,65%
IE	FTSE World Europe ex UK		25,16%	26,23%	2,83%	9,40%	27,59%	33,76%
ZE	FTSE World Europe ex UK	Rendimiento desde su lanzamiento el 14 de octubre de 2021	6,24%	5,96%	n/d	n/d	n/d	n/d
ZG	FTSE World Europe ex UK		25,16%	18,29%	2,83%	15,45%	27,59%	26,21%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - European Select								
<i>(continuación)</i>								
ZGH	FTSE World Europe ex UK		25,16%	26,53%	2,83%	9,08%	27,59%	34,89%
1E	FTSE World Europe ex UK		25,16%	25,35%	2,83%	8,63%	27,59%	32,85%
1EP	FTSE World Europe ex UK		25,16%	25,35%	2,83%	8,63%	27,59%	32,84%
1SH	FTSE World Europe ex UK		25,16%	26,12%	2,83%	9,20%	27,59%	35,47%
1U	FTSE World Europe ex UK		25,16%	16,51%	2,83%	18,41%	27,59%	30,47%
1UH	FTSE World Europe ex UK		25,16%	26,35%	2,83%	10,09%	27,59%	36,62%
2E	FTSE World Europe ex UK		25,16%	26,09%	2,83%	9,28%	27,59%	33,65%
2EP	FTSE World Europe ex UK		25,16%	26,12%	2,83%	9,35%	27,59%	33,70%
3E	FTSE World Europe ex UK		25,16%	26,32%	2,83%	9,47%	27,59%	33,80%
3U	FTSE World Europe ex UK		25,16%	17,41%	2,83%	19,33%	27,59%	31,38%
8E	FTSE World Europe ex UK		25,16%	26,04%	2,83%	9,23%	27,59%	33,59%
8EP	FTSE World Europe ex UK		25,16%	26,04%	2,83%	9,23%	27,59%	33,58%
9E	FTSE World Europe ex UK		25,16%	26,37%	2,83%	9,52%	27,59%	33,86%
9U	FTSE World Europe ex UK		25,16%	17,50%	2,83%	19,47%	27,59%	31,49%
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies								
IE	EMIX Smaller European Companies ex UK	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de junio de 2019	23,02%	22,87%	12,55%	14,97%	11,00%	9,26%
ZE	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02%	22,69%	12,55%	14,80%	27,77%	31,09%
1E	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02%	21,93%	12,55%	14,09%	27,77%	30,28%
1EP	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02%	21,93%	12,55%	14,09%	27,77%	30,28%
1FH	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02%	21,45%	12,55%	13,84%	27,77%	29,85%
2E	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02%	22,73%	12,55%	14,83%	27,77%	31,03%
3E	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02%	22,90%	12,55%	14,99%	27,77%	31,21%
3EP	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02%	22,90%	12,55%	14,99%	27,77%	31,23%
3FH	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02%	22,41%	12,55%	14,74%	27,77%	30,83%
8E	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02%	22,68%	12,55%	14,78%	27,77%	31,13%
9E	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02%	22,95%	12,55%	15,04%	27,77%	31,28%
9EP	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02%	22,95%	12,55%	15,04%	27,77%	31,35%
9FH	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02%	22,45%	12,55%	14,77%	27,77%	30,77%
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income								
AEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	0,42%	22,75%	21,55%	19,48%	22,20%
AU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	1,49%	22,75%	23,68%	19,48%	26,13%
AUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	1,49%	22,75%	23,68%	19,48%	26,13%
DEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	-0,34%	22,75%	20,64%	19,48%	21,28%
DU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	0,74%	22,75%	22,76%	19,48%	25,21%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income								
<i>(continuación)</i>								
DUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	0,74%	22,75%	22,76%	19,48%	25,15%
IEP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	10,12%	22,75%	14,36%	19,48%	29,48%
IU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 27 de noviembre de 2019	-2,65%	2,29%	22,75%	24,68%	5,07%	6,59%
W	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	1,29%	22,75%	23,43%	19,48%	25,89%
XU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 17 de mayo de 2019	-2,65%	3,18%	22,75%	25,74%	10,94%	16,94%
XUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	3,18%	22,75%	25,74%	19,48%	28,27%
ZG	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	3,16%	22,75%	20,82%	19,48%	22,09%
ZGH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	1,50%	22,75%	21,94%	19,48%	24,37%
ZGP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	3,16%	22,75%	20,76%	19,48%	22,11%
ZU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 11 de noviembre de 2021	-2,63%	1,62%	n/d	n/d	n/d	n/d
ZUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65%	2,26%	22,75%	24,61%	19,48%	27,12%
Threadneedle (Lux) - Global Technology								
AEH	MSCI World - Information Technology		30,15%	36,06%	44,26%	40,63%	48,15%	48,44%
AS	MSCI World - Information Technology		30,15%	40,24%	44,26%	40,53%	48,15%	51,03%
AU	MSCI World - Information Technology		30,15%	37,48%	44,26%	42,98%	48,15%	53,08%
AUP	MSCI World - Information Technology		30,15%	37,48%	44,26%	42,98%	48,15%	53,09%
BU	MSCI World - Information Technology		30,15%	36,93%	44,26%	42,41%	48,15%	52,46%
DEH	MSCI World - Information Technology		30,15%	35,58%	44,26%	40,18%	48,15%	48,06%
DU	MSCI World - Information Technology		30,15%	37,00%	44,26%	42,48%	48,15%	52,54%
IE	MSCI World - Information Technology	Rendimiento desde su lanzamiento el 10 de enero de 2020	30,15%	49,26%	40,01%	27,46%	n/d	n/d
IEH	MSCI World - Information Technology		30,15%	37,27%	44,26%	41,91%	48,15%	49,71%
IG	MSCI World - Information Technology		30,15%	40,01%	44,26%	39,81%	48,15%	48,40%
IU	MSCI World - Information Technology	Rendimiento desde su lanzamiento el 10 de enero de 2020	30,15%	38,72%	40,01%	40,48%	n/d	n/d
ZEH	MSCI World - Information Technology		30,15%	37,14%	44,26%	41,73%	48,15%	49,68%
ZFH	MSCI World - Information Technology		30,15%	36,74%	44,26%	41,68%	48,15%	49,21%
ZG	MSCI World - Information Technology		30,15%	39,88%	44,26%	39,67%	48,15%	48,45%
ZU	MSCI World - Information Technology		30,15%	38,58%	44,26%	44,12%	48,15%	54,29%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - UK Equities								
AE	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 12 de febrero de 2020	18,32%	16,67%	-9,32%	-15,31%	n/d	n/d
AEH	FTSE All Share		18,32%	8,76%	-9,82%	-11,08%	19,17%	20,61%
AFH	FTSE All Share		18,32%	8,55%	-9,82%	-11,06%	19,17%	20,15%
AG	FTSE All Share		18,32%	9,44%	-9,82%	-11,26%	19,17%	22,05%
AGP	FTSE All Share		18,32%	9,44%	-9,82%	-11,26%	19,17%	22,06%
DEH	FTSE All Share		18,32%	7,90%	-9,82%	-11,77%	19,17%	19,58%
DG	FTSE All Share		18,32%	8,56%	-9,82%	-11,97%	19,17%	21,01%
IE	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 27 de noviembre de 2019	18,32%	17,84%	-9,82%	-15,11%	3,00%	5,47%
IEH	FTSE All Share		18,32%	9,79%	-9,82%	-10,24%	19,17%	21,79%
IG	FTSE All Share		18,32%	10,48%	-9,82%	-10,41%	19,17%	23,21%
IGP	FTSE All Share		18,32%	10,48%	-9,82%	-10,41%	19,17%	23,24%
NEH	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de octubre de 2020	18,32%	10,02%	14,13%	18,52%	n/d	n/d
NFH	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de octubre de 2020	18,32%	9,83%	14,13%	18,55%	n/d	n/d
NG	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de octubre de 2020	18,32%	10,72%	14,13%	18,66%	n/d	n/d
NGP	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de octubre de 2020	18,32%	10,75%	14,13%	18,66%	n/d	n/d
NUH	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de octubre de 2020	18,32%	11,11%	14,13%	18,86%	n/d	n/d
TEH	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de octubre de 2020	18,32%	9,99%	14,13%	18,52%	n/d	n/d
TFH	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de octubre de 2020	18,32%	9,77%	14,13%	18,55%	n/d	n/d
TG	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de octubre de 2020	18,32%	10,72%	14,13%	18,66%	n/d	n/d
TGP	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de octubre de 2020	18,32%	10,72%	14,13%	18,66%	n/d	n/d
TUH	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de octubre de 2020	18,32%	11,08%	14,13%	18,86%	n/d	n/d
ZE	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 12 de febrero de 2020	18,32%	17,53%	-9,32%	-14,76%	n/d	n/d
ZEH	FTSE All Share		18,32%	9,58%	-9,82%	-10,44%	19,17%	21,52%
ZFH	FTSE All Share		18,32%	9,39%	-9,82%	-10,43%	19,17%	21,21%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021 Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	31 de diciembre de 2020 Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	31 de diciembre de 2019 Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - UK Equities								
<i>(continuación)</i>								
ZG	FTSE All Share		18,32%	10,26%	-9,82%	-10,59%	19,17%	22,97%
ZGP	FTSE All Share		18,32%	10,26%	-9,82%	-10,59%	19,17%	23,02%
ZUH	FTSE All Share	Estuvo inactivo del 24 de septiembre de 2020 al 20 de noviembre de 2020	18,32%	10,65%	2,92%	4,04%	19,17%	25,38%
3EH	FTSE All Share		18,32%	9,78%	-9,82%	-10,25%	19,17%	22,35%
3FH	FTSE All Share	Rendimiento hasta su cierre el 29 de noviembre de 2019 y desde el 24 de noviembre de 2020	18,32%	9,60%	2,80%	4,44%	15,33%	16,60%
3UH	FTSE All Share		18,32%	10,85%	-9,82%	-8,79%	19,17%	25,25%
9EH	FTSE All Share		18,32%	9,80%	-9,82%	-10,27%	19,17%	21,75%
9EP	FTSE All Share		18,32%	17,80%	-9,82%	-15,17%	19,17%	30,60%
9FH	FTSE All Share	Rendimiento hasta su cierre el 29 de noviembre de 2019	18,32%	9,64%	-9,82%	-10,23%	19,17%	21,47%
9G	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de abril de 2019	18,32%	10,50%	-9,82%	-10,40%	4,96%	7,27%
9UH	FTSE All Share		18,32%	10,89%	-9,82%	-8,85%	19,17%	25,30%
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income								
AE	FTSE All Share		18,32%	25,96%	-9,82%	-12,97%	19,17%	25,82%
AEC	FTSE All Share		18,32%	17,40%	-9,82%	-8,16%	19,17%	17,16%
AEH	FTSE All Share		18,32%	17,39%	-9,82%	-8,19%	19,17%	17,27%
AG	FTSE All Share		18,32%	18,15%	-9,82%	-8,07%	19,17%	18,75%
ASC	FTSE All Share		18,32%	18,24%	-9,82%	-7,63%	19,17%	19,65%
AUC	FTSE All Share		18,32%	18,42%	-9,82%	-6,82%	19,17%	20,54%
DE	FTSE All Share		18,32%	25,02%	-9,82%	-13,62%	19,17%	24,90%
DEC	FTSE All Share		18,32%	16,41%	-9,82%	-8,95%	19,17%	16,20%
DEH	FTSE All Share		18,32%	16,49%	-9,82%	-8,86%	19,17%	16,37%
DG	FTSE All Share		18,32%	17,27%	-9,82%	-8,76%	19,17%	17,87%
DGP	FTSE All Share		18,32%	17,15%	-9,82%	-8,79%	19,17%	17,83%
IE	FTSE All Share		18,32%	27,16%	-9,82%	-12,14%	19,17%	26,91%
IEH	FTSE All Share		18,32%	18,49%	-9,82%	-7,33%	19,17%	18,31%
IG	FTSE All Share		18,32%	19,27%	-9,82%	-7,19%	19,17%	19,84%
IGP	FTSE All Share		18,32%	19,28%	-9,82%	-7,19%	19,17%	19,90%
IU	FTSE All Share		18,32%	18,18%	-9,82%	-4,23%	19,17%	24,64%
IUH	FTSE All Share		18,32%	19,70%	-9,82%	-5,72%	19,17%	21,96%
LG	FTSE All Share		18,32%	19,45%	-9,82%	-7,05%	19,17%	20,01%
LGP	FTSE All Share		18,32%	19,45%	-9,82%	-7,05%	19,17%	19,99%
ZE	FTSE All Share		18,32%	26,90%	-9,82%	-12,32%	19,17%	26,69%
ZEH	FTSE All Share		18,32%	18,22%	-9,82%	-7,49%	19,17%	18,09%
ZFH	FTSE All Share		18,32%	17,97%	-9,82%	-7,62%	19,17%	17,71%
ZG	FTSE All Share		18,32%	19,04%	-9,82%	-7,38%	19,17%	19,68%
ZGP	FTSE All Share		18,32%	19,04%	-9,82%	-7,38%	19,17%	19,61%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021 Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	31 de diciembre de 2020 Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	31 de diciembre de 2019 Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income								
<i>(continuación)</i>								
ZUH	FTSE All Share		18,32%	19,33%	-9,82%	-6,85%	19,17%	21,67%
1EH	FTSE All Share		18,32%	17,55%	-9,82%	-8,07%	19,17%	17,41%
1FH	FTSE All Share		18,32%	17,27%	-9,82%	-8,17%	19,17%	17,00%
1UH	FTSE All Share		18,32%	18,62%	-9,82%	-6,65%	19,17%	20,78%
3EH	FTSE All Share		18,32%	18,43%	-9,82%	-7,32%	19,17%	18,25%
3FH	FTSE All Share		18,32%	18,17%	-9,82%	-7,46%	19,17%	17,93%
3UH	FTSE All Share		18,32%	19,53%	-9,82%	-5,91%	19,17%	21,79%
9EH	FTSE All Share		18,32%	18,50%	-9,82%	-7,29%	19,17%	18,24%
9FH	FTSE All Share		18,32%	18,14%	-9,82%	-7,44%	19,17%	17,88%
9G	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de abril de 2019	18,32%	19,29%	-9,82%	-7,18%	4,96%	7,41%
9UH	FTSE All Share		18,32%	19,57%	-9,82%	-5,90%	19,17%	21,76%
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity								
IU	MSCI EFM Africa ex-ZA 10/40		11,30%	0,43%	0,95%	-7,63%	17,01%	14,72%
ZU	MSCI EFM Africa ex-ZA 10/40		11,30%	0,43%	0,95%	-7,63%	17,01%	14,74%
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha								
AEH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13%	1,63%	0,66%	-1,27%	2,39%	-0,01%
AFH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13%	1,36%	0,66%	-1,50%	2,39%	-0,35%
AGH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13%	2,32%	0,66%	-0,78%	2,39%	1,21%
AU	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13%	2,61%	0,66%	0,00%	2,39%	3,09%
DEH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13%	1,13%	0,66%	-1,74%	2,39%	-0,51%
DU	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13%	2,10%	0,66%	-0,51%	2,39%	2,57%
IEH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13%	2,51%	0,66%	-0,41%	2,39%	0,85%
IGH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13%	2,92%	0,66%	0,01%	2,39%	2,04%
IU	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13%	3,23%	0,66%	0,85%	2,39%	3,66%
XGH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13%	4,04%	0,66%	0,79%	2,39%	2,92%
ZE	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13%	11,23%	0,66%	-7,50%	2,39%	5,11%
ZEH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13%	2,40%	0,66%	-0,47%	2,39%	0,75%
ZGH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13%	3,14%	0,66%	-0,07%	2,39%	1,92%
ZU	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13%	3,03%	0,66%	0,76%	2,39%	3,86%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities								
AE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor	Rendimiento desde su lanzamiento el 5 de agosto de 2021	-0,24%	-1,02%	n/d	n/d	n/d	n/d
IE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor	Rendimiento desde su lanzamiento el 5 de agosto de 2021	-0,24%	-0,82%	n/d	n/d	n/d	n/d
ZE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,48%	-0,62%	0,72%	-0,52%	3,18%
1E	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,88%	-0,62%	0,35%	-0,52%	2,70%
1EP	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,88%	-0,62%	0,35%	-0,52%	2,71%
1GH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,36%	-0,62%	0,84%	-0,52%	3,87%
1UH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,17%	-0,62%	1,55%	-0,52%	5,65%
2E	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,27%	-0,62%	0,96%	-0,52%	3,34%
2EP	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,18%	-0,62%	1,05%	-0,52%	3,44%
2GC	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	0,28%	-0,62%	1,55%	-0,52%	4,39%
2GH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	0,26%	-0,62%	1,47%	-0,52%	4,61%
4GH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	0,75%	-0,62%	1,99%	-0,52%	5,11%
8E	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,31%	-0,62%	0,92%	-0,52%	3,35%
8EP	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,31%	-0,62%	0,92%	-0,52%	3,36%
8GC	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	0,25%	-0,62%	1,44%	-0,52%	4,46%
8GH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	0,22%	-0,62%	1,45%	-0,52%	4,46%
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities								
AE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-1,41%	-0,62%	1,24%	-0,52%	2,66%
AFH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-1,58%	-0,62%	0,93%	-0,52%	2,16%
AKH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor	Rendimiento desde su lanzamiento el 27 de junio de 2019	-0,65%	-1,14%	-0,62%	1,45%	-0,29%	0,47%
ANH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor	Rendimiento desde su lanzamiento el 27 de junio de 2019	-0,65%	-0,78%	-0,62%	1,75%	-0,29%	1,37%
AUH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,69%	-0,62%	2,47%	-0,52%	5,61%
DE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-1,88%	-0,62%	0,67%	-0,52%	1,97%
IE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,70%	-0,62%	1,89%	-0,52%	3,24%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)*(continuación)*

