

Threadneedle (Lux)

Informe provisional y estados financieros no auditados
Soci t  d'Investissement   Capital Variable
30 de septiembre de 2022

SICAV: un organismo luxemburgu s de inversi n colectiva en valores mobiliarios de conformidad con la Parte I de la Ley del 17 de diciembre de 2010, en su versi n modificada. Registro Mercantil de Luxemburgo n.  B-50.216

Contenidos

Información sobre la Sociedad	4	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	49
Estados financieros:		Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	50
Estados financieros agregados de Threadneedle (Lux)	5	Threadneedle (Lux) - European Select	52
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	6	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	54
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	8	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	55
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	10	Threadneedle (Lux) - Global Technology	56
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	12	Threadneedle (Lux) - UK Equities	57
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	13	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	59
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	15	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*	61
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	16	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	62
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	17	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	63
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	18	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	65
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	19	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	67
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	21	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	68
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	22	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	69
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	23	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	70
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	24	Estados de la Cartera	
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	26	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	72
Threadneedle (Lux) - Global Focus	27	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	80
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	29	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	86
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	30	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	94
Threadneedle (Lux) - Global Select	32	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	99
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	33	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	107
Threadneedle (Lux) - American	35	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	114
Threadneedle (Lux) - American Select	37	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	118
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	39	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	123
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	40	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	127
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	41	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	137
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	42	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	140
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	43	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	142
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	45	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	145
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	47		

Contenidos

(continuación)

Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	160	Notas a los estados financieros	219
Threadneedle (Lux) - Global Focus	162	Información para los accionistas	345
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	164	Información para inversores en Suiza	346
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	167	Reglamento de operaciones de financiación de valores	347
Threadneedle (Lux) - Global Select	169	Directorio	349
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	171		
Threadneedle (Lux) - American	173		
Threadneedle (Lux) - American Select	174		
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	175		
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	177		
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	179		
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	181		
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	183		
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	185		
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	187		
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	189		
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	191		
Threadneedle (Lux) - European Select	193		
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	194		
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	196		
Threadneedle (Lux) - Global Technology	198		
Threadneedle (Lux) - UK Equities	200		
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	201		
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	202		
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	203		
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	210		
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	214		
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	215		
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	216		
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	218		

* Consulte la nota 22.

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 provisional, 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 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

Claude Kremer
Consejero independiente no ejecutivo
Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Julie Griffiths
Directora Global de Riesgo de Inversión
Columbia Threadneedle Investments
Londres
Reino Unido

Annemarie Nicole Arens
Consejera independiente no ejecutiva
Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Joseph Patrick LaRocque
Consejero independiente no ejecutivo
Maryland
Estados Unidos de América

Thomas Seale
Consejero independiente no ejecutivo
Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Estados financieros agregados de Threadneedle (Lux)

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2, 18	14.122.139.659
Efectivo en el banco	2	194.512.978
Depósitos a plazo	2, 19	35.959.341
Por cobrar para la venta de inversiones		92.714.388
Suscripciones por cobrar		23.545.239
Interés por cobrar en swaps	2	5.651.792
Interés y dividendos por cobrar, neto		36.927.041
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	2.276.571
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	21.786.589
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	25.515.125
Otros activos		13.573.002
Total de activos		14.574.601.725
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(1.265.598)
Opciones vendidas al valor de mercado	2, 12	(26.262)
Pagadero por inversiones adquiridas		(77.081.288)
Reembolsos pagaderos		(112.291.126)
Interés pagadero en swaps	2	(1.897.888)
Dividendo pagadero en swaps	2	(163.476)
Pago por adelantado cobrado en swaps	2	(89.544)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(30.997.636)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(20.464.274)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(802.551)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(12.663.621)
Comisiones de rendimiento pagaderas	8	(13)
Impuesto por pagar	3	(277.816)
Otros pasivos	20	(9.423.004)
Total de pasivos		(267.444.097)
Total de patrimonio neto		14.307.157.628

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		20.624.583.517
Ingresos		
Dividendos, neto	2	122.966.761
Interés sobre bonos, neto	2	48.839.323
Interés bancario	2	918.656
Ingresos por intereses en swaps		6.095.799
Ingresos por intereses en contratos de futuros		71.276
Otros ingresos		1.171.927
Total de ingresos		180.063.742
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(83.656.058)
Comisiones de rendimiento	8	(13)
Interés bancario	2	(450.579)
Dividendos pagados en swaps		(1.191.304)
Gastos por intereses en swaps		(15.520.848)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(76.827)
Gastos operativos	3, 5	(15.842.975)
Comisiones varias	4	(1.983)
Total de gastos		(116.740.587)
Ingresos netos de inversiones		63.323.155
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(259.713.390)
Ganancia neta realizada en swaps		8.272.976
Ganancia neta realizada en opciones		138.015
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(113.083.594)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		60.929.718
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		162.821
Ganancia neta realizada en reembolso de impuestos		207
(Pérdida) neta realizada		(303.293.247)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(3.333.401.079)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		5.603.873
Cambio en la ganancia neta no realizada en opciones		721.887
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(51.431.731)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		1.297.635
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(3.377.209.415)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(3.617.179.507)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		2.399.195.268
Reembolsos de acciones		(3.633.450.440)
Dividendos	7	(18.955.681)
Total de movimientos de capital		(1.253.210.853)
Diferencias de cambio	2	(1.454.856.254)
Cambio en las inversiones cruzadas en las Carteras	18	7.820.725
Patrimonio neto al final del periodo		14.307.157.628

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	516.595.443
Efectivo en el banco	2	30.536.053
Por cobrar para la venta de inversiones		995.512
Suscripciones por cobrar		1.977.544
Interés por cobrar en swaps	2	121.652
Interés y dividendos por cobrar, neto		4.533.770
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	1.304.468
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	2.797.218
Otros activos		2.164.051
Total de activos		561.025.711
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(8.248.352)
Reembolsos pagaderos		(2.007.361)
Interés pagadero en swaps	2	(138.893)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(12.597.165)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(132.446)
Otros pasivos		(51.591)
Total de pasivos		(23.175.808)
Total de patrimonio neto		537.849.903

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	1.510.778,045
Clase AEH	1.041.738,203
Clase AKH	70,000
Clase ANH	788,000
Clase AU	954.103,141
Clase AUP	123.229,328
Clase DEC	94.347,251
Clase DEH	210.134,464
Clase DU	186.351,221
Clase DUP	61.335,235
Clase IEC	324.329,724
Clase IEH	1.497.259,270
Clase IEP	74,000
Clase IGC	616,000
Clase IGH	1.435.966,609
Clase IKH	80.378,000
Clase INH	785,000
Clase IU	151.236,244
Clase IUP	405.439,916
Clase NEC	199.831,610
Clase NEH	131.013,495
Clase NGC	27.587.623,352
Clase NGH	2.580.610,730
Clase NU	1.586.188,902
Clase NUP	87.925,000
Clase XEH	84,000
Clase XFH	92,000
Clase XGH	9.888.436,616
Clase XU	100,000
Clase ZEH	4.150.948,060
Clase ZFH	93,000
Clase ZGH	26.806,340
Clase ZU	577.683,689

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		512.857.786
Ingresos		
Dividendos, neto	2	125.164
Interés sobre bonos, neto	2	6.991.537
Interés bancario	2	56.470
Ingresos por intereses en swaps		1.394.926
Otros ingresos		10
Total de ingresos		8.568.107
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(768.046)
Interés bancario	2	(16.290)
Gastos por intereses en swaps		(1.582.474)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(65.454)
Gastos operativos	3, 5	(384.527)
Total de gastos		(2.816.791)
Ingresos netos de inversiones		5.751.316
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(25.849.901)
(Pérdida) neta realizada en swaps		(769.400)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(25.713.656)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		4.289.446
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		249.910
(Pérdida) neta realizada		(47.793.601)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(86.089.472)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		2.791.595
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(19.768.886)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		1.123.027
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(101.943.736)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(143.986.021)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		231.271.813
Reembolsos de acciones		(57.984.419)
Dividendos	7	(4.309.256)
Total de movimientos de capital		168.978.138
Patrimonio neto al final del periodo		537.849.903

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	537.849.903	512.857.786	505.611.566

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEC	8,4402 ¹	9,8883 ¹	10,7710 ¹
Clase AEH	9,8170 ¹	11,3032 ¹	12,0116 ¹
Clase AKH	98,8728 ²	113,5556 ²	120,4075 ²
Clase ANH	8,8506 ³	10,1321 ³	10,6766 ³
Clase AU	11,2887	12,8471	13,5238
Clase AUP	9,8021	11,3413	12,2255
Clase DEC	7,6407 ¹	8,9807 ¹	9,8546 ¹
Clase DEH	9,3241 ¹	10,7729 ¹	11,5352 ¹
Clase DU	9,7617	11,1512	11,8269
Clase DUP	8,6428	10,0429	10,9155
Clase IEC	8,3071 ¹	9,7281 ¹	10,5732 ¹
Clase IEH	10,0996 ¹	11,6146 ¹	12,3172 ¹
Clase IEP	10,9096 ¹	11,0997 ¹	11,3003 ¹
Clase IGC	8,6217 ⁴	10,0201 ⁴	10,8060 ⁴
Clase IGH	10,8697 ⁴	12,4075 ⁴	13,0594 ⁴
Clase IKH	101,7130 ²	116,6619 ²	123,3018 ²
Clase INH	8,9336 ³	10,2127 ³	10,7232 ³
Clase IU	11,6069	13,1938	13,8609
Clase IUP	9,1119	10,5391	11,3406
Clase NEC	8,3930 ¹	9,8160 ¹	10,6452 ¹
Clase NEH	9,1951 ¹	10,5687 ¹	11,1857 ¹
Clase NGC	8,4590 ⁴	9,8219 ⁴	10,5683 ⁴
Clase NGH	9,5984 ⁴	10,9467 ⁴	11,4987 ⁴
Clase NU	10,1142	11,4874	12,0441
Clase NUP	9,1987	10,6244	11,4076
Clase XEH	8,1294 ¹	9,3311 ¹	9,8476 ¹
Clase XFH	8,0922 ⁵	9,2943 ⁵	9,8342 ⁵
Clase XGH	9,4925 ⁴	10,8105 ⁴	11,3216 ⁴
Clase XU	8,3465	9,4664	9,8938
Clase ZEH	9,2662 ¹	10,6577 ¹	11,2951 ¹
Clase ZFH	8,0051 ⁵	9,2148 ⁵	9,8121 ⁵
Clase ZGH	10,8372 ⁴	12,3692 ⁴	13,0122 ⁴
Clase ZU	11,5881	13,1713	13,8304

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 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	92.850.205
Efectivo en el banco	2	717.923
Por cobrar para la venta de inversiones		773.248
Suscripciones por cobrar		102.132
Interés por cobrar en swaps	2	10.047
Interés y dividendos por cobrar, neto		712.326
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	242.331
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	427.927
Total de activos		95.836.139
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(831.059)
Reembolsos pagaderos		(28.903)
Interés pagadero en swaps	2	(14.697)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(131.779)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(26.528)
Otros pasivos		(77.286)
Total de pasivos		(1.110.252)
Total de patrimonio neto		94.725.887