Clase de Acciones			31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
Nombre del índice de referencia	Comentarios	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities								
<i>(continuación)</i>								
IEP	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor	-0,65%	-0,76%	-0,62%	1,68%	-0,52%	3,17%	
IGH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor	-0,65%	-0,11%	-0,62%	2,38%	-0,52%	4,52%	
INH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de octubre de 2019	-0,65%	-0,09%	-0,62%	2,28%	-0,12%	1,03%
IU	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor	Rendimiento desde su lanzamiento el 22 de mayo de 2019	-0,65%	-7,81%	-0,62%	11,08%	-0,34%	1,45%
IUH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,05%	-0,62%	3,16%	-0,52%	6,20%
JE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,73%	-0,62%	1,69%	-0,52%	3,29%
JGH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,01%	-0,62%	2,33%	-0,52%	4,37%
JUH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	0,01%	-0,62%	2,97%	-0,52%	5,72%
LE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,57%	-0,62%	2,04%	-0,52%	3,41%
LEP	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,56%	-0,62%	2,04%	-0,52%	3,50%
LGH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	0,12%	-0,62%	2,48%	-0,52%	4,60%
XE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor	Rendimiento desde su lanzamiento el 8 de abril de 2020	-0,65%	-0,30%	-0,46%	7,21%	n/d	n/d
XGH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor	Rendimiento desde su lanzamiento el 27 de noviembre de 2019	-0,65%	0,22%	-0,62%	2,79%	-0,06%	0,59%
XUH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor	Rendimiento desde su lanzamiento el 8 de abril de 2020	-0,65%	0,51%	-0,46%	7,83%	n/d	n/d
YE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,87%	-0,62%	1,63%	-0,52%	3,22%
YGH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,24%	-0,62%	2,17%	-0,52%	4,18%
YUH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,21%	-0,62%	2,82%	-0,52%	5,60%
ZE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,94%	-0,62%	1,69%	-0,52%	3,19%
ZFH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-1,13%	-0,62%	1,39%	-0,52%	2,64%
ZGH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,31%	-0,62%	2,23%	-0,52%	4,31%
ZUH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,65%	-0,24%	-0,62%	2,94%	-0,52%	6,15%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha								
AE	EURIBOR 3M		-0,55%	7,41%	-0,43%	-0,45%	-0,36%	20,39%
AEP	EURIBOR 3M		-0,55%	6,49%	-0,43%	0,16%	-0,36%	23,71%
AUH	EURIBOR 3M		-0,55%	7,97%	-0,43%	1,39%	-0,36%	21,26%
DE	EURIBOR 3M		-0,55%	6,00%	-0,43%	-0,40%	-0,36%	19,81%
IE	EURIBOR 3M		-0,55%	6,83%	-0,43%	0,93%	-0,36%	21,60%
IGH	EURIBOR 3M		-0,55%	7,42%	-0,43%	1,29%	-0,36%	21,06%
LE	EURIBOR 3M		-0,55%	7,00%	-0,43%	1,58%	-0,36%	21,34%
XGH	EURIBOR 3M		-0,55%	9,16%	-0,43%	2,22%	-0,36%	27,22%
ZE	EURIBOR 3M		-0,55%	7,37%	-0,43%	0,83%	-0,36%	21,75%
ZF	EURIBOR 3M		-0,55%	3,39%	-0,43%	0,62%	-0,36%	16,69%
ZFH	EURIBOR 3M		-0,55%	6,53%	-0,43%	0,43%	-0,36%	19,37%
ZGH	EURIBOR 3M		-0,55%	8,94%	-0,43%	1,31%	-0,36%	21,13%
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha								
AEH	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	28,71%	23,64%	18,40%	21,51%	23,57%	17,88%
AU	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	28,71%	24,80%	18,40%	23,40%	23,57%	21,24%
DEH	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	28,71%	22,95%	18,40%	20,92%	23,57%	17,33%
DU	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	28,71%	24,18%	18,40%	22,78%	23,57%	20,61%
IU	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	28,71%	25,93%	18,40%	24,50%	23,57%	22,29%
ZU	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	28,71%	25,84%	18,40%	24,34%	23,57%	22,08%
1E	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de enero de 2019	28,71%	34,43%	18,40%	13,32%	23,57%	23,20%
1EH	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de enero de 2019	28,71%	23,74%	18,40%	21,57%	23,57%	18,04%
1U	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de enero de 2019	28,71%	24,94%	18,40%	23,52%	23,57%	21,42%
2E	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	28,71%	35,61%	18,40%	14,30%	23,57%	24,23%
2U	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	28,71%	26,14%	18,40%	24,65%	23,57%	22,40%
3U	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de enero de 2019	28,71%	25,88%	18,40%	24,45%	23,57%	22,08%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)*(continuación)*

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha								
<i>(continuación)</i>								
8E	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de enero de 2019	28,71%	35,53%	18,40%	14,25%	23,57%	23,79%
8U	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de enero de 2019	28,71%	25,97%	18,40%	24,53%	23,57%	21,93%
9U	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	28,71%	26,03%	18,40%	24,48%	23,57%	22,39%
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha								
AEH	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	19,04%	7,85%	16,82%	21,19%	19,61%	22,96%
AU	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	19,04%	9,02%	16,82%	23,11%	19,61%	25,94%
DEH	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	19,04%	7,35%	16,82%	20,47%	19,61%	23,45%
DU	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	19,04%	8,48%	16,82%	22,56%	19,61%	25,97%
IU	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	19,04%	10,00%	16,82%	24,22%	19,61%	28,28%
ZU	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	19,04%	9,92%	16,82%	24,08%	19,61%	27,20%
1E	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de enero de 2019	19,04%	17,43%	16,82%	13,07%	19,61%	29,80%
1U	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de enero de 2019	19,04%	9,14%	16,82%	23,25%	19,61%	27,83%
2E	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	19,04%	18,52%	16,82%	14,04%	19,61%	29,09%
2U	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 26 de enero de 2019	19,04%	10,08%	16,82%	24,31%	19,61%	27,26%
8E	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de enero de 2019	19,04%	18,39%	16,82%	13,99%	19,61%	30,28%
8U	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de enero de 2019	19,04%	10,04%	16,82%	24,26%	19,61%	30,04%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020		31 de diciembre de 2019	
			Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities								
AEH	Bloomberg Commodity Index		27,11%	22,67%	-3,12%	-3,93%	7,69%	3,20%
AFH	Bloomberg Commodity Index		27,11%	22,48%	-3,12%	-4,10%	7,69%	2,88%
AGH	Bloomberg Commodity Index		27,11%	23,16%	-3,12%	-3,80%	7,69%	4,45%
ASH	Bloomberg Commodity Index		27,11%	23,70%	-3,12%	-3,11%	7,69%	5,46%
AU	Bloomberg Commodity Index		27,11%	24,03%	-3,12%	-2,37%	7,69%	6,49%
DEH	Bloomberg Commodity Index		27,11%	22,07%	-3,12%	-4,41%	7,69%	2,71%
DU	Bloomberg Commodity Index		27,11%	23,44%	-3,12%	-2,85%	7,69%	6,04%
IEH	Bloomberg Commodity Index		27,11%	23,89%	-3,12%	-2,91%	7,69%	4,31%
IG	Bloomberg Commodity Index		27,11%	26,34%	-3,12%	-4,55%	7,69%	3,34%
IGH	Bloomberg Commodity Index		27,11%	24,40%	-3,12%	-2,79%	7,69%	5,48%
IU	Bloomberg Commodity Index		27,11%	25,26%	-3,12%	-1,34%	7,69%	7,66%
NG	Bloomberg Commodity Index		27,11%	26,86%	-3,12%	-4,05%	7,69%	3,80%
XU	Bloomberg Commodity Index		27,11%	26,32%	-3,12%	-0,49%	7,69%	8,54%
ZEH	Bloomberg Commodity Index		27,11%	23,83%	-3,12%	-2,96%	7,69%	4,12%
ZFH	Bloomberg Commodity Index		27,11%	23,58%	-3,12%	-3,15%	7,69%	3,80%
ZGH	Bloomberg Commodity Index		27,11%	24,31%	-3,12%	-2,85%	7,69%	5,47%
ZU	Bloomberg Commodity Index		27,11%	25,19%	-3,12%	-1,38%	7,69%	7,65%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El valor liquidativo de las clases de acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2021 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas clases de acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la clase de acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las carteras.

Reglamento de operaciones de financiación de valores (sin auditar)

El Reglamento (UE) 2015/2365 del Parlamento Europeo y del Consejo sobre transparencia de las operaciones de financiación de valores y de reutilización («SFTR», por sus siglas en inglés) presenta los requisitos de información de operaciones de financiación de valores («SFT», por sus siglas en inglés) y de swaps de rentabilidad total. Una SFT viene definida en el artículo 3(11) del SFTR como:

- un acuerdo de recompra/recompra inversa;
- préstamos de valores o materias primas y empréstitos de valores o materias primas;
- una operación de compra con pacto de reventa o una operación de venta con pacto de recompra; o
- una operación de préstamo de márgenes.

A 31 de marzo de 2022, la SICAV realizó swaps de rentabilidad total («SRT») como tipo de instrumentos en el alcance del SFTR.

Datos globales

Nombre de la Cartera	Tipo de activo	Ganancias y pérdidas no realizadas en la divisa base de la cartera y en valor absoluto	% del patrimonio neto
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	SRT	140.624	0,57
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	SRT	990.355	0,80
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	SRT	530.036	0,42
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	SRT	2.725.280	2,75
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	SRT	17.857.131	3,26

Datos sobre la reutilización de garantías

No hubo reutilización de garantías durante el ejercicio cerrado a 31 de marzo de 2022.

Datos de concentración

Todas las garantías recibidas con respecto a SRT a 31 de marzo de 2022 son garantías en efectivo. Por consiguiente, no se aplica la disposición sobre los diez mayores emisores.

La siguiente tabla proporciona detalles de las diez principales contrapartes (basadas en el volumen bruto de transacciones pendientes) con respecto a SRT mantenidas por cada Cartera a 31 de marzo de 2022:

Nombre de la Cartera	Tipo de activo	Contraparte	Ganancias y pérdidas no realizadas en la divisa base de la cartera y en valor absoluto
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	SRT	UBS	107.980
		Bank of America Merrill Lynch	32.644
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	SRT	UBS	837.280
		Goldman Sachs	153.075
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	SRT	UBS	318.592
		Bank of America Merrill Lynch	211.444
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	SRT	UBS	2.725.280
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	SRT	Goldman Sachs	5.805.622
		Macquarie	5.184.353
		JPMorgan	3.701.658
		Citigroup Global Markets	1.627.423
		Credit Suisse	1.538.075

Custodia de las garantías recibidas

La garantía en efectivo se recibe en la cuenta de efectivo de cada Cartera en Citibank Europe plc, Sucursal de Luxemburgo.

La siguiente tabla muestra los depósitos a plazo que mantiene la SICAV a 31 de marzo de 2022:

Nombre de la Cartera	Tipo de garantía	Contraparte	Divisa de garantía	Importe de garantía
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Efectivo	UBS	EUR	20.000
		Total	EUR	20.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Efectivo	Bank of America Merrill Lynch	USD	99.000
		Total	USD	99.000
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Efectivo	UBS	USD	1.920.000
		Total	USD	1.920.000

Reglamento de operaciones de financiación de valores (sin auditar)

(continuación)

Nombre de la Cartera	Tipo de garantía	Contraparte	Divisa de garantía	Importe de garantía
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Efectivo	Goldman Sachs	USD	8.050.000
		Macquarie	USD	7.050.000
		JPMorgan	USD	8.500.000*
		Citigroup Global Markets	USD	2.191.000
		Credit Suisse	USD	2.070.000
		Total	USD	27.861.000

* Este importe de garantía podrá estar relacionado con operaciones que no sean SRT que no estén cubiertas por la divulgación del SFTR.

Datos generales de operaciones

Nombre de la Cartera	Tipo de garantía	Plazo de vencimiento (garantía)	Divisa de garantía	Plazo de vencimiento (SFT/SRT)	País de establecimiento (contraparte)	Liquidación y compensación	Calidad de la garantía
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Efectivo	Vencimiento abierto	USD	Más de 1 año	Reino Unido	Bilateral	N/D - Efectivo
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Efectivo	Vencimiento abierto	EUR	Más de 1 año	Reino Unido	Bilateral	N/D - Efectivo
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Efectivo	Vencimiento abierto	USD	Más de 1 año	Reino Unido	Bilateral	N/D - Efectivo
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Efectivo	Vencimiento abierto	USD	De 3 meses a 1 año / Más de 1 año	Reino Unido	Bilateral	N/D - Efectivo
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Efectivo	Vencimiento abierto	USD	Menos de 1 día / De 1 día a 1 mes	Reino Unido	Bilateral	N/D - Efectivo

Custodia de las garantías otorgadas

Las garantías en efectivo y en valores pagadas a las contrapartes se ingresan en cuentas separadas de la contraparte.

El importe de la garantía concedida por SRT a 31 de marzo de 2022 es la siguiente:

Nombre de la Cartera	Tipo de garantía	Contraparte	Divisa de garantía	Importe de garantía	% de garantías mantenidas a final de año por categoría
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Efectivo	Bank of America Merrill Lynch	USD	140.000	0,57
		UBS	USD	310.000	1,25
		Total	USD	450.000	1,82
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Efectivo	Goldman Sachs	EUR	90.000	0,07
		Total	EUR	90.000	0,07
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Efectivo	UBS	USD	870.000	0,69
		Total	USD	870.000	0,69

Rendimiento/Costes

El rendimiento y los costes operativos de SRT a 31 de marzo de 2022 se muestran en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto de la Cartera correspondiente bajo los títulos «Gastos por intereses en swaps», «Ganancia/(Pérdida) neta realizada en swaps» y «Cambio en la ganancia/(pérdida) neta no realizada en swaps».

Reglamento sobre divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (SFDR) (sin auditar)

Políticas y objetivos de inversión

Threadneedle (Lux) – American Smaller Companies

La Cartera American Smaller Companies busca alcanzar una revalorización del capital invirtiendo principalmente en acciones emitidas por Empresas Estadounidenses Más Pequeñas domiciliadas o con operaciones significativas en Estados Unidos.