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	96.047,592
Clase ANH	825,000
Clase IE	3.122.310,969
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	4.111,196
Clase ZFH	92,000
Clase 1E	5.944.350,103
Clase 1G	139.061,087
Clase 2E	2.144.289,301
Clase 2G	69,000
Clase 3G	474.996,770
Clase 4E	254.218,937
Clase 4G	3.182.976,410
Clase 8E	376.518,119
Clase 8G	118.420,207
Clase 9G	70,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		127.675.204
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	864.299
Interés bancario	2	484
Ingresos por intereses en swaps		60.522
Ingresos por intereses en contratos de futuros		679
Otros ingresos		10
Total de ingresos		925.994
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(173.143)
Interés bancario	2	(9.743)
Gastos por intereses en swaps		(155.801)
Gastos operativos	3, 5	(63.721)
Total de gastos		(402.408)
Ingresos netos de inversiones		
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(3.602.120)
(Pérdida) neta realizada en swaps		(86.982)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.271.699)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		1.654.912
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		40.910
(Pérdida) neta realizada		(3.264.979)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(9.691.152)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		597.178
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(51.856)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(346.166)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(9.491.996)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(12.233.389)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		7.157.716
Reembolsos de acciones		(27.873.638)
Dividendos	7	(6)
Total de movimientos de capital		(20.715.928)
Patrimonio neto al final del periodo		94.725.887

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	94.725.887	127.675.204	157.999.564

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	8,9875	10,1243	10,7975
Clase ANH	8,7832 ¹	9,8409 ¹	10,4217 ¹
Clase IE	9,1998	10,3374	10,9588
Clase IEP	8,1748	9,2711	–
Clase INH	8,9443 ¹	9,9943 ¹	10,5063 ¹
Clase XE	8,5348	9,5748	10,1073
Clase XFH	8,4872 ²	9,5292 ²	10,0938 ²
Clase XGH	8,6732 ³	9,6585 ³	10,1315 ³
Clase XUH	8,7196 ⁴	9,6777 ⁴	10,1441 ⁴
Clase ZE	9,1371	10,2805	10,9309
Clase ZFH	8,3925 ²	9,4512 ²	10,0801 ²
Clase 1E	1,2253	1,3811	1,4728
Clase 1G	0,9897 ³	1,0743 ³	1,1548 ³
Clase 2E	9,2094	10,3490	10,9688
Clase 2G	8,9818 ³	9,7243 ³	10,3939 ³
Clase 3G	1,1175 ³	1,2099 ³	1,2941 ³
Clase 4E	9,3228	10,4502	11,0208
Clase 4G	9,4202 ³	10,1679 ³	10,8094 ³
Clase 8E	1,5425	1,7338	1,8383
Clase 8G	1,3552 ³	1,4667 ³	1,5677 ³
Clase 9G	8,9595 ³	9,7021 ³	10,3783 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.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	332.077.822
Efectivo en el banco	2	199.090
Por cobrar para la venta de inversiones		6.643.908
Suscripciones por cobrar		238.863
Interés y dividendos por cobrar, neto		4.951.655
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	539.109
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	135.364
Otros activos		1.166
Total de activos		344.786.977
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(2.492.889)
Reembolsos pagaderos		(306.088)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(243.942)
Otros pasivos		(42.370)
Total de pasivos		(3.085.289)
Total de patrimonio neto		341.701.688

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	342,253
Clase AKH	81,000
Clase ANH	807,000
Clase IE	4.538.309,318
Clase IEP	5.883.133,696
Clase IKH	80,000
Clase INH	798,000
Clase XE	77,000
Clase ZE	39.985,677
Clase ZEP	132.379,000
Clase 1E	12.323.509,871
Clase 1EP	1.091.443,252
Clase 1G	258.703,143
Clase 1GP	3.919,100
Clase 1UT	179.082,702
Clase 2E	47.095,000
Clase 2EP	2.884,000
Clase 2FH	6.834,346
Clase 2G	68,000
Clase 2GP	75,000
Clase 3E	2.998.225,546
Clase 3EP	2.220.744,571
Clase 3FC	6.523,913
Clase 3FH	27.927,294
Clase 3G	782.600,372
Clase 3GP	79.004,497
Clase 4E	17.900,944
Clase 4G	65,000
Clase 8E	1.104.555,450
Clase 8EP	5.555.524,634
Clase 8FH	32.415,940
Clase 8G	9.694,366
Clase 8GP	5.021,867
Clase 9E	717.447,778
Clase 9EP	7.573,873
Clase 9FC	92,741
Clase 9FH	83,000
Clase 9G	67,000
Clase 9GP	75,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		437.563.292
Ingresos		
Dividendos, neto	2	16.235
Interés sobre bonos, neto	2	7.737.677
Interés bancario	2	6.639
Ingresos por intereses en contratos de futuros		701
Otros ingresos		333
Total de ingresos		7.761.585
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.615.253)
Interés bancario	2	(12.378)
Gastos operativos	3, 5	(308.676)
Total de gastos		(1.936.307)
Ingresos netos de inversiones		5.825.278
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(8.703.392)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		612.219
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		233.739
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		125.713
(Pérdida) neta realizada		(7.731.721)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(46.419.854)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(682.059)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		41.819
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(47.060.094)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(48.966.537)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		19.677.846
Reembolsos de acciones		(66.528.326)
Dividendos	7	(44.587)
Total de movimientos de capital		(46.895.067)
Patrimonio neto al final del periodo		341.701.688

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	341.701.688	437.563.292	601.800.632

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	9,4638	10,7825	11,2181
Clase AKH	88,7937 ¹	101,0117 ¹	104,9357 ¹
Clase ANH	9,0110 ²	10,2186 ²	10,5488 ²
Clase IE	9,5314	10,8198	11,1683
Clase IEP	8,2003	9,3088	9,9899
Clase IKH	90,7965 ¹	102,8317 ¹	105,8588 ¹
Clase INH	9,2121 ²	10,4003 ²	10,6479 ²
Clase XE	9,3257	10,5517	10,8140
Clase ZE	9,5074	10,7962	11,1495
Clase ZEP	8,1802	9,2891	9,9735
Clase 1E	9,3241	10,6162	11,0164
Clase 1EP	8,0213	9,1329	9,8573
Clase 1G	9,0942 ³	9,9707 ³	10,4297 ³
Clase 1GP	7,8465 ³	8,6028 ³	9,3569 ³
Clase 1UT	8,5319 ⁴	9,8080 ⁴	10,4752 ⁴
Clase 2E	9,5392	10,8306	11,1761
Clase 2EP	8,2354	9,3488	10,0267
Clase 2FH	9,4042 ⁵	10,6851 ⁵	11,0615 ⁵
Clase 2G	9,3004 ³	10,1723 ³	10,5872 ³
Clase 2GP	8,0399 ³	8,7869 ³	9,4995 ³
Clase 3E	9,5611	10,8528	11,1933
Clase 3EP	8,2878	9,4075	10,0878
Clase 3FC	8,1398 ⁵	9,2459 ⁵	9,9302 ⁵
Clase 3FH	9,4235 ⁵	10,7045 ⁵	11,0760 ⁵
Clase 3G	9,3247 ³	10,1921 ³	10,5964 ³
Clase 3GP	7,9840 ³	8,7267 ³	9,4331 ³
Clase 4E	9,8374	11,1273	11,3964
Clase 4G	9,8149 ³	10,6900 ³	11,0365 ³
Clase 8E	9,5233	10,8147	11,1642
Clase 8EP	8,2307	9,3469	10,0322
Clase 8FH	9,3877 ⁵	10,6685 ⁵	11,0486 ⁵
Clase 8G	9,2904 ³	10,1593 ³	10,5718 ³
Clase 8GP	8,0118 ³	8,7611 ³	9,4964 ³
Clase 9E	9,5746	10,8653	11,2018
Clase 9EP	8,3022	9,4214	10,0992
Clase 9FC	8,2167 ⁵	9,3284 ⁵	10,0032 ⁵
Clase 9FH	9,4492 ⁵	10,7239 ⁵	11,0918 ⁵
Clase 9G	9,3566 ³	10,2232 ³	10,6161 ³
Clase 9GP	8,0711 ³	8,8161 ³	9,5122 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 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	76.614.763
Efectivo en el banco	2	3.619.370
Por cobrar para la venta de inversiones		276.826
Interés y dividendos por cobrar, neto		955.771
Otros activos		188
Total de activos		81.466.918
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(100.000)
Reembolsos pagaderos		(30.652)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(450.617)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(7.349)
Otros pasivos		(6.866)
Total de pasivos		(595.484)
Total de patrimonio neto		80.871.434

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	3.463,195
Clase AEP	167,669
Clase AKH	82,000
Clase ANH	82,000
Clase IE	128.885,104
Clase IEP	98.273,000
Clase IGC	8,000
Clase IGH	7,000
Clase IKH	82,000
Clase INH	816,000
Clase XE	28.974,096
Clase XGC	73.468,728
Clase XGH	429.180,053
Clase ZE	8,200

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	95,4264	102,3925	103,3869
Clase AEP	86,4448	92,7591	97,3234
Clase AKH	96,0847 ¹	102,9071 ¹	103,6634 ¹
Clase ANH	98,0976 ²	104,6701 ²	104,8255 ²
Clase IE	96,6586	103,5067	104,0942
Clase IEP	87,5988	93,8051	97,9620
Clase IGC	89,9581 ³	95,6430 ³	99,1215 ³
Clase IGH	98,8163 ³	105,1039 ³	105,0674 ³
Clase IKH	96,7861 ¹	103,4243 ¹	103,8150 ¹
Clase INH	9,8336 ²	10,4750 ²	10,4542 ²
Clase XE	97,9089	104,6355	104,8093
Clase XGC	90,9119 ³	96,4461 ³	99,6631 ³
Clase XGH	100,2094 ³	106,2932 ³	105,8053 ³
Clase ZE	96,4451	103,3293	104,0037

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 contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		108.281.110
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	1.802.136
Interés bancario	2	2.895
Ingresos por intereses en swaps		13.875
Otros ingresos		6
Total de ingresos		1.818.912
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(37.203)
Interés bancario	2	(10.021)
Gastos operativos	3, 5	(46.523)
Total de gastos		(93.747)
Ingresos netos de inversiones		
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(1.326.611)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(854.209)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(61.363)
(Pérdida) neta realizada		(2.242.183)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(7.039.143)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(10.110)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(918.143)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(7.967.396)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		
		(8.484.414)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		14.072.072
Reembolsos de acciones		(32.997.334)
Total de movimientos de capital		(18.925.262)
Patrimonio neto al final del periodo		80.871.434

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	80.871.434	108.281.110	87.774.729

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	349.608.157
Efectivo en el banco	2	1.973.575
Por cobrar para la venta de inversiones		1.783.869
Suscripciones por cobrar		107.370
Interés y dividendos por cobrar, neto		2.292.762
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	1.944.472
Total de activos		357.710.205
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(1.984.660)
Reembolsos pagaderos		(544.168)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(743.211)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(91.123)
Otros pasivos		(37.045)
Total de pasivos		(3.400.207)
Total de patrimonio neto		354.309.998

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.573.315,461
Clase AEP	45.336,000
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	4.632.676,038
Clase IEP	2.724.436,149
Clase IFH	2.506.164,000
Clase IGH	73,000
Clase IKH	85,000
Clase INH	839,000
Clase ISC	100,000
Clase ISH	100,000
Clase IUC	72.211,804
Clase IUH	100,000
Clase LE	2.908.319,221
Clase NEP	103.598,884
Clase ZD	11.946.144,524
Clase ZE	4.411.040,428
Clase ZEP	581.208,140
Clase ZFH	3.489,000
Clase ZGC	4.910.548,192
Clase ZGH	763.651,332
Clase ZUH	1.505,141