La Cartera podrá utilizar instrumentos financieros derivados con fines de cobertura.

La Cartera se gestiona activamente en referencia al Russell 2500 Index. El índice es ampliamente representativo de las empresas en las que invierte la Cartera, y proporciona un índice de referencia objetivo adecuado con el que se medirá y evaluará el rendimiento de la Cartera a lo largo del tiempo. La Cartera promueve características ambientales y sociales con el objetivo de obtener resultados mejores que los del índice durante periodos consecutivos de 12 meses, según la calificación de la materialidad ESG de Columbia Threadneedle expuesta más abajo. El índice no está diseñado para considerar específicamente las características ambientales o sociales. El Subasesor está facultado para seleccionar inversiones con ponderaciones diferentes a las del índice, y que no estén en el índice, y la Cartera puede mostrar una divergencia significativa con respecto al mismo. Las desviaciones con respecto al índice, incluidas las consideraciones sobre el nivel de riesgo en relación con el índice, se considerarán como parte del proceso de supervisión de riesgos del Subasesor para garantizar que el nivel general de riesgo sea en su mayoría coherente con el índice. De acuerdo con su estrategia de gestión activa, puede haber una desviación significativa del índice.

Threadneedle (Lux) – Asia Equities

La Cartera Asia Equities busca alcanzar una revalorización del capital invirtiendo principalmente en valores de renta variable de empresas domiciliadas en Asia (excluido Japón) o que desarrollen una parte significativa de sus actividades en esa región, incluyendo a través de resguardos de depósito de valores. La Cartera podrá invertir hasta el 40% de su Valor liquidativo en Acciones A de China a través del Programa Stock Connect de China-Hong Kong.

La Cartera podrá utilizar instrumentos financieros derivados con fines de cobertura.

La Cartera se gestiona activamente en referencia al MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index. El índice es ampliamente representativo de las empresas en las que invierte la Cartera, y proporciona un índice de referencia objetivo adecuado con el que se medirá y evaluará el rendimiento de la Cartera a lo largo del tiempo. La Cartera promueve características ambientales y sociales con el objetivo de obtener resultados mejores que los del índice durante periodos consecutivos de 12 meses, según la calificación de la materialidad ESG de Columbia Threadneedle expuesta más abajo. El índice no está diseñado para considerar específicamente las características ambientales o sociales. El Subasesor está facultado para seleccionar inversiones con ponderaciones diferentes a las del índice, y que no estén en el índice, y la Cartera puede mostrar una divergencia significativa con respecto al mismo.

Las desviaciones con respecto al índice, incluidas las consideraciones sobre el nivel de riesgo en relación con el índice, se considerarán como parte del proceso de supervisión de riesgos del Subasesor para garantizar que el nivel general de riesgo sea en su mayoría coherente con el índice. De acuerdo con su estrategia de gestión activa, puede haber una desviación significativa del índice.

Threadneedle (Lux) – European Select

La Cartera European Select busca alcanzar una revalorización del capital, invirtiendo principalmente en valores de renta variable de empresas domiciliadas o con operaciones significativas en Europa Continental, incluidas empresas de pequeño, mediano y gran tamaño.

La Cartera no estará particularmente especializada. El enfoque de inversión seleccionado permite a la Cartera tomar posiciones significativas en diferentes valores y sectores, lo que podría incrementar los niveles de volatilidad. La Cartera también podrá invertir en otros valores (incluidos valores de renta fija, otros valores de renta variable e Instrumentos del Mercado Monetario).

La Cartera se gestiona activamente en referencia al FTSE World Europe ex UK Index. El índice es ampliamente representativo de las empresas en las que invierte la Cartera, y proporciona un índice de referencia objetivo adecuado con el que se medirá y evaluará el rendimiento de la Cartera a lo largo del tiempo.

La Cartera promueve características ambientales y sociales con el objetivo de obtener resultados mejores que los del índice durante periodos consecutivos de 12 meses, según la calificación de la materialidad ESG de Columbia Threadneedle expuesta más abajo. El índice no está diseñado para considerar específicamente las características ambientales o sociales. El Subasesor está facultado para seleccionar inversiones con ponderaciones diferentes a las del índice, y que no estén en el índice, y la Cartera puede mostrar una divergencia significativa con respecto al mismo.

Las desviaciones con respecto al índice, incluidas las consideraciones sobre el nivel de riesgo en relación con el índice, se considerarán como parte del proceso de supervisión de riesgos del Subasesor para garantizar que el nivel general de riesgo sea en su mayoría coherente con el índice. De acuerdo con su estrategia de gestión activa, puede haber una desviación significativa del índice.

Threadneedle (Lux) – European Smaller Companies

La Cartera European Smaller Companies busca alcanzar una revalorización del capital invirtiendo principalmente en valores de renta variable de Empresas Europeas de Pequeña Capitalización (excluyendo las del Reino Unido). En el caso de esta Cartera, las Empresas Europeas de Pequeña Capitalización son aquellas que no formen parte, en el momento de comprarse sus valores, de las 225 mayores empresas del índice FTSE World Europe ex UK.

La Cartera podrá utilizar instrumentos financieros derivados con fines de cobertura.

La Cartera se gestiona activamente en referencia al EMIX Smaller European Companies Ex UK Index. El índice es ampliamente representativo de las empresas en las que invierte la Cartera, y proporciona un índice de referencia objetivo adecuado con el que se medirá y evaluará el rendimiento de la Cartera a lo largo del tiempo. La Cartera promueve características ambientales y sociales con el objetivo de obtener resultados mejores que los del índice durante periodos consecutivos de 12 meses, según la calificación de la materialidad ESG de Columbia Threadneedle expuesta más abajo. El índice no está diseñado para considerar específicamente las características ambientales o sociales. El Subasesor está facultado para seleccionar inversiones con ponderaciones diferentes a las del índice, y que no estén en el índice, y la Cartera puede mostrar una divergencia significativa con respecto al mismo.

Las desviaciones con respecto al índice, incluidas las consideraciones sobre el nivel de riesgo en relación con el índice, se considerarán como parte del proceso de supervisión de riesgos del Subasesor para garantizar que el nivel general de riesgo sea en su mayoría coherente con el índice. De acuerdo con su estrategia de gestión activa, puede haber una desviación significativa del índice.

Reglamento sobre divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (SFDR) (sin auditar)

(continuación)

Threadneedle (Lux) – Global Equity Income

La Cartera Global Equity Income busca alcanzar rendimientos con perspectivas de revalorización del capital. La Cartera invertirá principalmente en valores de renta variable mundiales. Los rendimientos revestirán la forma de repartos de dividendos.

La Cartera podrá utilizar instrumentos financieros derivados con fines de cobertura.

La Cartera se gestiona activamente en referencia al MSCI ACWI Index.

El índice es ampliamente representativo de las empresas en las que invierte la Cartera, y proporciona un índice de referencia objetivo adecuado con el que se medirá y evaluará el rendimiento de la Cartera a lo largo del tiempo. El Subasesor está facultado para seleccionar inversiones con ponderaciones diferentes a las del índice, y que no estén en el índice, y la Cartera puede mostrar una divergencia significativa con respecto al mismo. La Cartera promueve características ambientales y sociales con el objetivo de obtener resultados mejores que los del índice durante periodos consecutivos de 12 meses, según la calificación de la materialidad ESG de Columbia Threadneedle expuesta más abajo. El índice no está diseñado para considerar específicamente las características ambientales o sociales. El Subasesor está facultado para seleccionar inversiones con ponderaciones diferentes a las del índice, y que no estén en el índice, y la Cartera puede mostrar una divergencia significativa con respecto al mismo.

Las desviaciones con respecto al índice, incluidas las consideraciones sobre el nivel de riesgo en relación con el índice, se considerarán como parte del proceso de supervisión de riesgos del Subasesor para garantizar que el nivel general de riesgo sea en su mayoría coherente con el índice. De acuerdo con su estrategia de gestión activa, puede haber una desviación significativa con respecto al índice.

Threadneedle (Lux) – Global Focus

La Cartera Global Focus busca alcanzar una revalorización del capital, invirtiendo principalmente en una cartera concentrada de valores de renta variable de emisores empresariales que coticen, estén domiciliados o desarrollen una parte significativa de su actividad en países desarrollados y emergentes. La Cartera podrá invertir, de forma secundaria, en valores convertibles en valores de renta variable y/o en warrants.

La Cartera se gestiona activamente en referencia al MSCI ACWI Index.

El índice es ampliamente representativo de las empresas en las que invierte la Cartera, y proporciona un índice de referencia objetivo adecuado con el que se medirá y evaluará el rendimiento de la Cartera a lo largo del tiempo. La Cartera promueve características ambientales y sociales con el objetivo de obtener resultados mejores que los del índice durante periodos consecutivos de 12 meses, según la calificación de la materialidad ESG de Columbia Threadneedle expuesta más abajo. El índice no está diseñado para considerar específicamente las características ambientales o sociales. El Subasesor está facultado para seleccionar inversiones con ponderaciones diferentes a las del índice, y que no estén en el índice, y la Cartera puede mostrar una divergencia significativa con respecto al mismo.

Las desviaciones con respecto al índice, incluidas las consideraciones sobre el nivel de riesgo en relación con el índice, se considerarán como parte del proceso de supervisión de riesgos del Subasesor para garantizar que el nivel general de riesgo sea en su mayoría coherente con el índice. De acuerdo con su estrategia de gestión activa, puede haber una desviación significativa con respecto al índice.

Threadneedle (Lux) – Global Select

La Cartera Global Select busca alcanzar una revalorización del capital invirtiendo principalmente en valores de renta variable emitidos por empresas de todo el mundo. El enfoque de inversión "select" significa que la Cartera dispone de la flexibilidad para tomar posiciones sectoriales y en valores significativas, lo que puede traer consigo mayores niveles de volatilidad.

La Cartera podrá utilizar instrumentos financieros derivados con fines de cobertura. La Cartera se gestiona activamente en referencia al MSCI ACWI Index.

El índice es ampliamente representativo de las empresas en las que invierte la Cartera, y proporciona un índice de referencia objetivo adecuado con el que se medirá y evaluará el rendimiento de la Cartera a lo largo del tiempo. La Cartera promueve características ambientales y sociales con el objetivo de obtener resultados mejores que los del índice durante periodos consecutivos de 12 meses, según la calificación de la materialidad ESG de Columbia Threadneedle expuesta más abajo. El índice no está diseñado para considerar específicamente las características ambientales o sociales. El Subasesor está facultado para seleccionar inversiones con ponderaciones diferentes a las del índice, y que no estén en el índice, y la Cartera puede mostrar una divergencia significativa con respecto al mismo.

Las desviaciones con respecto al índice, incluidas las consideraciones sobre el nivel de riesgo en relación con el índice, se considerarán como parte del proceso de supervisión de riesgos del Subasesor para garantizar que el nivel general de riesgo sea en su mayoría coherente con el índice. De acuerdo con su estrategia de gestión activa, puede haber una desviación significativa del índice.

Threadneedle (Lux) – Global Smaller Companies

La Cartera Global Smaller Companies busca alcanzar una revalorización del capital, invirtiendo principalmente en valores de renta variable de empresas de pequeña capitalización de todo el mundo. La Cartera también podrá invertir en otros valores (incluidos valores de renta fija, otros valores de renta variable e Instrumentos del Mercado Monetario).

La Cartera se gestiona activamente en referencia al MSCI World Small Cap Index. El índice es ampliamente representativo de las empresas en las que invierte la Cartera, y proporciona un índice de referencia objetivo adecuado con el que se medirá y evaluará el rendimiento de la Cartera a lo largo del tiempo. La Cartera promueve características ambientales y sociales con el objetivo de obtener resultados mejores que los del índice durante periodos consecutivos de 12 meses, según la calificación de la materialidad ESG de Columbia Threadneedle expuesta más abajo. El índice no está diseñado para considerar específicamente las características ambientales o sociales. El Subasesor está facultado para seleccionar inversiones con ponderaciones diferentes a las del índice, y que no estén en el índice, y la Cartera puede mostrar una divergencia significativa con respecto al mismo.

Las desviaciones con respecto al índice, incluidas las consideraciones sobre el nivel de riesgo en relación con el índice, se considerarán como parte del proceso de supervisión de riesgos del Subasesor para garantizar que el nivel general de riesgo sea en su mayoría coherente con el índice. De acuerdo con su estrategia de gestión activa, puede haber una desviación significativa del índice.

Reglamento sobre divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (SFDR) (sin auditar)

(continuación)

Threadneedle (Lux) – Pan European Smaller Companies

La Cartera Pan European Smaller Companies alcanza una revalorización del capital invirtiendo principalmente en valores de renta variable emitidos por Empresas Europeas Más Pequeñas. El Subasesor mostrará preferencia normalmente por las inversiones en empresas de la parte más alta de la escala de capitalización bursátil de las empresas más pequeñas.

La Cartera podrá utilizar instrumentos financieros derivados con fines de cobertura. La Cartera se gestiona activamente en referencia al EMIX Smaller European Companies Index. El índice es ampliamente representativo de las empresas en las que invierte la Cartera, y proporciona un índice de referencia objetivo adecuado con el que se medirá y evaluará el rendimiento de la Cartera a lo largo del tiempo. La Cartera promueve características ambientales y sociales con el objetivo de obtener resultados mejores que los del índice durante periodos consecutivos de 12 meses, según la calificación de la materialidad ESG de Columbia Threadneedle expuesta más abajo. El índice no está diseñado para considerar específicamente las características ambientales o sociales. El Subasesor está facultado para seleccionar inversiones con ponderaciones diferentes a las del índice, y que no estén en el índice, y la Cartera puede mostrar una divergencia significativa con respecto al mismo.

Las desviaciones con respecto al índice, incluidas las consideraciones sobre el nivel de riesgo en relación con el índice, se considerarán como parte del proceso de supervisión de riesgos del Subasesor para garantizar que el nivel general de riesgo sea en su mayoría coherente con el índice. De acuerdo con su estrategia de gestión activa, puede haber una desviación significativa del índice.

Threadneedle (Lux) – European High Yield Bond

La Cartera European High Yield Bond busca alcanzar una rentabilidad total en forma tanto de rendimientos como de incrementos de capital invirtiendo principalmente en valores de renta fija denominados en euros o libras esterlinas con ratings de Categoría Especulativa.

La Cartera invertirá principalmente en valores de renta fija emitidos por empresas domiciliadas en Europa o con actividades significativas en Europa. La Cartera podrá invertir en CoCos (como máximo, un 10% del Valor liquidativo de la Cartera).

Normalmente, en caso de que los valores estén denominados en una moneda distinta del Euro, se pretende cubrir normalmente el riesgo de cambio en estos valores frente al Euro.

La Cartera podrá utilizar instrumentos financieros derivados al objeto de reducir riesgos o costes, es decir, cuando el uso de un instrumento financiero derivado sea adecuado desde un punto de vista económico.

La Cartera se gestiona activamente en referencia al ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained Index. El índice es ampliamente representativo de los valores en los que invierte la Cartera, y proporciona un índice de referencia objetivo adecuado con el que se medirá y evaluará el rendimiento de la Cartera a lo largo del tiempo. La Cartera promueve características ambientales y sociales con el objetivo de obtener resultados mejores que los del índice durante periodos consecutivos de 12 meses, según la calificación de la materialidad ESG de Columbia Threadneedle expuesta más abajo. El índice no está diseñado para considerar específicamente las características ambientales o sociales. El Subasesor está facultado para seleccionar inversiones con ponderaciones diferentes a las del índice, y que no estén en el índice, y la Cartera puede mostrar una divergencia significativa con respecto al mismo.

Las desviaciones con respecto al índice, incluidas las consideraciones sobre el nivel de riesgo en relación con el índice, se considerarán como parte del proceso de supervisión de riesgos del Subasesor para garantizar que el nivel general de riesgo sea en su mayoría coherente con el índice. De acuerdo con su estrategia de gestión activa, puede haber una desviación significativa del índice.

Threadneedle (Lux) – Pan European ESG Equities

La Cartera Pan European ESG Equities trata de conseguir la revalorización del capital mediante la inversión en empresas con características medioambientales, sociales y de gobernanza (ESG) sólidas o en situación de mejoría.

La Cartera se gestiona activamente e invierte principalmente en valores de renta variable de grandes empresas domiciliadas en Europa o con actividades significativas en Europa. La Cartera también podrá invertir en valores de renta variable de Empresas Europeas Más Pequeñas e Instrumentos del Mercado Monetario. La Cartera puede utilizar instrumentos financieros derivados a efectos de cobertura.

El Subasesor se centra en la selección de empresas con características ESG sólidas o en situación de mejoría, según se describe en las directrices de inversión ESG de la Cartera. Estas empresas demostrarán su liderazgo a través de prácticas medioambientales, sociales y de gobernanza sólidas. El Subasesor empleará medidas para comparar las características ESG de la Cartera con respecto al MSCI Europe Index. Asimismo, este índice proporciona un índice de referencia útil para comparar el rendimiento financiero. El MSCI Europe Index se ha elegido a estos efectos como una representación adecuada de grandes y medianas empresas de países de mercados desarrollados europeos (incluido el Reino Unido). Por lo tanto, el índice no está diseñado para considerar específicamente las características ambientales o sociales.

Las desviaciones con respecto al índice, incluidas las consideraciones sobre el nivel de riesgo en relación con el índice, se considerarán como parte del proceso de supervisión de riesgos del Subasesor para garantizar que el nivel general de riesgo sea en su mayoría coherente con el índice. De acuerdo con su estrategia de gestión activa, puede haber una desviación significativa del índice.

Con arreglo a sus Directrices de inversión ESG, la Cartera no invertirá en algunos sectores y empresas del índice.

El Valor liquidativo de la Cartera se expresará en euros y las decisiones de inversión se adoptarán atendiendo a la evolución de esta moneda.

Threadneedle (Lux) – Emerging Market ESG Equities

La Cartera Emerging Market ESG Equities trata de conseguir la revalorización del capital mediante la inversión en una cartera concentrada de empresas con características medioambientales, sociales y de gobernanza (ESG) sólidas o en situación de mejoría.

La Cartera se gestiona activamente e invierte principalmente en valores relacionados con renta variable de sociedades de Países de Mercados Emergentes. Estas se definen como sociedades domiciliadas en Países de Mercados Emergentes y/o que desarrollan allí sus principales actividades. La Cartera también podrá invertir en otros títulos, incluidos otros valores de renta variable, recibos de depósito e Instrumentos del Mercado Monetario.

La Cartera podrá invertir hasta el 30% de su Valor liquidativo en Acciones de Clase A de China a través del Programa China-Hong Kong Stock Connect.

Reglamento sobre divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (SFDR) (sin auditar)

(continuación)

La Cartera puede utilizar instrumentos financieros derivados a efectos de cobertura. El Subasesor se centra en la selección de empresas con características ESG sólidas o en situación de mejora, según se describe en las directrices de inversión ESG de la Cartera. Estas empresas demostrarán su liderazgo a través de prácticas medioambientales, sociales y de gobernanza sólidas.

El Subasesor empleará medidas para comparar las características ESG de la Cartera con respecto al MSCI Emerging Markets Index. Asimismo, este índice proporciona un índice de referencia útil para comparar el rendimiento financiero. El MSCI Emerging Markets Index se ha elegido a estos efectos como una representación adecuada de grandes y medianas empresas de Países de Mercados Emergentes. Por tanto, el índice no está diseñado para considerar específicamente las características ambientales o sociales.

Las desviaciones con respecto al índice, incluidas las consideraciones sobre el nivel de riesgo en relación con el índice, se considerarán como parte del proceso de supervisión de riesgos del Subasesor para garantizar que el nivel general de riesgo sea en su mayoría coherente con el índice. De acuerdo con su estrategia de gestión activa, puede haber una desviación significativa del índice.

Con arreglo a sus Directrices de inversión ESG, la Cartera no invertirá en algunos sectores y empresas del índice.

Threadneedle (Lux) – European Social Bond

La Cartera European Social Bond busca alcanzar una rentabilidad total en forma tanto de rendimientos como de incrementos del capital, invirtiendo en valores de deuda que se considere que respaldan o financian actividades socialmente beneficiosas y el desarrollo principalmente en Europa.

Para cumplir su objetivo, la Cartera invierte principalmente en toda clase de valores de deuda con ratings de Categoría de Inversión y emitidos por un ente público o un organismo supranacional, o una organización pública, privada o voluntaria y/o benéfica, a tipo fijo, flotante, variable o ligado a un índice o de cupón cero. Estos valores pueden incluir cédulas hipotecarias, bonos de agencias, bonos de titulización hipotecaria o de activos (sin que los bonos de titulización hipotecaria o de activos superasen el 10% del Valor liquidativo de la Cartera) y Bonos Convertibles Contingentes (sin que estos superasen el 10% del Valor liquidativo de la Cartera). El Subasesor seleccionará los valores de deuda calificados como inversiones sociales con arreglo a la Metodología de Calificación Social, tal como se describe más adelante.

De forma secundaria, la Cartera podrá mantener dinero en efectivo, activos asimilables a efectivo, Instrumentos del Mercado Monetario y otros valores de deuda.