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		397.016.310
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	2.382.384
Interés bancario	2	3.333
Ingresos por intereses en contratos de futuros		5.108
Otros ingresos		176
Total de ingresos		2.391.001
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(578.090)
Interés bancario	2	(14.464)
Gastos operativos	3, 5	(224.241)
Total de gastos		(816.795)
Ingresos netos de inversiones		1.574.206
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(7.892.185)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		478.637
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		3.269.781
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(641.566)
(Pérdida) neta realizada		(4.785.333)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(41.889.330)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(1.287.801)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		1.314.600
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(41.862.531)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(45.073.658)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		43.495.943
Reembolsos de acciones		(40.074.482)
Dividendos	7	(1.054.115)
Total de movimientos de capital		2.367.346
Patrimonio neto al final del periodo		354.309.998

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	354.309.998	397.016.310	329.896.379

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	8,2908	9,3388	9,9729
Clase AEP	8,0999	9,1831	9,9137
Clase AFH	8,2689 ¹	9,3172 ¹	9,9710 ¹
Clase AKH	83,3709 ²	93,6342 ²	99,5278 ²
Clase ANH	8,4409 ³	9,4392 ³	9,9762 ³
Clase ASC	8,2836 ⁴	9,3030 ⁴	9,9703 ⁴
Clase ASH	8,4428 ⁴	9,4156 ⁴	9,9784 ⁴
Clase AUC	8,3006 ⁵	9,3072 ⁵	9,9704 ⁵
Clase AUH	8,4584 ⁵	9,4257 ⁵	9,9792 ⁵
Clase ID	8,4029 ⁶	9,4617 ⁶	10,0874 ⁶
Clase IE	8,9619	10,0871	10,7559
Clase IEP	8,3579	9,4700	10,2088
Clase IFH	8,7028 ¹	9,8039 ¹	10,4909 ¹
Clase IGH	8,4314 ⁷	9,4189 ⁷	9,9775 ⁷
Clase IKH	84,4681 ²	94,8504 ²	100,7592 ²
Clase INH	8,6651 ³	9,6877 ³	10,2330 ³
Clase ISC	8,2928 ⁴	9,3048 ⁴	9,9703 ⁴
Clase ISH	8,4487 ⁴	9,4173 ⁴	9,9784 ⁴
Clase IUC	8,3055 ⁵	9,3112 ⁵	9,9711 ⁵
Clase IUH	8,4701 ⁵	9,4334 ⁵	9,9799 ⁵
Clase LE	8,9898	10,1185	10,7895
Clase NEP	842,4806	954,3554	1028,6742
Clase ZD	8,3884 ⁶	9,4477 ⁶	10,0776 ⁶
Clase ZE	8,9328	10,0568	10,7290
Clase ZEP	8,3132	9,4219	10,1616
Clase ZFH	8,6887 ¹	9,7912 ¹	10,4827 ¹
Clase ZGC	8,7021 ⁷	9,7886 ⁷	10,4934 ⁷
Clase ZGH	8,9615 ⁷	10,0164 ⁷	10,6218 ⁷
Clase ZUH	8,6824 ⁵	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 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	143.171.603
Efectivo en el banco	2	4.024.306
Suscripciones por cobrar		10.133
Interés por cobrar en swaps	2	69.908
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.761.632
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	1.326.242
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	1.034.457
Total de activos		151.398.281
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(130.117)
Reembolsos pagaderos		(808.719)
Interés pagadero en swaps	2	(106.129)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(388.822)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(115.512)
Otros pasivos		(22.054)
Total de pasivos		(1.571.353)
Total de patrimonio neto		149.826.928

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	2.189.060,696
Clase AEP	706.175,073
Clase AKH	81,000
Clase ANH	802,000
Clase AUH	1.916,000
Clase DE	950.980,011
Clase DEP	1.524.160,641
Clase DUH	87,000
Clase IE	1.570.670,648
Clase INH	792,000
Clase ZE	85,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	26,9956	30,0762	31,0867
Clase AEP	12,8246	14,5050	15,3978
Clase AKH	92,1626 ¹	102,4839 ¹	105,8567 ¹
Clase ANH	9,3983 ²	10,4094 ²	10,6864 ²
Clase AUH	10,3097 ³	11,3753 ³	11,6784 ³
Clase DE	25,0943	28,0352	29,1371
Clase DEP	9,5423	10,8231	11,5522
Clase DUH	10,0452 ³	11,1164 ³	11,4774 ³
Clase IE	27,5317	30,5812	31,4196
Clase INH	9,6092 ²	10,6102 ²	10,8071 ²
Clase ZE	8,7091	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.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		186.513.439
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	2.827.240
Interés bancario	2	16.330
Ingresos por intereses en swaps		274.189
Otros ingresos		26
Total de ingresos		3.117.785
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(765.492)
Interés bancario	2	(23.388)
Gastos por intereses en swaps		(948.343)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(1.291)
Gastos operativos	3, 5	(175.336)
Total de gastos		(1.913.850)
Ingresos netos de inversiones		1.203.935
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(3.924.165)
(Pérdida) neta realizada en swaps		(208.790)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(3.173.752)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		6.650.108
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(284.659)
(Pérdida) neta realizada		(941.258)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(19.473.971)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		3.251.011
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		417.752
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(2.491.459)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(18.296.667)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(18.033.990)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		11.995.011
Reembolsos de acciones		(30.268.139)
Dividendos	7	(379.393)
Total de movimientos de capital		(18.652.521)
Patrimonio neto al final del periodo		149.826.928

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	149.826.928	186.513.439	234.144.701

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	32.540.613
Efectivo en el banco	2	1.198.058
Por cobrar para la venta de inversiones		368.842
Suscripciones por cobrar		21.771
Interés y dividendos por cobrar, neto		412.011
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	231.125
Otros activos		251
Total de activos		34.772.671
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(36.309)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(595.654)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(32.654)
Otros pasivos		(4.827)
Total de pasivos		(669.444)
Total de patrimonio neto		34.103.227

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	525.900,231
Clase AEH	244.361,548
Clase AKH	80,000
Clase ANH	792,000
Clase ASH	7.301,436
Clase AU	122.680,358
Clase AUP	685.632,852
Clase DEC	38.838,355
Clase DEH	125.861,207
Clase DU	191.591,262
Clase IEC	214.086,000
Clase IEH	412.721,740
Clase IU	2.093,260
Clase W	6.537,236
Clase WEH	7.298,489
Clase XUP	85,000
Clase ZU	100,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEC	9,9736 ¹	11,3376 ¹	12,9505 ¹
Clase AEH	18,4466 ¹	20,5319 ¹	22,5246 ¹
Clase AKH	87,2725 ²	96,8799 ²	105,9916 ²
Clase ANH	8,8883 ³	9,8352 ³	10,6943 ³
Clase ASH	12,4757 ⁴	13,7388 ⁴	14,9331 ⁴
Clase AU	19,9104	21,9017	23,7934
Clase AUP	6,5456	7,3555	8,3207
Clase DEC	7,2184 ¹	8,2123 ¹	9,3896 ¹
Clase DEH	14,1403 ¹	15,7465 ¹	17,2924 ¹
Clase DU	15,4923	17,0502	18,5415
Clase IEC	7,6144 ¹	8,6232 ¹	9,7778 ¹
Clase IEH	26,3133 ¹	29,1681 ¹	31,7423 ¹
Clase IU	10,2408	11,2198	12,0940
Clase W	27,3381	30,0194	32,4983
Clase WEH	18,1190 ¹	20,1302 ¹	22,0058 ¹
Clase XUP	9,3956	10,5075	11,7343
Clase ZU	8,3473	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.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		40.997.023
Ingresos		
Dividendos, neto	2	2.395
Interés sobre bonos, neto	2	899.563
Interés bancario	2	7.880
Ingresos por intereses en contratos de futuros		185
Total de ingresos		910.023
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(207.713)
Interés bancario	2	(138)
Gastos operativos	3, 5	(43.362)
Total de gastos		(251.213)
Ingresos netos de inversiones		
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(642.416)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(2.749.106)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		420.142
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		11.370
(Pérdida) neta realizada		(2.960.010)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(3.962.313)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(901.186)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		38.552
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(4.824.947)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		
		(7.126.147)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		3.042.338
Reembolsos de acciones		(2.557.909)
Dividendos	7	(252.078)
Total de movimientos de capital		232.351
Patrimonio neto al final del periodo		34.103.227

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	34.103.227	40.997.023	47.451.659

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	25.732.663
Efectivo en el banco	2	1.143.173
Suscripciones por cobrar		706
Interés y dividendos por cobrar, neto		385.234
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	1.973
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	44.391
Total de activos		27.308.140
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(39.538)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(32.013)
Otros pasivos		(4.735)
Total de pasivos		(76.286)
Total de patrimonio neto		27.231.854

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	48.098,151
Clase AEH	12.570,979
Clase AKH	82,000
Clase ANH	818,000
Clase ASH	2.362,302
Clase AU	47.983,356
Clase AUP	2.622.901,973
Clase DEH	10.133,563
Clase DU	20.448,378
Clase IEH	18.075,686
Clase IU	89,000
Clase SU	425,524
Clase SUP	44.347,049
Clase W	4.779,568
Clase XUP	89,000
Clase ZU	76,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEC	6,5435 ¹	8,0881 ¹	9,2177 ¹
Clase AEH	20,4825 ¹	24,6916 ¹	26,8384 ¹
Clase AKH	76,9750 ²	92,6360 ²	100,7566 ²
Clase ANH	7,8235 ³	9,3882 ³	10,1328 ³
Clase ASH	9,8373 ⁴	11,7200 ⁴	12,6134 ⁴
Clase AU	61,9683	73,6637	79,1694
Clase AUP	8,2416	10,0463	11,3182
Clase DEH	15,1998 ¹	18,3325 ¹	19,9465 ¹
Clase DU	44,0022	52,3331	56,3008
Clase IEH	22,6788 ¹	27,2289 ¹	29,3633 ¹
Clase IU	8,5798	10,1566	10,8581
Clase SU	24,8290	29,5378	31,7934
Clase SUP	7,9050	9,6466	10,8819
Clase W	51,8493	61,5266	65,8940
Clase XUP	8,1007	9,8204	10,9029
Clase ZU	10,0195	11,8658	12,6758

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 contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		35.175.906
Ingresos		
Dividendos, neto	2	8.456
Interés sobre bonos, neto	2	789.840
Interés bancario	2	4.814
Ingresos por intereses en contratos de futuros		56
Otros ingresos		1
Total de ingresos		803.167
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(208.808)
Interés bancario	2	(474)
Gastos operativos	3, 5	(41.456)
Total de gastos		(250.738)
Ingresos netos de inversiones		552.429
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(1.011.492)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(43.375)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		141.101
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(20.578)
(Pérdida) neta realizada		(934.344)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(5.159.215)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(25.232)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		3.603
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(5.180.844)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(5.562.759)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		95.376
Reembolsos de acciones		(1.850.858)
Dividendos	7	(625.811)
Total de movimientos de capital		(2.381.293)
Patrimonio neto al final del periodo		27.231.854

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	27.231.854	35.175.906	45.515.822

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

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	59.537.179
Efectivo en el banco	2	3.332.266
Por cobrar para la venta de inversiones		1.910.115
Suscripciones por cobrar		1.078
Interés y dividendos por cobrar, neto		865.987
Otros activos		338
Total de activos		65.646.963
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(606.920)
Reembolsos pagaderos		(127.955)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(629.263)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(1.586)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(39.079)
Otros pasivos		(7.940)
Total de pasivos		(1.412.743)
Total de patrimonio neto		64.234.220