No obstante lo que antecede, en circunstancias excepcionales, podrá oportunamente mantenerse un máximo del 10% del patrimonio neto de la Cartera en valores de deuda que no sean o ya no sean considerados calificables como inversiones sociales con arreglo a la Metodología de Calificación Social. Aun así, esos valores de deuda deberán cumplir, al menos, unas normas en materia medioambiental, social y de buen gobierno (ESG, por sus siglas en inglés) aceptables según evalúe el Subasesor. Estas engloban cualesquiera exposiciones significativas y más amplias a actividades empresariales que tengan los emisores, como a la producción de alcohol, tabaco, juegos de azar, ocio para adultos o armas polémicas, o a actividades que se considere que incumplen el Pacto Mundial de NU.

La Cartera no invertirá ni tendrá más del 10% de su patrimonio neto invertido en valores de deuda con ratings por debajo de Categoría de Inversión, siempre que dichos valores no tengan asignadas en el momento de la compra calificaciones de solvencia inferiores a "B" o cualquier otro rating equivalente de una NRSRO diferente. La Cartera se gestiona activamente en referencia al ICE BofA Euro Non-Sovereign Index (50%) y el ICE BofA Euro Corporate Euroland Issuers Index (50%). El índice es ampliamente representativo de los valores en los que invierte la Cartera, y proporciona un índice de referencia objetivo adecuado con el que se medirá y evaluará el rendimiento de la Cartera a lo largo del tiempo. Por lo tanto, el índice no está diseñado para considerar específicamente las características sociales. El Subasesor está facultado para seleccionar inversiones con ponderaciones diferentes a las del índice, y que no estén en el índice, y la Cartera puede mostrar una divergencia significativa con respecto al mismo.

Las desviaciones con respecto al índice, incluidas las consideraciones sobre el nivel de riesgo en relación con el índice, se considerarán como parte del proceso de supervisión de riesgos del Subasesor para garantizar que el nivel general de riesgo sea en su mayoría coherente con el índice. De acuerdo con su estrategia de gestión activa, puede haber una desviación significativa del índice.

Promoción de las características ambientales y sociales

Las siguientes Carteras son aquellas clasificadas que promueven características ambientales y sociales en virtud del artículo 8 del Reglamento de la UE 2019/2088 sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros («SFDR», por sus siglas en inglés).

- Threadneedle (Lux) – American Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Asia Equities
- Threadneedle (Lux) – European Select
- Threadneedle (Lux) – European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Global Equity Income
- Threadneedle (Lux) – Global Focus
- Threadneedle (Lux) – Global Select
- Threadneedle (Lux) – Global Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Pan European Smaller Companies

El Subasesor promueve las características ambientales y sociales mediante la integración de una serie de medidas de inversión responsable en el proceso de toma de decisiones de inversión.

En periodos de 12 meses consecutivos, la Cartera se compara favorablemente con su índice respectivo de acuerdo con la Calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle, un modelo propio que se basa en el marco de la organización Sustainability and Accounting Standards Board («SASB»). Este modelo identifica factores significativos ambientales, sociales y de gobernanza («ESG») en una amplia gama de sectores y proporciona una visión del enfoque de gestión y los estándares de las prácticas operativas de una empresa. El Subasesor considera que las empresas que gestionan los riesgos ESG de forma eficaz están mejor posicionadas para afrontar los retos futuros y aprovechar las oportunidades de negocio futuras conocidas y desconocidas. Las empresas que lideran las métricas ESG más importantes deberían estar bien posicionadas para lograr una ventaja competitiva y sustentar su futuro a largo plazo.

Reglamento sobre divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (SFDR) (sin auditar)

(continuación)

La Cartera también excluye a las empresas que incumplan los estándares y principios internacionales aceptados (por ejemplo, el Pacto Mundial de las Naciones Unidas). La Cartera podrá valorar las empresas en incumplimiento como aptas para la inversión si, en opinión del Subasesor, existen factores atenuantes tangibles para la sociedad que se va a mantener.

El Subasesor garantiza que al menos:

- el 90% de los valores de renta variable emitidos por grandes empresas domiciliadas en países desarrollados; y
- el 75% de los valores de renta variable emitidos por grandes empresas domiciliadas en Países de mercados emergentes o por pequeñas y medianas empresas de la Cartera están calificados con respecto a las medidas anteriores.

A los efectos de esta prueba, «pequeñas empresas» son aquellas con una capitalización bursátil inferior a 5.000 millones de euros, «medianas empresas» son aquellas con una capitalización de mercado de entre 5.000 y 10.000 millones de euros y «grandes empresas» son aquellas cuya capitalización de mercado supera los 10.000 millones de euros. Para apoyar y mejorar la promoción de las características ambientales y sociales, el Subasesor busca un compromiso proactivo con las empresas con el fin de influir en los equipos de gestión para mejorar sus prácticas, por ejemplo, en cuestiones relacionadas con las emisiones de carbono. Puede obtener más información sobre las directrices de inversión de la Cartera, incluida la metodología y la política de contratación de la Calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle en columbiathreadneedle.com.

- Threadneedle (Lux) – European High Yield Bond

El Subasesor promueve las características ambientales y sociales mediante la integración de una serie de medidas de inversión responsable en el proceso de toma de decisiones de inversión.

En periodos de 12 meses consecutivos, la Cartera se compara favorablemente con el ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained Index según la Calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle, un modelo propio que se basa en el marco de la organización Sustainability and Accounting Standards Board («SASB»). Este modelo identifica factores significativos ambientales, sociales y de gobernanza («ESG») en una amplia gama de sectores y proporciona una visión del enfoque de gestión y los estándares de las prácticas operativas de una empresa. El Subasesor considera que las empresas que gestionan los riesgos ESG de forma eficaz están mejor posicionadas para afrontar los retos futuros y aprovechar las oportunidades de negocio futuras conocidas y desconocidas. Las empresas que lideran las métricas ESG más importantes deberían estar bien posicionadas para lograr una ventaja competitiva y sustentar su futuro a largo plazo. La Cartera también excluye a las empresas que incumplan los estándares y principios internacionales aceptados (por ejemplo, el Pacto Mundial de las Naciones Unidas). La Cartera podrá valorar las empresas en incumplimiento como aptas para la inversión si, en opinión del Subasesor, existen factores atenuantes tangibles para la sociedad que se va a mantener.

El Subasesor se asegura de que al menos dos tercios de los valores de renta fija mantenidos por la Cartera tengan una calificación frente a las medidas anteriores.

Para apoyar y mejorar la promoción de las características ambientales y sociales, el Subasesor busca un compromiso proactivo con las empresas con el fin de influir en los equipos de gestión para mejorar sus prácticas, por ejemplo, en cuestiones relacionadas con las emisiones de carbono. Puede obtener más información sobre las directrices de inversión de la Cartera, incluida la metodología y la política de contratación de la Calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle en columbiathreadneedle.com.

Promoción de las características ambientales, sociales y de gobernanza

Las siguientes Carteras promueven las características ambientales, sociales y de gobernanza en virtud del artículo 8 del Reglamento de la UE 2019/2088 sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros («SFDR»).

- Threadneedle (Lux) – Pan European ESG Equities
- Threadneedle (Lux) – Emerging Market ESG Equities

Los criterios de inversión ambientales, sociales y de gobernanza («ESG») del Subasesor para la Cartera se establecen en sus Directrices de inversión ESG, que pueden modificarse oportunamente. Estas son específicas de la Cartera y están por encima de las prácticas éticas habituales del Subasesor. Las Directrices de inversión ESG de la Cartera están disponibles previa solicitud. Los componentes clave de las Directrices de inversión ESG son los siguientes:

1. Análisis de exclusión ESG, que excluye a las empresas que no puedan cumplir las Directrices de inversión ESG cada cierto tiempo. A modo de ejemplo, puede tratar de excluir a empresas en las que un elemento significativo de los ingresos empresariales se derive de actividades como la fabricación de armas controvertidas, tabaco, servicios de juego o empresas que incumplan los estándares y principios internacionales aceptados.

2. Las sociedades que no cumplan con este análisis de exclusión podrán calificarse como aptas para la inversión por la Cartera, si, en opinión del Subasesor, demuestran claramente la mejora de las características ESG. A modo de ejemplo, esto podrá incluir empresas que estén reduciendo activamente su cuota de ingresos empresariales derivados del tipo de actividades descritas anteriormente. El Subasesor aplica estos criterios de selección no financieros a al menos el 90% del patrimonio neto total de la Cartera, excluidos los activos líquidos accesorios, y utiliza métodos de medición como la calificación de inversión responsable y la selección de exclusión para garantizar que el perfil ESG de la Cartera supere al del índice.

Promoción de las características sociales

La siguiente Cartera promueve las características sociales en virtud del artículo 8 del Reglamento 2019/2088 de la UE sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros («SFDR»).

- Threadneedle (Lux) – European Social Bond

Reglamento sobre divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (SFDR) (sin auditar)

(continuación)

Descripción general de los procesos de inversión y evaluación

Proceso de inversión

El Subasesor selecciona los títulos de deuda basándose en el análisis de crédito y en la calificación social y la categorización producidas bajo la Metodología de calificación social. La Metodología de calificación social es un modelo de categorización y clasificación propio desarrollado por el Subasesor, que analiza las características sociales de cada inversión potencial. Según la metodología, cada inversión se analiza en un proceso de dos flujos que:

(i) evalúa la intensidad e intencionalidad social general asociadas al uso de los ingresos de un bono, para clasificarlo como una inversión de impacto, una inversión con impacto, como financiación del desarrollo o como financiación general;

(ii) aplica un modelo de evaluación de tres etapas que examina y puntúa nueve aspectos del enfoque y los resultados sociales atribuibles a un bono a través de campos de desarrollo social tales como vivienda asequible, salud y bienestar, educación, empleo, acceso a servicios y regeneración y desarrollo económicos, para obtener una puntuación numérica que, sujeta a un umbral «de minimis», produzca una calificación social de menor, moderada, buena o fuerte. Un bono cuya calificación esté por debajo del umbral «de minimis» está sujeto a revisión y a una nueva categorización como financiación general. A continuación, el Subasesor utiliza la categorización y las calificaciones para construir la Cartera.

El Subasesor aplica estos criterios de selección no financiera al menos al 90% del patrimonio neto total de la Cartera, excluyendo los activos líquidos auxiliares, y utiliza métodos de medición, como la calificación de inversión responsable y la detección de exclusión basada en resultados sociales, para garantizar que el perfil ESG de la Cartera y la exposición a temas de resultados sociales superen el del índice.

Proceso de evaluación e investigación

El Subasesor se ha asociado con INCO (<http://inco.co.com/>), una organización especializada en la inversión de impacto, para prestar asistencia en la evaluación y la elaboración de informes sobre los resultados sociales de la Cartera y para proporcionar investigación sobre las tendencias y prácticas relevantes para la inversión de impacto. Con ese fin, se ha establecido un Grupo Asesor Social (o «GAS»), integrado por 3 miembros designados por el Subasesor y 3 miembros designados por INCO, para que examine, asesore y supervise la aplicación y el desarrollo de la Metodología de calificación social, y para que revise asimismo los resultados sociales reales de las inversiones realizadas por el Subasesor.

El GAS está presidido por uno de los miembros designados por INCO. Un informe anual de rendimiento social, preparado por INCO y aprobado por el GAS, se encuentra a disposición de los inversores en el siguiente enlace: <https://www.columbiathreadneedle.lu>.

Medición de los objetivos de inversión ambientales y sociales

- Threadneedle (Lux) – American Smaller Companies

Gestionamos activamente la Cartera de acuerdo con el objetivo de promover características ambientales y/o sociales, conforme al artículo 8 del SFDR. En concreto, esto significa que gestionamos la Cartera con un sesgo activo hacia aquellas empresas que se considera que tienen excelentes credenciales ESG, acatamos todas las exclusiones pertinentes y llevamos a cabo una administración activa mediante el compromiso con las sociedades de la Cartera y la votación por delegación.

La integración de las consideraciones de IR (inversión responsable) en nuestro análisis fundamental de empresas desempeña un papel clave en la forma en que gestionamos la Cartera y vemos el universo de inversión de acciones, lo que nos proporciona una visión más completa de los riesgos, las oportunidades y las perspectivas futuras de las empresas en las que invertimos.

Utilizamos activamente nuestras oportunidades de voto delegado como una forma clave de interactuar con las sociedades de la cartera. En 2021, por ejemplo, votamos en más de 70 juntas sobre más de 500 acciones. Hemos votado el 100% de las acciones que se han sometido a voto, sin dejar de emitir un solo. Este asunto se ha mantenido en 2022: en el primer trimestre hemos votado de nuevo el 100% de las propuestas presentadas a los accionistas. Además, no votamos automáticamente con la dirección. Hemos estado dispuestos a votar en contra de las recomendaciones de la dirección o de los asesores si creíamos que se podían lograr mejores resultados a largo plazo al disentir. Por ejemplo, en el 29% de las juntas de accionistas de 2021, votamos al menos una moción en contra de la dirección.

Este análisis está respaldado por un conjunto de análisis de IR, lo que nos ayuda a identificar aquellas empresas que integran las consideraciones de IR en su modelo de negocio y demuestran una mejora en las métricas de IR. Cuando creemos que las empresas no están haciendo lo suficiente, nos implicamos con la dirección para entender los problemas y fomentar un cambio positivo. Cada vez más, vemos que nuestro papel consiste en guiar a los equipos de gestión hacia un mejor estándar en cuestiones de IR y divulgaciones relacionadas con la IR.

El resultado de este enfoque es que hemos ofrecido una Cartera que demuestra una inclinación positiva ESG, que ha evitado todas las empresas marcadas como controvertidas y que ha ofrecido tanto intensidad de carbono como huella de carbono menores que el índice de referencia.

- Threadneedle (Lux) – Asia Equities

Las consideraciones de IR se integran en nuestra investigación, lo que nos proporciona una visión más completa de los riesgos, las oportunidades y las perspectivas futuras de una empresa. Nuestro análisis está respaldado por un conjunto de análisis de IR, mientras que los compromisos dirigidos y la votación estratégica mejoran aún más la información de investigación y nos permiten impulsar un cambio positivo.

El equipo continúa trabajando con las empresas de la cartera para comprender mejor y fomentar las buenas prácticas ESG. A través de la votación por delegación en 2021, votamos en 80 juntas sobre más de 500 acciones. Hemos votado el 100% de las acciones que se han sometido a voto. Este asunto se ha mantenido en 2022: en el primer trimestre hemos votado de nuevo el 100% de las propuestas presentadas a los accionistas. Además, hemos estado dispuestos a votar en contra de la dirección para aclarar nuestras opiniones e influir de manera positiva en las prácticas de gestión.

El resultado de este enfoque es que contamos con una Cartera que demuestra una inclinación positiva ESG, que no tiene exposición a empresas controvertidas y que ha ofrecido tanto intensidad de carbono como puntuaciones de emisiones de carbono menores en comparación con el índice de referencia.

Reglamento sobre divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (SFDR) (sin auditar)

(continuación)

La siguiente medición se aplica a las Carteras indicadas a continuación:

- Threadneedle (Lux) – European Select
- Threadneedle (Lux) – European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Pan European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Pan European ESG Equities

Las consideraciones de IR se integran en nuestra investigación, lo que nos proporciona una visión más completa de los riesgos, las oportunidades y las perspectivas futuras de una empresa. Nuestro análisis está respaldado por un conjunto de análisis de IR, mientras que los compromisos dirigidos y la votación estratégica mejoran aún más la información de investigación y nos permiten impulsar un cambio positivo. El resultado de este enfoque disciplinado son las Carteras que han mantenido una calificación ESG mejor que su índice respectivo, una menor huella de carbono y ninguna exposición a empresas controvertidas.

Durante el periodo analizado, hemos seguido interactuando con las empresas que integran la Cartera para comprender y fomentar las buenas prácticas ESG. Hemos votado todas las acciones que poseemos y, en un número relevante de casos, hemos disentido, es decir, hemos votado en contra de la dirección para aclarar nuestras opiniones e influir con fuerza en las prácticas de gestión.

La siguiente medición se aplica a las Carteras indicadas a continuación:

- Threadneedle (Lux) – Global Focus
- Threadneedle (Lux) – Global Select
- Threadneedle (Lux) – Global Smaller Companies

Las consideraciones de IR se integran en nuestra investigación, lo que nos proporciona una visión más completa de los riesgos, las oportunidades y las perspectivas futuras de una empresa. Nuestro análisis está respaldado por un conjunto de análisis de IR mientras que los compromisos dirigidos y la votación estratégica mejoran aún más la información de investigación y nos permiten impulsar un cambio positivo. Para garantizar que promovemos las características ambientales y sociales, supervisamos la Calificación de materialidad ESG, la calificación ESG del MSCI y las emisiones de carbono en el plano de la Cartera y los valores. También colaboramos activamente con las empresas para supervisar el perfil ESG consolidado o en mejora de una empresa, con el apoyo de nuestro equipo de inversión responsable. El resultado de este enfoque disciplinado es una Cartera que ha mantenido una mejor calificación ESG que el índice, una menor huella de carbono y ninguna exposición a empresas controvertidas.

- Threadneedle (Lux) – Global Equity Income

Las consideraciones de IR se integran en nuestra investigación, lo que nos proporciona una visión más completa de los riesgos, las oportunidades y las perspectivas futuras de una empresa. Nuestro análisis está respaldado por un conjunto de análisis de IR mientras que los compromisos dirigidos y la votación estratégica mejoran aún más la información de investigación y nos permiten impulsar un cambio positivo. Para garantizar que promovemos las características ambientales y sociales, supervisamos la Calificación de materialidad ESG, la calificación ESG del MSCI y las emisiones de carbono en el plano de la Cartera y los valores. También colaboramos activamente con las empresas para supervisar el perfil ESG consolidado o en mejora de una empresa, con el apoyo de nuestro equipo de inversión responsable. El resultado de este enfoque disciplinado es una Cartera que ha mantenido una mejor calificación ESG que el índice y que no tiene exposición a empresas controvertidas.

- Threadneedle (Lux) – European High Yield Bond

Promovemos las características ambientales y sociales mediante la integración de una serie de medidas de inversión responsable en el proceso de toma de decisiones de inversión.

Los analistas de alto rendimiento evalúan y supervisan el enfoque y las prácticas ESG de las empresas utilizando una serie de fuentes y métricas como parte integral de su investigación y aprovechando la experiencia del equipo de IR cuando sea necesario. La evaluación ESG se presenta en notas de investigación para su consideración en las decisiones de inversión del equipo.

Los riesgos ESG se consideran en el ámbito de la Cartera utilizando la Calificación de materialidad ESG de CTI, un modelo propio que se basa en el marco de la organización Sustainability and Accounting Standards Board (SASB®). Este modelo identifica factores significativos ambientales, sociales y de gobernanza («ESG») en una amplia gama de sectores y proporciona una visión del enfoque de gestión y los estándares de las prácticas operativas de una empresa. En periodos de 12 meses consecutivos, esperamos que la Cartera se compare favorablemente con el índice de referencia en esta métrica.

Para apoyar y mejorar la promoción de las características ambientales y sociales, buscamos un compromiso proactivo con las empresas con el fin de influir en los equipos de gestión para mejorar sus prácticas, por ejemplo, en cuestiones relacionadas con las emisiones de carbono.

Al evaluar los estándares de práctica de una organización, utilizamos el análisis de empresas que infringen los estándares internacionales aceptados, como: el Pacto Mundial de las Naciones Unidas, la OIT, los Principios Rectores de las Naciones Unidas sobre las Empresas y los Derechos Humanos, las controversias graves y sistémicas (por ejemplo, en relación con los derechos humanos y laborales, el medio ambiente, el soborno, el fraude, la corrupción, la inexactitud financiera y las controversias de los consumidores).

El equipo de cumplimiento de mandatos realiza comprobaciones automáticas previas y posteriores a la negociación con una lista de exclusión de empresas que incumplen las normas internacionales aceptadas utilizando los datos de cribado de MSCI.

- Threadneedle (Lux) – Emerging Market ESG Equities

Creemos que un planteamiento basado en consideraciones ESG es fundamental para lograr una ventaja competitiva y sustentar el futuro a largo plazo de las empresas, lo que nos ayuda a identificar tanto los riesgos de invertir en una empresa como la posible oportunidad de rentabilidad. Nuestro análisis está respaldado por un conjunto de análisis de IR, mientras que los compromisos dirigidos y la votación estratégica mejoran aún más la información de investigación y nos permiten impulsar un cambio positivo.

Reglamento sobre divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (SFDR) (sin auditar)

(continuación)

El equipo continúa trabajando con las empresas de la cartera para comprender mejor y fomentar las buenas prácticas ESG. A través de la votación por delegación en 2021, votamos en 80 juntas sobre más de 500 acciones. Hemos votado el 100% de las acciones que se han sometido a voto. Este asunto se ha mantenido en 2022: en el primer trimestre hemos votado de nuevo el 100% de las propuestas presentadas a los accionistas. Además, hemos estado dispuestos a votar en contra de la dirección para aclarar nuestras opiniones e influir de manera positiva en las prácticas de gestión.