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	2.552.510,346
Clase AEH	195.018,948
Clase AKH	85,000
Clase ANH	835,000
Clase ASC	526.281,577
Clase ASH	39.349,162
Clase AU	430.373,710
Clase AUP	1.362.017,269
Clase DEH	91.334,207
Clase DU	131.361,971
Clase IE	80.395,773
Clase IEH	689.446,683
Clase XU	2.086.029,492
Clase XUP	348.831,221
Clase ZEH	15.664,000
Clase ZU	100,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEC	4,0891 ¹	4,6270 ¹	5,3304 ¹
Clase AEH	12,6515 ¹	13,9674 ¹	15,3274 ¹
Clase AKH	83,1037 ²	91,6130 ²	100,3800 ²
Clase ANH	8,5127 ³	9,3476 ³	10,1668 ³
Clase ASC	5,6626 ⁴	6,3399 ⁴	7,2335 ⁴
Clase ASH	9,6374 ⁴	10,5249 ⁴	11,4387 ⁴
Clase AU	15,6813	17,1041	18,5735
Clase AUP	4,4349	4,9572	5,6508
Clase DEH	9,8347 ¹	10,8662 ¹	11,9416 ¹
Clase DU	12,1779	13,2928	14,4565
Clase IE	10,0654 ¹	9,6301 ¹	9,8260 ¹
Clase IEH	14,6098 ¹	16,0698 ¹	17,5011 ¹
Clase XU	9,8047	10,6176	11,3638
Clase XUP	7,8049	8,6646	9,7360
Clase ZEH	9,3743 ¹	10,3126 ¹	11,2373 ¹
Clase ZU	8,4537	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.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		91.108.424
Ingresos		
Dividendos, neto	2	8.065
Interés sobre bonos, neto	2	1.927.047
Interés bancario	2	10.563
Ingresos por intereses en contratos de futuros		131
Total de ingresos		1.945.806
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(257.375)
Interés bancario	2	(259)
Gastos operativos	3, 5	(75.802)
Total de gastos		(333.436)
Ingresos netos de inversiones		1.612.370
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(3.841.252)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(2.841.336)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(54.259)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(10.372)
(Pérdida) neta realizada		(6.747.219)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(4.524.216)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(963.447)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		60.177
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(5.427.486)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(10.562.335)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		3.467.113
Reembolsos de acciones		(19.255.826)
Dividendos	7	(523.156)
Total de movimientos de capital		(16.311.869)
Patrimonio neto al final del periodo		64.234.220

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	64.234.220	91.108.424	115.675.743

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	138.253.693
Efectivo en el banco	2	6.457.851
Suscripciones por cobrar		2.832.616
Interés y dividendos por cobrar, neto		2.311.384
Total de activos		149.855.544
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(714.190)
Reembolsos pagaderos		(14.526)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(1.431.859)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(72.635)
Otros pasivos		(41.260)
Total de pasivos		(2.274.470)
Total de patrimonio neto		147.581.074

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	14.751,557
Clase AEH	18.743,659
Clase AKH	80,000
Clase ANH	802,000
Clase ASH	37.487,591
Clase AU	97.244,940
Clase AUP	218.419,662
Clase DEC	21.240,834
Clase DEH	20.428,530
Clase DU	40.910,027
Clase IEC	92,000
Clase IEH	1.978.479,011
Clase IKH	79,000
Clase INH	789,000
Clase ISC	253.673,453
Clase IU	6.778.294,297
Clase TEH	4.879,061
Clase XUP	90,000
Clase ZFH	82,000
Clase ZGH	58,000
Clase ZU	817.604,051

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		176.111.653
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	4.361.704
Interés bancario	2	32.786
Total de ingresos		4.394.490
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(457.220)
Interés bancario	2	(288)
Gastos operativos	3, 5	(85.455)
Comisiones varias	4	(475)
Total de gastos		(543.438)
Ingresos netos de inversiones		3.851.052
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(2.760.480)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(6.951.550)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(4)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		93.695
(Pérdida) neta realizada		(9.618.339)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(18.087.935)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(2.225.258)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(20.313.193)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(26.080.480)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		17.442.831
Reembolsos de acciones		(19.772.861)
Dividendos	7	(120.069)
Total de movimientos de capital		(2.450.099)
Patrimonio neto al final del periodo		147.581.074

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	147.581.074	176.111.653	210.577.608

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEC	10,0119 ¹	11,6239 ¹	12,5108 ¹
Clase AEH	28,3361 ¹	32,0422 ¹	32,7344 ¹
Clase AKH	90,8126 ²	102,5833 ²	104,5429 ²
Clase ANH	9,1816 ³	10,3445 ³	10,4867 ³
Clase ASH	13,5175 ⁴	15,1131 ⁴	15,3006 ⁴
Clase AU	33,9711	37,8984	38,3288
Clase AUP	10,9630	12,5588	13,3803
Clase DEC	7,5373 ¹	8,7567 ¹	9,4471 ¹
Clase DEH	20,3514 ¹	23,0395 ¹	23,5798 ¹
Clase DU	24,3565	27,1995	27,5635
Clase IEC	7,4220 ¹	8,5796 ¹	9,1542 ¹
Clase IEH	28,5266 ¹	32,1076 ¹	32,5065 ¹
Clase IKH	93,3908 ²	104,9731 ²	105,9750 ²
Clase INH	9,4518 ³	10,5900 ³	10,6374 ³
Clase ISC	8,1993 ⁴	9,3701 ⁴	—
Clase IU	10,6741	11,8564	11,8836
Clase TEH	10,1828 ¹	11,4601 ¹	11,6033 ¹
Clase XUP	9,1808	10,4751	10,9963
Clase ZFH	9,6650 ⁵	10,8909 ⁵	11,0919 ⁵
Clase ZGH	10,8069 ⁶	12,0954 ⁶	12,2029 ⁶
Clase ZU	12,4232	13,8130	13,8794

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.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	37.399.604
Efectivo en el banco	2	2.278.706
Suscripciones por cobrar		9.564
Interés y dividendos por cobrar, neto		393.324
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	107.500
Otros activos		193
Total de activos		40.188.891
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(15.307)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(353.877)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(11.586)
Otros pasivos		(4.222)
Total de pasivos		(384.992)
Total de patrimonio neto		39.803.899

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	89.069,994
Clase AKH	82,000
Clase AS	852,619
Clase ASC	4.627,029
Clase ASH	41.550,134
Clase AU	103.634,774
Clase AUP	638.048,038
Clase AVC	100,000
Clase AVH	100,000
Clase DEH	63.826,361
Clase IEH	1.241.465,537
Clase IGH	54,000
Clase ISH	97,000
Clase IU	41.197,659
Clase XU	1.538.077,983
Clase ZU	42.070,000
Clase ZUP	92,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	9,8698 ¹	11,1546 ¹	11,9604 ¹
Clase AKH	85,4227 ²	96,2683 ²	102,8729 ²
Clase AS	10,4746 ³	11,0373 ³	11,6426 ³
Clase ASC	8,6340 ³	9,8517 ³	10,8641 ³
Clase ASH	11,0472 ³	12,3554 ³	13,1327 ³
Clase AU	11,3171	12,6431	13,4327
Clase AUP	9,0244	10,2865	11,3378
Clase AVC	8,1829 ⁴	9,3713 ⁴	10,3878 ⁴
Clase AVH	9,6941 ⁴	10,8855 ⁴	11,6150 ⁴
Clase DEH	9,5698 ¹	10,8323 ¹	11,6515 ¹
Clase IEH	10,3813 ¹	11,6988 ¹	12,4708 ¹
Clase IGH	11,1393 ⁵	12,4646 ⁵	13,1827 ⁵
Clase ISH	11,6737 ³	13,0166 ³	13,7420 ³
Clase IU	11,9280	13,2854	14,0310
Clase XU	11,3367	12,6016	13,2554
Clase ZU	11,9213	13,2836	14,0429
Clase ZUP	8,7179	9,9161	10,8803

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 contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		57.454.754
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	972.216
Interés bancario	2	12.630
Ingresos por intereses en contratos de futuros		84
Otros ingresos		1
Total de ingresos		984.931
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(76.919)
Interés bancario	2	(835)
Gastos operativos	3, 5	(37.556)
Total de gastos		(115.310)
Ingresos netos de inversiones		869.621
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(1.342.993)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.409.638)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		168.375
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(72.932)
(Pérdida) neta realizada		(2.657.188)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(5.129.255)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(529.168)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		41.443
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(5.616.980)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(7.404.547)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		2.569.046
Reembolsos de acciones		(12.686.398)
Dividendos	7	(128.956)
Total de movimientos de capital		(10.246.308)
Patrimonio neto al final del periodo		39.803.899

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	39.803.899	57.454.754	68.819.183

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	27.757.732
Efectivo en el banco	2	1.148.113
Depósitos a plazo	2, 19	4.240.325
Interés y dividendos por cobrar, neto		29.998
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	42.384
Otros activos		562
Total de activos		33.219.114
Pasivos		
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(530.478)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(15.464)
Otros pasivos		(5.611)
Total de pasivos		(551.553)
Total de patrimonio neto		32.667.561

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	20.831,737
Clase AEP	73,265
Clase DE	26.142,753
Clase IE	847.118,009
Clase IEP	71,925
Clase LE	2.168.343,267
Clase LEP	71,870
Clase ZE	71,748
Clase ZEP	72,538

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	10,2982	11,5219	11,3495
Clase AEP	10,1916	11,4169	11,2520
Clase DE	9,9611	11,1869	11,1024
Clase IE	10,6229	11,8436	11,5850
Clase IEP	10,5488	11,7510	11,4878
Clase LE	10,6948	11,9147	11,6371
Clase LEP	10,6231	11,8287	11,5394
Clase ZE	10,5248	11,7517	11,5196
Clase ZEP	10,4372	11,6583	11,4285

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		33.700.769
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	16.017
Interés bancario	2	1.194
Total de ingresos		17.211
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(94.212)
Interés bancario	2	(6.323)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(3.560)
Gastos operativos	3, 5	(34.002)
Total de gastos		(138.097)
(Pérdida) neta de inversiones		(120.886)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		333.585
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(65.265)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(102.028)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		16.951
Ganancia neta realizada		183.243
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(2.846.463)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		48.512
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(883.097)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(3.681.048)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(3.618.691)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		2.855.428
Reembolsos de acciones		(269.943)
Dividendos	7	(2)
Total de movimientos de capital		2.585.483
Patrimonio neto al final del periodo		32.667.561

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	32.667.561	33.700.769	31.879.013

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	31.009.501
Efectivo en el banco	2	1.883.792
Suscripciones por cobrar		849
Interés por cobrar en swaps	2	10.542
Interés y dividendos por cobrar, neto		65.930
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	1.565.424
Otros activos		10.192
Total de activos		34.546.230
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(13)
Reembolsos pagaderos		(51.046)
Interés pagadero en swaps	2	(6.409)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(218.671)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(121.100)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(40.476)
Otros pasivos		(8.424)
Total de pasivos		(446.139)
Total de patrimonio neto		34.100.091

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	62.412,866
Clase AEH	296.832,411
Clase AKH	74,000
Clase AU	318.351,332
Clase AUP	312.131,146
Clase DEH	96.703,498
Clase DU	180.212,866
Clase IEH	73,000
Clase IGH	12.133,135
Clase IU	164.640,985
Clase W	5.683,832
Clase ZU	100,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEC	11,2412 ¹	13,3778 ¹	14,0361 ¹
Clase AEH	23,4349 ¹	27,7017 ¹	28,7145 ¹
Clase AKH	91,6417 ²	108,2209 ²	112,0590 ²
Clase AU	36,1036	42,0736	43,1173
Clase AUP	13,3542	15,6687	16,2512
Clase DEH	16,7548 ¹	19,8712 ¹	20,7320 ¹
Clase DU	23,4329	27,3970	28,2598
Clase IEH	9,2724 ¹	10,9147 ¹	11,2478 ¹
Clase IGH	24,5503 ³	28,7174 ³	29,3439 ³
Clase IU	27,0529	31,4158	31,9704
Clase W	59,3627	69,2136	71,0014
Clase ZU	8,1559	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.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		44.823.256
Ingresos		
Dividendos, neto	2	152.545
Interés sobre bonos, neto	2	35.570
Interés bancario	2	11.862
Ingresos por intereses en swaps		110.840
Total de ingresos		310.817
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(268.017)
Interés bancario	2	(7.131)
Gastos por intereses en swaps		(32.936)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(6.620)
Gastos operativos	3, 5	(55.803)
Total de gastos		(370.507)
(Pérdida) neta de inversiones		(59.690)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		529.044
Ganancia neta realizada en swaps		37.388
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(2.030.797)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		528.333
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(40.008)
(Pérdida) neta realizada		(976.040)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(8.378.720)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(400.863)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(198.532)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		2.377.766
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(6.600.349)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(7.636.079)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		1.320.940
Reembolsos de acciones		(4.372.432)
Dividendos	7	(35.594)
Total de movimientos de capital		(3.087.086)
Patrimonio neto al final del periodo		34.100.091

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	34.100.091	44.823.256	58.030.727

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	96.069.816
Efectivo en el banco	2	5.571.496
Por cobrar para la venta de inversiones		696.878
Suscripciones por cobrar		19.577
Interés por cobrar en swaps	2	2.353
Interés y dividendos por cobrar, neto		686.773
Otros activos		117.920
Total de activos		103.164.813
Pasivos		
Opciones vendidas al valor de mercado	2, 12	(26.262)
Pagadero por inversiones adquiridas		(347.011)
Reembolsos pagaderos		(89.722)
Interés pagadero en swaps	2	(2.612)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(389.911)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(1.029)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(281.282)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(132.848)
Otros pasivos		(26.778)
Total de pasivos		(1.297.455)
Total de patrimonio neto		101.867.358

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	35.999,315
Clase AEC	4.157.464,712
Clase AEH	664.674,894
Clase AEP	1.989.936,952
Clase AS	100,000
Clase ASC	18.029,592
Clase ASH	639,122
Clase ASP	5.317,898
Clase AU	419.519,777
Clase AUM	40.835,903
Clase AUP	1.013.005,280
Clase DEC	2.475.824,371
Clase DEH	244.745,381
Clase DEP	279.641,348
Clase DU	355.393,298
Clase DUP	1.383.006,414
Clase ZE	73,000
Clase ZEC	93,000
Clase ZEH	17.855,390
Clase ZFH	85,000
Clase ZU	3.480,769
Clase ZUP	100,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD	
Patrimonio neto al inicio del periodo		142.600.557	
Ingresos			
Dividendos, neto	2	962.285	
Interés sobre bonos, neto	2	929.091	
Interés bancario	2	32.170	
Ingresos por intereses en swaps		37.325	
Ingresos por intereses en contratos de futuros		23.939	
Otros ingresos		30	
Total de ingresos		1.984.840	
Gastos			
Comisiones de gestión de activos	5	(909.404)	
Interés bancario	2	(3.115)	
Gastos por intereses en swaps		(40.137)	
Gastos operativos	3, 5	(182.181)	
Total de gastos		(1.134.837)	
Ingresos netos de inversiones		850.003	
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(3.445.792)	
Ganancia neta realizada en swaps		1.475	
Ganancia neta realizada en opciones		138.015	
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(631.535)	
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		16.369	
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(538.325)	
(Pérdida) neta realizada		(4.459.793)	
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(23.334.024)	
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		25.388	
Cambio en la ganancia neta no realizada en opciones		721.887	
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(1.236.271)	
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(957.843)	
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(24.780.863)	
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(28.390.653)	
Movimientos de capital			
Suscripciones de acciones		4.594.537	
Reembolsos de acciones		(15.227.645)	
Dividendos	7	(1.709.438)	
Total de movimientos de capital		(12.342.546)	
Patrimonio neto al final del periodo		101.867.358	
VALOR LIQUIDATIVO TOTAL			
	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	101.867.358	142.600.557	175.207.757

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	11,4850 ¹	11,8451 ¹	11,1664 ¹
Clase AEC	6,3947 ¹	7,7505 ¹	8,1761 ¹
Clase AEH	15,0832 ¹	17,9084 ¹	18,0258 ¹
Clase AEP	8,9374 ¹	9,4049 ¹	9,2989 ¹
Clase AS	10,1176 ²	11,1952 ²	11,0946 ²
Clase ASC	7,6163 ²	9,1249 ²	9,5406 ²
Clase ASH	9,4443 ²	11,0880 ²	11,0586 ²
Clase ASP	8,0989 ²	9,1289 ²	9,4660 ²
Clase AU	17,5261	20,5295	20,4434
Clase AUM	8,1290	9,7159	10,1632
Clase AUP	7,6939	9,1953	9,6048
Clase DEC	6,0183 ¹	7,3229 ¹	7,7834 ¹
Clase DEH	8,5548 ¹	10,1960 ¹	10,3401 ¹
Clase DEP	8,3429 ¹	8,8122 ¹	8,7797 ¹
Clase DU	10,7311	12,6175	12,6591
Clase DUP	6,9541	8,3429	8,7793
Clase ZE	11,7969 ¹	12,1429 ¹	11,3949 ¹
Clase ZEC	7,0958 ¹	8,5885 ¹	9,0180 ¹
Clase ZEH	9,1448 ¹	10,8301 ¹	10,8464 ¹
Clase ZFH	9,0044 ³	10,6752 ³	10,7251 ³
Clase ZU	10,2943	12,0281	11,9183
Clase ZUP	7,7604	9,2576	9,6307

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.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	4.447.498
Efectivo en el banco	2	181.152
Interés y dividendos por cobrar, neto		4.358
Total de activos		4.633.008
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(3.545)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(1.723)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(2.822)
Otros pasivos	20	(54.867)
Total de pasivos		(62.957)
Total de patrimonio neto		4.570.051

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	100,000
Clase AEC	100,000
Clase AEH	9.321,033
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

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	8,6092 ¹	10,1300 ¹	13,1238 ¹
Clase AEC	6,7622 ¹	9,3082 ¹	13,0744 ¹
Clase AEH	6,9375 ¹	9,4264 ¹	13,1208 ¹
Clase AU	7,2233	9,6534	13,2113
Clase AUP	7,0487	9,5286	13,1684
Clase IE	8,7767 ¹	10,2725 ¹	13,1851 ¹
Clase IEH	7,0749 ¹	9,5604 ¹	13,1794 ¹
Clase IG	8,4229 ²	9,4923 ²	12,2808 ²
Clase IU	7,3715	9,7979	13,2780
Clase LE	8,8330 ¹	10,3264 ¹	13,2092 ¹
Clase LG	8,4743 ²	9,5344 ²	12,2989 ²
Clase XU	7,4651	9,8914	13,3214
Clase ZE	8,7444 ¹	10,2464 ¹	13,1739 ¹
Clase ZEC	6,8633 ¹	9,4153 ¹	13,1241 ¹
Clase ZEH	7,0419 ¹	9,5353 ¹	13,1675 ¹
Clase ZU	7,3325	9,7613	13,2623
Clase ZUP	7,1538	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 contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		6.094.426
Ingresos		
Dividendos, neto	2	44.727
Interés bancario	2	971
Total de ingresos		45.698
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(18.517)
Gastos operativos	3, 5	(6.197)
Total de gastos		(24.714)
Ingresos netos de inversiones		20.984
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(268.495)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(9.290)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(1.212)
(Pérdida) neta realizada		(278.997)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(1.264.054)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(2.779)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(1.266.833)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(1.524.846)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		508
Reembolsos de acciones		(2)
Dividendos	7	(35)
Total de movimientos de capital		471
Patrimonio neto al final del periodo		4.570.051

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	4.570.051	6.094.426	9.412.889

Threadneedle (Lux) - Global Focus

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.687.711.439
Efectivo en el banco	2	8.144.017
Por cobrar para la venta de inversiones		4.288.393
Suscripciones por cobrar		2.967.689
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.303.613
Otros activos		669.566
Total de activos		1.705.084.717
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(9.770.873)
Reembolsos pagaderos		(17.581.426)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(3.501.473)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.660.118)
Otros pasivos		(228.679)
Total de pasivos		(32.742.569)
Total de patrimonio neto		1.672.342.148

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	1.448.354,867
Clase AEP	3.629.654,814
Clase ASH	7.444,855
Clase AU	6.981.717,551
Clase AUP	39.901,217
Clase DEH	606.400,872
Clase DU	1.443.410,422
Clase IE	6.688.192,964
Clase IEH	2.819.269,687
Clase IU	30.755.243,911
Clase IUP	50.758,004
Clase W	4.738,351
Clase XU	3.533.311,120
Clase ZE	3.847.347,023
Clase ZEH	186.453,736
Clase ZEP	3.618.503,576
Clase ZFH	75,000
Clase ZG	601.245,067
Clase ZU	1.089.280,653

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		2.405.094.415
Ingresos		
Dividendos, neto	2	10.096.568
Interés bancario	2	38.379
Otros ingresos		370
Total de ingresos		10.135.317
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(10.881.251)
Interés bancario	2	(4.606)
Gastos operativos	3, 5	(2.197.107)
Total de gastos		(13.082.964)
(Pérdida) neta de inversiones		(2.947.647)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(96.618.888)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(17.024.197)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		150.930
(Pérdida) neta realizada		(113.492.155)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(430.577.986)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(5.375.657)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(435.953.643)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(552.393.445)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		360.169.146
Reembolsos de acciones		(539.545.124)
Dividendos	7	(982.844)
Total de movimientos de capital		(180.358.822)
Patrimonio neto al final del periodo		1.672.342.148

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	1.672.342.148	2.405.094.415	1.676.310.766

Threadneedle (Lux) - Global Focus

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	45,6394 ¹	60,3566 ¹	57,4173 ¹
Clase AEP	18,5321 ¹	21,3430 ¹	19,1012 ¹
Clase ASH [#]	8,5282 ²	–	–
Clase AU	79,1834	102,8279	96,5311
Clase AUP	12,4753	16,3197	15,4283
Clase DEH	32,5825 ¹	43,2512 ¹	41,4515 ¹
Clase DU	40,6988	53,0512	50,1776
Clase IE	18,2604 ¹	20,7896 ¹	18,3198 ¹
Clase IEH	12,4479 ¹	16,3912 ¹	15,4630 ¹
Clase IU	16,3780	21,1779	19,7127
Clase IUP	12,9347	16,8469	15,7922
Clase W	121,0611	157,1578	147,4604
Clase XU	19,2438	24,7993	22,8996
Clase ZE	20,5613 ¹	23,4189 ¹	20,6574 ¹
Clase ZEH	8,9541 ¹	11,7932 ¹	11,1310 ¹
Clase ZEP	19,2950 ¹	22,1355 ¹	19,6580 ¹
Clase ZFH	8,9348 ³	11,7503 ³	11,1109 ³
Clase ZG	21,0770 ⁴	23,1166 ⁴	20,5546 ⁴
Clase ZU	19,8076	25,6233	23,8745

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.