El resultado de este enfoque es que tenemos una Cartera que demuestra una inclinación positiva ESG, que ha evitado todas las empresas marcadas como controvertidas y que ha ofrecido tanto intensidad de carbono como puntuaciones de emisiones de carbono menores que el índice de referencia.

- Threadneedle (Lux) – European Social Bond

La Cartera se ha centrado en una jerarquía de siete áreas de resultados sociales que se utilizan para identificar el impacto. Todas las participaciones de la Cartera coinciden al menos con uno de estos resultados sociales y han tenido un rendimiento coherente desde el lanzamiento de la Cartera. Además, todos los bonos reciben una calificación social a través de una evaluación de su intencionalidad e intensidad sociales. La evaluación social también exige a los analistas que esbozen cualquier riesgo ESG o de reputación que pueda afectar a las credenciales sociales de la inversión y que consideren si merece incluirse en la Cartera. La revisión de estas evaluaciones la lleva a cabo el socio social independiente de la Cartera, que forma parte del Grupo Asesor Social que se encarga de revisar, asesorar y supervisar las inversiones de la Cartera desde una perspectiva social. El resultado de este enfoque disciplinado ha sido una rentabilidad de los bonos corporativos con grado de inversión junto con un impacto social, principalmente en Europa. Las participaciones de la Cartera se clasifican como inversiones de impacto, inversiones con impacto e inversiones financieras para el desarrollo en su búsqueda de resultados sociales. Además, se excluyen partes del índice cuando las empresas realizan actividades comerciales inadecuadas, como productos del tabaco, energía nuclear o fabricación de armas.

Reglamento sobre taxonomía de la UE

- Threadneedle (Lux) – American Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Asia Equities
- Threadneedle (Lux) – European Select
- Threadneedle (Lux) – European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Global Equity Income
- Threadneedle (Lux) – Global Focus
- Threadneedle (Lux) – Global Select
- Threadneedle (Lux) – Global Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Pan European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – European High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) – Pan European ESG Equities
- Threadneedle (Lux) – Emerging Market ESG Equities

El Reglamento (UE) 2020/852 relativo al establecimiento de un marco para facilitar las inversiones sostenibles (el «Reglamento sobre taxonomía de la UE») establece criterios para determinar si una actividad económica cumple los requisitos para considerarse sostenible desde el punto de vista ambiental a partir de seis objetivos ambientales.

Las siguientes Carteras promueven características ambientales y, por lo tanto, entran dentro del ámbito de aplicación del artículo 8 del Reglamento (UE) 2019/2088 sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros («SFDR»). Por lo tanto, las Carteras están obligadas, en virtud del Reglamento sobre taxonomía de la UE, a revelar cómo y en qué medida, las inversiones subyacentes al producto financiero se encuentran en actividades económicas que cumplen los requisitos para considerarse sostenibles desde el punto de vista ambiental.

En la actualidad, las inversiones subyacentes a las Carteras no tienen en cuenta los criterios de la UE para actividades económicas sostenibles desde el punto de vista ambiental.

Además, en virtud del Reglamento sobre taxonomía de la UE, el principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes a un producto financiero que tenga en cuenta los criterios de la UE para actividades económicas sostenibles desde el punto de vista ambiental. Como resultado de lo anterior, el principio de «no causar un perjuicio significativo» no se aplica a ninguna de las inversiones de las Carteras. Por lo tanto, las Carteras no entran actualmente dentro del ámbito de aplicación del Reglamento sobre taxonomía de la UE.

Threadneedle (Lux) – European Social Bond promueve características sociales y, por lo tanto, entra dentro del ámbito de aplicación del artículo 8 del Reglamento (UE) 2019/2088 sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros («SFDR»).

La divulgación que se realice en virtud del Reglamento sobre taxonomía de la UE no se aplicará a esta estrategia, ya que solo promueve características sociales.

- Threadneedle (Lux) – American
- Threadneedle (Lux) – American Absolute Alpha
- Threadneedle (Lux) – American Extended Alpha
- Threadneedle (Lux) – American Select
- Threadneedle (Lux) – Asia Contrarian Equity
- Threadneedle (Lux) – Asian Equity Income
- Threadneedle (Lux) – Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) – Emerging Market Corporate Bonds
- Threadneedle (Lux) – Emerging Market Debt
- Threadneedle (Lux) – Enhanced Commodities

Reglamento sobre divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (SFDR) (sin auditar)

(continuación)

- Threadneedle (Lux) – Euro Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) – European Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) – European Short-Term High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) – European Strategic Bond
- Threadneedle (Lux) – Flexible Asian Bond
- Threadneedle (Lux) – Global Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) – Global Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) – Global Emerging Market Equities
- Threadneedle (Lux) – Global Emerging Market Short-Term Bonds
- Threadneedle (Lux) – Global Extended Alpha
- Threadneedle (Lux) – Global Investment Grade Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) – Global Multi Asset Income
- Threadneedle (Lux) – Global Technology
- Threadneedle (Lux) – Pan European Absolute Alpha
- Threadneedle (Lux) – Pan European Equity Dividend
- Threadneedle (Lux) – Pan European Small Cap Opportunities
- Threadneedle (Lux) – UK Equities
- Threadneedle (Lux) – UK Equity Income
- Threadneedle (Lux) – US Contrarian Core Equities
- Threadneedle (Lux) – US Disciplined Core Equities
- Threadneedle (Lux) – US High Yield Bond

Todas las Carteras mencionadas anteriormente integran el riesgo de sostenibilidad y, por lo tanto, entran dentro del ámbito de aplicación del artículo 6 del Reglamento (UE) 2019/2088 sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros («SFDR»). En virtud del Reglamento sobre taxonomía de la UE, cada una de estas Carteras debe indicar que las inversiones subyacentes a la Cartera no tienen en cuenta los criterios de la UE para actividades económicas sostenibles desde el punto de vista ambiental.

Directorio

Domicilio social

31 Z.A. Bourmicht
L-8070 Bertrange
Gran Ducado de Luxemburgo

Asesor de inversiones

Threadneedle Management Luxembourg S.A.

Delegado a¹:

Columbia Management
Investment Advisers, LLC
290 Congress Street
Boston, MA 02110
Estados Unidos de América

Threadneedle Asset
Management Limited
Cannon Place
78 Cannon Street
Londres EC4N 6AG
Reino Unido

Sociedad Gestora

Threadneedle Management Luxembourg S.A.
44, rue de la Vallée
L-2661 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities²
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities²
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities
Threadneedle (Lux) - Global Technology

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond³
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond
Threadneedle (Lux) - European Social Bond
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds³
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt³
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds³
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond⁴
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income⁵
Threadneedle (Lux) - Global Focus
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income
Threadneedle (Lux) - Global Select
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies
Threadneedle (Lux) - American⁵
Threadneedle (Lux) - American Select⁵
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies⁵
Threadneedle (Lux) - Asia Equities⁴
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities⁵
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies
Threadneedle (Lux) - European Select
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income⁴
Threadneedle (Lux) - UK Equities
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha⁵
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

Directorio

(continuación)

Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited 3 Killiney Road #07-07 Winsland House 1 Singapur 239519 Singapur	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity ⁶
---	--

STANLIB Asset Management (Pty.) Limited 17 Melrose Boulevard Melrose Arch 2196 Johannesburgo Sudáfrica	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity ⁷
---	---

¹ Sujeto a la responsabilidad y supervisión de Threadneedle Management Luxembourg S.A.

² Threadneedle Asset Management Limited ofrece recomendaciones de inversión a Columbia Management Investment Advisers, LLC y, por lo tanto, proporciona asesoramiento de inversión respaldado por investigación a Columbia Management Investment Advisers, LLC.

³ Threadneedle Asset Management Limited podrá, sujeto a su propia responsabilidad, delegar la gestión de inversiones discrecionales de parte de los activos de la Cartera a Columbia Management Investment Advisers, LLC.

⁴ Threadneedle Asset Management Limited podrá, sujeto a su propia responsabilidad, delegar la gestión de inversiones discrecionales de parte de los activos de la Cartera a Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited.

⁵ Columbia Management Investment Advisers, LLC hace recomendaciones de inversión a Threadneedle Asset Management Limited y, por lo tanto, proporciona asesoramiento de inversión respaldado por investigación a Threadneedle Asset Management Limited.

⁶ Columbia Management Investment Advisers, LLC hace recomendaciones de inversión a Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited y, por lo tanto, proporciona asesoramiento de inversión respaldado por investigación a Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited.

⁷ Consulte la nota 1, página 236.

Directorio

(continuación)

Depositario, Agente domiciliario, administrativo y de pagos

Citibank Europe plc, Sucursal de Luxemburgo
31, Z.A. Bourmicht
L-8070 Bertrange
Gran Ducado de Luxemburgo

Secretario y Agente de transferencia

International Financial Data Services (Luxembourg) S.A.
47, Avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Distribuidor (delegado a una variedad de distribuidores)

Threadneedle Management Luxembourg S.A.
44, rue de la Vallée
L-2661 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Representantes y agentes de pagos

En Austria

Erste Bank der oesterreichischen Sparkassen AG
Graben 21
A-1010 Viena
Austria

En Bélgica

CACEIS Belgium S.A.
Avenue du Port 86 C b 320
B-1000 Bruselas
Bélgica

En Francia

CACEIS Bank France
1/3 Place Valhubert
F-75206 Paris Cedex 13
Francia

En Alemania

J.P. Morgan AG
Junghofstrasse 14
D-60311 Fráncfort del Meno
Alemania

En Hong Kong

HSBC Institutional Trust Services (Asia) Limited
17/F Tower 2 & 3 HSBC Centre
1 Sham Mong Road
Kowloon
Hong Kong

En Suiza

RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette
Sucursal de Zúrich
Bleicherweg 7
CH-8027 Zúrich
Suiza

Auditor

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

Asores legales en Luxemburgo

Linklaters LLP, Luxemburgo
35 Avenue John F. Kennedy, B.P. 1107
L-1011 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Para obtener más información, visite columbiathreadneedle.com



Publicado por Threadneedle Management Luxembourg S.A. Registrado en el Registro Mercantil (Luxemburgo), con el número B 110242, 44, rue de la Vallée, L-2661 Luxemburgo, Gran Ducado de Luxemburgo. En Reino Unido, publicado por Threadneedle Asset Management Limited (TAML). Registrado en Inglaterra y Gales, con el número de registro 573204, Cannon Place, 78 Cannon Street, Londres EC4N 6AG, Reino Unido. Autorizado y regulado en Reino Unido por la Autoridad de Conducta Financiera. Columbia Threadneedle Investments es el nombre comercial global del grupo de sociedades Columbia y Threadneedle. columbiathreadneedle.com 436727