[#] Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	288.228.464
Efectivo en el banco	2	15.804.343
Por cobrar para la venta de inversiones		10.706.029
Suscripciones por cobrar		1.877
Interés y dividendos por cobrar, neto		263.470
Otros activos		6.682
Total de activos		315.010.865
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(241.878)
Reembolsos pagaderos		(18.623.669)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(41.113)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(78.995)
Impuesto por pagar	3	(189.204)
Otros pasivos	20	(3.258.407)
Total de pasivos		(22.433.266)
Total de patrimonio neto		292.577.599

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	15.155,849
Clase AU	29.610,242
Clase DEH	45.458,037
Clase DU	64.680,797
Clase IE	13.585,133
Clase IEH	41.037,327
Clase IU	4.747.899,224
Clase XU	27.310.657,425
Clase ZU	138.296,669
Clase 1E	3.431.079,859
Clase 1U	2.194.811,720
Clase 2E	2.016.097,894
Clase 2U	53,000
Clase 8E	390,015
Clase 8U	1.604.460,143

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	22,194 ¹	29,845 ¹	42,380 ¹
Clase AU	37,025 ¹	48,981 ¹	68,393 ¹
Clase DEH	15,640 ¹	21,113 ¹	30,196 ¹
Clase DU	25,616 ¹	34,016 ¹	47,856 ¹
Clase IE	10,210 ¹	11,842 ¹	15,521 ¹
Clase IEH	13,537 ¹	18,119 ¹	25,502 ¹
Clase IU	8,932 ¹	11,766 ¹	16,289 ¹
Clase XU	7,813 ¹	10,251 ¹	-
Clase ZU	8,539 ¹	11,253 ¹	15,596 ¹
Clase 1E	1,223 ¹	1,424 ¹	1,881 ¹
Clase 1U	1,198 ¹	1,585 ¹	2,213 ¹
Clase 2E	11,279 ¹	13,094 ¹	17,188 ¹
Clase 2U	9,750 ¹	12,857 ¹	17,824 ¹
Clase 8E	1,348 ¹	1,565 ¹	2,055 ¹
Clase 8U	1,321 ¹	1,742 ¹	2,416 ¹

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 contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		134.106.881
Ingresos		
Dividendos, neto	2	2.057.859
Interés bancario	2	53.459
Otros ingresos		398.555
Total de ingresos		2.509.873
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(532.871)
Interés bancario	2	(4.862)
Gastos operativos	3, 5	(185.014)
Total de gastos		(722.747)
Ingresos netos de inversiones		1.787.126
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(16.641.963)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(207.361)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(72.424)
(Pérdida) neta realizada		(16.921.748)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(66.442.202)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(63.687)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(66.505.889)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(81.640.511)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		278.484.618
Reembolsos de acciones		(38.373.389)
Total de movimientos de capital		240.111.229
Patrimonio neto al final del periodo		292.577.599

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	292.577.599	134.106.881	170.104.097

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	142.927.219
Efectivo en el banco	2	1.127.760
Por cobrar para la venta de inversiones		3.910.124
Suscripciones por cobrar		102.922
Interés y dividendos por cobrar, neto		298.336
Otros activos		127.093
Total de activos		148.493.454
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(2.956.666)
Reembolsos pagaderos		(222.523)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(87.096)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(132.415)
Otros pasivos		(22.640)
Total de pasivos		(3.421.340)
Total de patrimonio neto		145.072.114

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	476.375,000
Clase TE	66,000
Clase ZU	75,000
Clase 1E	1.688.533,315
Clase 1EP	1.460.709,711
Clase 1SC	451.346,369
Clase 1SH	44.189,722
Clase 1ST	82.262,785
Clase 1U	325.831,812
Clase 1UP	406.800,920
Clase 1VT	8.886,124
Clase 2E	759.930,340
Clase 2EP	72,000
Clase 2U	75,000
Clase 2UP	82,000
Clase 3E	168.983,744
Clase 3EP	7.197.960,737
Clase 3U	17.230,767
Clase 3UP	20.163,373
Clase 8E	121.876,680
Clase 8EP	236,808
Clase 8U	13.233,578
Clase 8UP	57.981,704
Clase 9E	65,000
Clase 9EP	72,000
Clase 9U	74,000
Clase 9UP	82,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		215.918.713
Ingresos		
Dividendos, neto	2	2.590.129
Interés bancario	2	10.612
Otros ingresos		320
Total de ingresos		2.601.061
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(913.074)
Interés bancario	2	(814)
Gastos operativos	3, 5	(159.341)
Total de gastos		(1.073.229)
Ingresos netos de inversiones		1.527.832
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(1.244.141)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(148.616)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		32.429
(Pérdida) neta realizada		(1.360.328)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(39.351.346)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(133.354)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(39.484.700)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(39.317.196)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		8.559.256
Reembolsos de acciones		(37.917.811)
Dividendos	7	(2.170.848)
Total de movimientos de capital		(31.529.403)
Patrimonio neto al final del periodo		145.072.114

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	145.072.114	215.918.713	220.612.038

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEC	8,388 ¹	10,903 ¹	10,864 ¹
Clase AUP	9,1725	11,7207	11,5197
Clase DEC	8,2219 ¹	10,7205 ¹	10,7367 ¹
Clase DUP	8,9871	11,5104	11,3689
Clase IU	10,8144	13,5078	12,8194
Clase TE	12,5937 ¹	13,8508 ¹	12,4675 ¹
Clase ZU	10,7880	13,4839	12,8038
Clase 1E	12,3216 ¹	13,6005 ¹	12,3011 ¹
Clase 1EP	10,8056 ¹	12,1468 ¹	11,2887 ¹
Clase 1SC	8,9421 ²	11,4630 ²	11,2960 ²
Clase 1SH	10,2142 ²	12,8545 ²	12,3246 ²
Clase 1ST	8,9724 ²	11,4849 ²	11,3150 ²
Clase 1U	10,5360	13,2084	12,6191
Clase 1UP	9,2237	11,7772	11,5601
Clase 1VT	8,6223 ³	11,1290 ³	11,0336 ³
Clase 2E	12,8533 ¹	14,1440 ¹	12,7149 ¹
Clase 2EP	11,0864 ¹	12,4187 ¹	11,4725 ¹
Clase 2U	10,7900	13,4831	12,8080
Clase 2UP	9,4822	12,0644	11,7699
Clase 3E	12,6907 ¹	13,9552 ¹	12,5276 ¹
Clase 3EP	11,1271 ¹	12,4603 ¹	11,4904 ¹
Clase 3U	10,8515	13,5528	12,8514
Clase 3UP	9,5259	12,1163	11,8020
Clase 8E	12,5959 ¹	13,8635 ¹	12,4677 ¹
Clase 8EP	11,0247 ¹	12,3593 ¹	11,4170 ¹
Clase 8U	10,7734	13,4674	12,7934
Clase 8UP	9,4479	12,0275	11,7367
Clase 9E	12,7308 ¹	13,9945 ¹	12,5555 ¹
Clase 9EP	11,1677 ¹	12,4988 ¹	11,5171 ¹
Clase 9U	10,8997	13,6064	12,8935
Clase 9UP	9,5472	12,1372	11,8108

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 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	443.718.346
Efectivo en el banco	2	5.954.106
Por cobrar para la venta de inversiones		659.873
Suscripciones por cobrar		46.223
Interés y dividendos por cobrar, neto		446.852
Otros activos		237.670
Total de activos		451.063.070
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(7.670.699)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(517.426)
Otros pasivos		(62.993)
Total de pasivos		(8.251.118)
Total de patrimonio neto		442.811.952

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IU	60.653,811
Clase ZU	1.378,995
Clase 1E	21.840.783,557
Clase 1U	64.951.565,910
Clase 2E	53,000
Clase 2U	227.107,043
Clase 3U	9.272.667,540
Clase 8E	70.711,592
Clase 8U	20.907.499,480
Clase 9U	1.888.251,794

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase IU	11,9277	15,7040	15,4100
Clase ZU	11,8953	15,6678	15,3846
Clase 1E	3,3339 ¹	3,8796 ¹	3,6305 ¹
Clase 1U	3,2656	4,3160	4,2662
Clase 2E	13,8386 ¹	16,0460 ¹	14,9212 ¹
Clase 2U	11,8800	15,6533	15,3787
Clase 3U	3,4987	4,6059	4,5175
Clase 8E	4,9099 ¹	5,6972 ¹	5,3010 ¹
Clase 8U	4,8092	6,3379	6,2292
Clase 9U	11,9713	15,7566	15,4477

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 contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		609.163.562
Ingresos		
Dividendos, neto	2	3.062.417
Interés bancario	2	15.134
Otros ingresos		43
Total de ingresos		3.077.594
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(3.351.616)
Interés bancario	2	(864)
Gastos operativos	3, 5	(408.115)
Total de gastos		(3.760.595)
(Pérdida) neta de inversiones		(683.001)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		1.483.240
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		5.227
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(31.687)
Ganancia neta realizada		1.456.780
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(146.564.637)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(146.564.637)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(145.790.858)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		50.422.633
Reembolsos de acciones		(70.983.385)
Total de movimientos de capital		(20.560.752)
Patrimonio neto al final del periodo		442.811.952

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	442.811.952	609.163.562	605.915.496

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.530.670.471
Efectivo en el banco	2	2.220.248
Por cobrar para la venta de inversiones		568.109
Suscripciones por cobrar		1.698.959
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.310.467
Otros activos		308.189
Total de activos		1.536.776.443
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(721.638)
Reembolsos pagaderos		(7.919.216)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(81.913)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.539.662)
Otros pasivos		(354.320)
Total de pasivos		(10.616.749)
Total de patrimonio neto		1.526.159.694

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	14.823.530,897
Clase AEP	21.278.069,254
Clase AK	1.135.227,908
Clase AUP	69.666,394
Clase DE	1.678.319,172
Clase IE	5.823.148,398
Clase IEP	2.499.605,488
Clase NE	4.889.002,000
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	1.939.327,674
Clase ZFH	1.940.616,023
Clase ZG	1.315.123,182
Clase ZGH	70.015,147
Clase ZU	8.183.858,845

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		1.892.718.184
Ingresos		
Dividendos, neto	2	6.905.003
Interés bancario	2	18.842
Otros ingresos		1.372
Total de ingresos		6.925.217
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(9.802.773)
Interés bancario	2	(8.572)
Gastos operativos	3, 5	(2.258.468)
Total de gastos		(12.069.813)
(Pérdida) neta de inversiones		(5.144.596)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(67.053.947)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		1.689.261
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(103.384)
(Pérdida) neta realizada		(65.468.070)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(251.939.284)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(365.719)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(252.305.003)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(322.917.669)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		212.861.939
Reembolsos de acciones		(256.502.760)
Total de movimientos de capital		(43.640.821)
Patrimonio neto al final del periodo		1.526.159.694

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	1.526.159.694	1.892.718.184	2.108.588.124

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	37,6816	45,6690	47,2890
Clase AEP	12,3237	14,9359	15,5848
Clase AK	107,2541 ¹	123,9807 ¹	126,8311 ¹
Clase AUP	10,2507 ²	14,1101 ²	15,5516 ²
Clase DE	28,5202	34,6525	36,0617
Clase IE	55,2779	66,7097	68,4913
Clase IEP	10,5010	12,6727	13,1106
Clase NE	12,1607	14,6609	15,0223
Clase XE	14,1456	17,0020	17,3169
Clase XFH	9,3272 ³	11,2077 ³	11,4338 ³
Clase XG	14,1313 ⁴	16,3517 ⁴	16,7790 ⁴
Clase XGH	19,3397 ⁴	23,1206 ⁴	23,4350 ⁴
Clase XU	7,7480 ²	10,5772 ²	11,3797 ²
Clase ZE	13,5903	16,4090	16,8641
Clase ZFH	13,3729 ³	16,1495 ³	16,6452 ³
Clase ZG	13,5922 ⁴	15,8031 ⁴	16,3719 ⁴
Clase ZGH	39,7950 ⁴	47,7950 ⁴	48,9276 ⁴
Clase ZU	11,2887 ²	15,4806 ²	16,8058 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 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	959.938.729
Efectivo en el banco	2	5.410.394
Por cobrar para la venta de inversiones		2.327.498
Suscripciones por cobrar		761.512
Interés y dividendos por cobrar, neto		764.284
Total de activos		969.202.417
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(3.462.520)
Reembolsos pagaderos		(960.430)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(1.728.899)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(925.314)
Otros pasivos		(170.863)
Total de pasivos		(7.248.026)
Total de patrimonio neto		961.954.391

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	271.260,122
Clase AU	1.827.682,037
Clase DEH	45.459,082
Clase DU	598.820,774
Clase IEH	488.485,754
Clase IU	5.645.680,937
Clase W	1.598,035
Clase ZE	372.362,642
Clase ZEH	1.803.602,304
Clase ZU	60,000
Clase 1E	2.675.046,294
Clase 1EH	184.260,396
Clase 1EP	322.469,660
Clase 1U	12.255.197,498
Clase 2E	742.630,509
Clase 2U	5.344.917,775
Clase 3EH	45.378,315
Clase 3U	202.355,699
Clase 8E	435.682,553
Clase 8U	1.965.724,413
Clase 9EH	55,000
Clase 9U	337.915,350

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		1.241.417.577
Ingresos		
Dividendos, neto	2	5.547.239
Interés bancario	2	27.321
Total de ingresos		5.574.560
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(5.722.185)
Interés bancario	2	(923)
Gastos operativos	3, 5	(1.046.158)
Total de gastos		(6.769.266)
(Pérdida) neta de inversiones		(1.194.706)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		8.411.830
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(16.414.137)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		340.991
(Pérdida) neta realizada		(7.661.316)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(260.291.193)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(3.623.311)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(263.914.504)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(272.770.526)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		271.422.139
Reembolsos de acciones		(278.114.799)
Total de movimientos de capital		(6.692.660)
Patrimonio neto al final del periodo		961.954.391

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	961.954.391	1.241.417.577	1.120.251.631

Threadneedle (Lux) - American

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	52,9591 ¹	67,7231 ¹	62,4805 ¹
Clase AU	94,1072	118,2788	107,7058
Clase DEH	38,9599 ¹	49,9448 ¹	46,2355 ¹
Clase DU	36,4145	45,8481	41,8962
Clase IEH	57,8306 ¹	73,6686 ¹	67,3710 ¹
Clase IU	65,0867	81,4356	73,4915
Clase W	125,7747	157,8424	143,3024
Clase ZE	16,0847 ¹	17,7345 ¹	15,1672 ¹
Clase ZEH	12,2932 ¹	15,6669 ¹	14,3367 ¹
Clase ZU	13,6153	17,0528	15,4031
Clase 1E	15,3554 ¹	16,9814 ¹	14,6201 ¹
Clase 1EH	11,9036 ¹	15,2219 ¹	14,0242 ¹
Clase 1EP	14,5795 ¹	16,1234 ¹	14,0455 ¹
Clase 1U	12,9916	16,3179	14,8399
Clase 2E	15,7352 ¹	17,3483 ¹	14,8451 ¹
Clase 2U	13,3109	16,6678	15,0659
Clase 3EH	12,2798 ¹	15,6415 ¹	14,2960 ¹
Clase 3U	13,4061	16,7719	15,1327
Clase 8E	15,7087 ¹	17,3225 ¹	14,8290 ¹
Clase 8U	13,2858	16,6398	15,0466
Clase 9EH	12,3105 ¹	15,6785 ¹	14,3200 ¹
Clase 9U	13,4218	16,7881	15,1413

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 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	303.977.560
Efectivo en el banco	2	5.847.439
Por cobrar para la venta de inversiones		56.953
Suscripciones por cobrar		42.735
Interés y dividendos por cobrar, neto		359.246
Otros activos		702
Total de activos		310.284.635
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(391.368)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(36.447)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(403.644)
Otros pasivos		(46.608)
Total de pasivos		(878.067)
Total de patrimonio neto		309.406.568

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AD	405,000
Clase AEH	15.039,861
Clase AN	524,000
Clase AU	135.298,418
Clase DEH	16.092,452
Clase DU	99.274,793
Clase ID	399,000
Clase IE	54,000
Clase IEH	12.173,822
Clase IN	517,000
Clase W	4.870,367
Clase ZEH	53,000
Clase ZU	6.667,516
Clase 1E	13.329.882,672
Clase 1EH	76.563,804
Clase 1EP	378.890,049
Clase 1U	38.754.766,906
Clase 2EH	712,000
Clase 2U	1.619,818
Clase 3E	1.005.710,414
Clase 3U	857.300,803
Clase 8EH	4.562,812
Clase 8U	2.073.419,125
Clase 9E	50,000
Clase 9U	2.961,152

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		413.688.020
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.901.106
Interés bancario	2	101.474
Total de ingresos		2.002.580
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(2.622.711)
Interés bancario	2	(390)
Gastos operativos	3, 5	(303.066)
Total de gastos		(2.926.167)
(Pérdida) neta de inversiones		(923.587)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(15.850.705)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(209.122)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(93.470)
(Pérdida) neta realizada		(16.153.297)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(74.652.746)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(60.927)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(74.713.673)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(91.790.557)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		16.311.270
Reembolsos de acciones		(28.802.165)
Total de movimientos de capital		(12.490.895)
Patrimonio neto al final del periodo		309.406.568

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	309.406.568	413.688.020	438.535.319

Threadneedle (Lux) - American Select

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AD	14,1607 ¹	16,1001 ¹	14,0643 ¹
Clase AEH	32,9288 ²	43,2612 ²	40,4315 ²
Clase AN	15,7114 ³	16,2724 ³	14,6605 ³
Clase AU	30,9963	39,9888	36,9044
Clase DEH	22,2725 ²	29,3649 ²	27,6535 ²
Clase DU	27,0233	34,9947	32,5387
Clase ID	14,5372 ¹	16,4501 ¹	14,2588 ¹
Clase IE	14,5988 ²	16,5155 ²	14,3186 ²
Clase IEH	35,3635 ²	46,2659 ²	42,8992 ²
Clase IN	16,1128 ³	16,6107 ³	14,8493 ³
Clase W	32,8067	42,3137	39,0305
Clase ZEH	11,8945 ²	15,5785 ²	14,4664 ²
Clase ZU	13,1814	16,9458	15,5296
Clase 1E	5,4430 ²	6,1787 ²	5,3911 ²
Clase 1EH	3,4963 ²	4,5896 ²	4,2840 ²
Clase 1EP	5,2483 ²	5,9576 ²	5,2548 ²
Clase 1U	5,3321	6,8745	6,3360
Clase 2EH	12,3106 ²	16,1111 ²	14,9450 ²
Clase 2U	13,3841	17,2032	15,7585
Clase 3E	4,4848 ²	5,0705 ²	4,3890 ²
Clase 3U	4,3934	5,6415	5,1582
Clase 8EH	3,0904 ²	4,0452 ²	3,7559 ²
Clase 8U	6,1824	7,9480	7,2838
Clase 9E	15,6654 ²	17,7121 ²	15,3150 ²
Clase 9U	13,5140	17,3500	15,8570

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 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	248.529.252
Efectivo en el banco	2	3.841.984
Por cobrar para la venta de inversiones		1.926.223
Suscripciones por cobrar		95.624
Interés y dividendos por cobrar, neto		31.259
Otros activos		604
Total de activos		254.424.946
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(1.495.269)
Reembolsos pagaderos		(362.188)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(74.438)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(264.375)
Otros pasivos		(37.751)
Total de pasivos		(2.234.021)
Total de patrimonio neto		252.190.925

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	118.842,735
Clase ASH	135,000
Clase AU	82.336,497
Clase DEH	25.716,464
Clase DU	66.379,915
Clase IE	1.141.831,579
Clase IU	1.028.874,508
Clase ZU	8.531,509
Clase 1E	622.334,866
Clase 1EP	1.062.003,808
Clase 1U	6.483.293,615
Clase 2U	1.553.681,525
Clase 3EH	8.910,863
Clase 3U	1.093.466,934
Clase 8U	1.242.416,297
Clase 9EH	34.949,211
Clase 9U	2.885.788,783

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	12,7963 ¹	16,5581 ¹	16,6368 ¹
Clase ASH [#]	8,4701 ²	—	—
Clase AU	13,9927	17,7793	17,6124
Clase DEH	12,5447 ¹	16,2757 ¹	16,4357 ¹
Clase DU	13,7259	17,4841	17,4069
Clase IE	15,3508 ¹	17,1002 ¹	15,9009 ¹
Clase IU	14,4719	18,3099	17,9845
Clase ZU	14,4277	18,2631	17,9572
Clase 1E	16,4781 ¹	18,4235 ¹	17,2570 ¹
Clase 1EP	15,6292 ¹	17,4744 ¹	16,5639 ¹
Clase 1U	14,0720	17,8692	17,6803
Clase 2U	14,4146	18,2483	17,9455
Clase 3EH	13,2591 ¹	17,0721 ¹	17,0018 ¹
Clase 3U	14,4908	18,3319	18,0025
Clase 8U	14,3986	18,2318	17,9365
Clase 9EH	13,2920 ¹	17,1199 ¹	17,0449 ¹
Clase 9U	14,5183	18,3630	18,0258

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.[#] Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		336.365.358
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.590.475
Interés bancario	2	13.347
Total de ingresos		1.603.822
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.692.263)
Interés bancario	2	(462)
Gastos operativos	3, 5	(241.590)
Total de gastos		(1.934.315)
(Pérdida) neta de inversiones		(330.493)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(4.988.610)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.179.758)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(66.787)
(Pérdida) neta realizada		(6.235.155)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(65.620.223)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(232.464)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(65.852.687)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(72.418.335)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		33.425.866
Reembolsos de acciones		(45.181.964)
Total de movimientos de capital		(11.756.098)
Patrimonio neto al final del periodo		252.190.925

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	252.190.925	336.365.358	317.052.344

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	38.311.926
Efectivo en el banco	2	813.956
Por cobrar para la venta de inversiones		401.063
Interés y dividendos por cobrar, neto		61.564
Otros activos		1.576
Total de activos		39.590.085
Pasivos		
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(5.193)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.178)
Impuesto por pagar	3	(52.560)
Otros pasivos	20	(801.838)
Total de pasivos		(860.769)
Total de patrimonio neto		38.729.316

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.735,856
Clase AF	51,000
Clase AS	857,690
Clase ASH	31.363,742
Clase AU	11.410,792
Clase DE	25.240,683
Clase IF	49,000
Clase ISH	71,000
Clase IU	2.020,245
Clase XU	1.520.135,544
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

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	12,6457 ¹	15,4485 ¹	18,3066 ¹
Clase AF	11,2253 ²	14,5713 ²	18,6638 ²
Clase AS	8,7851 ³	11,4961 ³	14,2865 ³
Clase ASH	10,2316 ³	14,2590 ³	17,9279 ³
Clase AU	10,8113	15,0003	18,7762
Clase DE	11,9222 ¹	14,6194 ¹	17,4547 ¹
Clase IF	11,8847 ²	15,3389 ²	19,4667 ²
Clase ISH	10,9647 ³	15,2033 ³	18,9488 ³
Clase IU	11,5468	15,9526	19,7990
Clase XU	8,8433	12,1685	14,9820
Clase XUP	9,5959	13,4480	16,9577
Clase ZE	13,3181 ¹	16,2137 ¹	19,0713 ¹
Clase ZEH	9,8905 ¹	13,8883 ¹	17,5088 ¹
Clase ZF	11,8411 ²	15,3088 ²	19,4570 ²
Clase ZG	8,7442 ⁴	10,2500 ⁴	12,1521 ⁴
Clase ZU	11,4994	15,8950	19,7473

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 contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		95.614.006
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.028.131
Interés bancario	2	6.502
Otros ingresos	3	207.133
Total de ingresos		1.241.766
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(13.361)
Interés bancario	2	(574)
Gastos operativos	3, 5	(57.806)
Total de gastos		(71.741)
Ingresos netos de inversiones		1.170.025
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(2.212.483)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(11.553)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		47.870
(Pérdida) neta realizada		(2.176.166)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(18.830.573)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(8.354)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(18.838.927)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(19.845.068)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		10.497.711
Reembolsos de acciones		(47.064.181)
Dividendos	7	(473.152)
Total de movimientos de capital		(37.039.622)
Patrimonio neto al final del periodo		38.729.316

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	38.729.316	95.614.006	188.088.458

Threadneedle (Lux) - Asia Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	100.602.292
Efectivo en el banco	2	2.897.706
Por cobrar para la venta de inversiones		1.820.235
Suscripciones por cobrar		5.034
Interés y dividendos por cobrar, neto		99.274
Otros activos		11.376
Total de activos		105.435.917
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(637.441)
Reembolsos pagaderos		(64.422)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(25)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(117.288)
Impuesto por pagar	3	(36.052)
Otros pasivos	20	(1.990.720)
Total de pasivos		(2.845.948)
Total de patrimonio neto		102.589.969

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	83,000
Clase AEH	83,000
Clase DE	83,000
Clase DEH	83,000
Clase IE	494.506,636
Clase IU	127.417,800
Clase ZU	19.857,424
Clase 1E	1.456.206,475
Clase 1U	22.605.700,679
Clase 2E	55,000
Clase 2U	1.608.014,516
Clase 3U	4.530.252,421
Clase 8E	674,963
Clase 8U	1.667.879,236
Clase 9U	128.460,751

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	7,4813 ¹	8,9696 ¹	–
Clase AEH	5,8503 ¹	8,0913 ¹	–
Clase DE	7,4353 ¹	8,9361 ¹	–
Clase DEH	5,8146 ¹	8,0618 ¹	–
Clase IE	10,7336 ¹	12,8045 ¹	14,5096 ¹
Clase IU	9,8825	13,3897	16,0271
Clase ZU	9,8512	13,3540	16,0024
Clase 1E	2,6758 ¹	3,2041 ¹	3,6581 ¹
Clase 1U	2,6211	3,5648	4,2991
Clase 2E	11,4553 ¹	13,6717 ¹	15,5085 ¹
Clase 2U	9,8399	13,3414	15,9916
Clase 3U	2,3727	3,2148	3,8480
Clase 8E	3,0688 ¹	3,6646 ¹	4,1593 ¹
Clase 8U	3,0079	4,0790	4,8912
Clase 9U	9,9052	13,4178	16,0542

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 contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		142.380.978
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.749.931
Interés bancario	2	11.499
Otros ingresos	3	481.663
Total de ingresos		2.243.093
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(790.732)
Interés bancario	2	(102)
Gastos operativos	3, 5	(112.214)
Comisiones varias	4	(265)
Total de gastos		(903.313)
Ingresos netos de inversiones		1.339.780
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(6.105.324)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(8.311)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(24.808)
(Pérdida) neta realizada		(6.138.443)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(32.089.701)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(41)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(32.089.742)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(36.888.405)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		17.557.162
Reembolsos de acciones		(20.459.766)
Total de movimientos de capital		(2.902.604)
Patrimonio neto al final del periodo		102.589.969

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	102.589.969	142.380.978	343.930.526

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	232.889.000
Efectivo en el banco	2	7.897.231
Suscripciones por cobrar		5.362
Interés y dividendos por cobrar, neto		112.713
Otros activos		8
Total de activos		240.904.314
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(530.518)
Reembolsos pagaderos		(34.130)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(1.464.165)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(130.414)
Otros pasivos		(55.948)
Total de pasivos		(2.215.175)
Total de patrimonio neto		238.689.139

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	52,844
Clase AEH	22.890,234
Clase AU	76.133,094
Clase AUP	9.228,538
Clase DU	10.614,833
Clase IU	1.539.141,817
Clase XS	69,000
Clase XSH	5.242.486,638
Clase ZEH	283.911,706
Clase ZFH	48,000
Clase ZGH	35,000
Clase ZU	3.824.245,603

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEC	14,4020 ¹	18,8839 ¹	17,5161 ¹
Clase AEH	24,0430 ¹	31,2589 ¹	28,6186 ¹
Clase AU	45,1654	57,7098	52,1802
Clase AUP	16,2301	20,8998	19,1464
Clase DU	22,3730	28,6587	26,0427
Clase IU	65,6836	83,5904	74,9789
Clase XS	17,0963 ²	20,4221 ²	18,0154 ²
Clase XSH	16,2090 ²	20,6253 ²	18,3848 ²
Clase ZEH	15,7692 ¹	20,4263 ¹	18,5596 ¹
Clase ZFH	15,4378 ³	19,9729 ³	18,1775 ³
Clase ZGH	16,5317 ⁴	21,2839 ⁴	19,2281 ⁴
Clase ZU	18,2044	23,1731	20,7962

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 contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		379.069.017
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.405.661
Interés bancario	2	54.748
Total de ingresos		1.460.409
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(892.300)
Interés bancario	2	(1.047)
Gastos operativos	3, 5	(382.675)
Total de gastos		(1.276.022)
Ingresos netos de inversiones		184.387
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		20.419.606
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(3.250.018)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(527.123)
Ganancia neta realizada		16.642.465
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(92.447.323)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(2.528.439)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(94.975.762)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(78.148.910)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		29.995.833
Reembolsos de acciones		(92.225.606)
Dividendos	7	(1.195)
Total de movimientos de capital		(62.230.968)
Patrimonio neto al final del periodo		238.689.139

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	238.689.139	379.069.017	484.292.226

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	72.197.867
Efectivo en el banco	2	555.265
Por cobrar para la venta de inversiones		2.200.788
Suscripciones por cobrar		7.232.258
Interés y dividendos por cobrar, neto		43.326
Total de activos		82.229.504
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(2.193.679)
Reembolsos pagaderos		(189.481)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(587)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(6.660)
Otros pasivos		(71.488)
Total de pasivos		(2.461.895)
Total de patrimonio neto		79.767.609

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.819,435
Clase AEH	54,100
Clase AU	59,094
Clase AUP	63,640
Clase DE	15.413,775
Clase DEH	1.451,862
Clase DU	991,997
Clase IE	52,100
Clase IEC	58,100
Clase IEH	54,100
Clase IFH	59,100
Clase IG	17.732,109
Clase IU	57,576
Clase NE	15.147,650
Clase NG	5.301.260,336
Clase NU	99.771,866
Clase XG	59,000
Clase ZEH	54,100
Clase ZFH	60,100
Clase ZU	755,717

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		78.667.240
Ingresos		
Dividendos, neto	2	450.684
Interés bancario	2	1.317
Total de ingresos		452.001
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(38.353)
Gastos operativos	3, 5	(37.565)
Total de gastos		(75.918)
Ingresos netos de inversiones		376.083
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(1.273.985)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(35.354)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		96.506
(Pérdida) neta realizada		(1.212.833)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(16.120.220)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(8.843)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(16.129.063)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(16.965.813)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		38.636.948
Reembolsos de acciones		(20.570.751)
Dividendos	7	(15)
Total de movimientos de capital		18.066.182
Patrimonio neto al final del periodo		79.767.609

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	79.767.609	78.667.240	26.554.871

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	16,6818 ¹	18,2898 ¹	15,2404 ¹
Clase AEH	12,9959 ¹	16,4623 ¹	14,6709 ¹
Clase AU	14,6660	18,2540	16,0663
Clase AUP	13,2095	16,5908	14,8613
Clase DE	16,4987 ¹	18,1073 ¹	15,1186 ¹
Clase DEH	12,8658 ¹	16,3108 ¹	14,5633 ¹
Clase DU	14,5040	18,0794	15,9450
Clase IE	16,9603 ¹	18,5659 ¹	15,4165 ¹
Clase IEC	11,8743 ¹	15,1809 ¹	13,7286 ¹
Clase IEH	13,2106 ¹	16,7198 ¹	14,8479 ¹
Clase IFH	13,1037 ²	16,5489 ²	14,7157 ²
Clase IG	14,0464 ³	14,8037 ³	12,3891 ³
Clase IU	14,9340	18,5671	16,2814
Clase NE	13,6839 ¹	14,9581 ¹	12,3904 ¹
Clase NG	13,1508 ³	13,8493 ³	11,5750 ³
Clase NU	11,3400	14,0857	12,3331
Clase XG	13,2183 ³	13,9108 ³	11,6147 ³
Clase ZEH	13,1599 ¹	16,6597 ¹	14,8103 ¹
Clase ZFH	13,0275 ²	16,4549 ²	14,6448 ²
Clase ZU	14,8532	18,4729	16,2192

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 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	375.190.310
Efectivo en el banco	2	2.615.597
Por cobrar para la venta de inversiones		5.897.101
Suscripciones por cobrar		166.499
Interés y dividendos por cobrar, neto		271.242
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	40.737
Otros activos		699.058
Total de activos		384.880.544
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(6.650.820)
Reembolsos pagaderos		(731.631)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(234.921)
Otros pasivos		(39.656)
Total de pasivos		(7.657.028)
Total de patrimonio neto		377.223.516

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	147.037,797
Clase ASH	878.393,050
Clase AUH	4.638,883
Clase DE	152.558,042
Clase IE	2.788.887,550
Clase W	30.997,242
Clase XE	1.247.246,167
Clase ZE	448.249,522
Clase ZUH	2.325,637
Clase 1E	3.005.356,630
Clase 1EP	65,000
Clase 1G	162.173,809
Clase 1GP	59,000
Clase 2E	7.362.953,001
Clase 2G	472.877,889
Clase 2U	73,000
Clase 3E	31.534,362
Clase 3G	237.767,860
Clase 3GP	382,218
Clase 4E	416.408,472
Clase 4G	55,000
Clase 8E	243.596,975
Clase 8G	37.021,257
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 contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		475.145.184
Ingresos		
Dividendos, neto	2	8.896.427
Interés bancario	2	1.866
Otros ingresos		170
Total de ingresos		8.898.463
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.502.345)
Interés bancario	2	(10.407)
Gastos operativos	3, 5	(291.535)
Total de gastos		(1.804.287)
Ingresos netos de inversiones		7.094.176
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(2.760.827)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		545.740
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(75.058)
(Pérdida) neta realizada		(2.290.145)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(80.492.598)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		54.562
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(80.438.036)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(75.634.005)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		60.847.316
Reembolsos de acciones		(83.134.979)
Total de movimientos de capital		(22.287.663)
Patrimonio neto al final del periodo		377.223.516

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	377.223.516	475.145.184	386.572.137

Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	69,1965	83,5781	78,4220
Clase ASH	20,1503 ¹	24,0735 ¹	22,3960 ¹
Clase AUH	24,3114 ²	28,9294 ²	26,8262 ²
Clase DE	24,9090	30,1163	28,3149
Clase IE	49,3096	59,3341	55,2576
Clase W	57,9345	70,0340	65,8450
Clase XE	57,7864	69,2730	64,0957
Clase ZE	8,1583	9,8259	–
Clase ZUH	15,9664 ²	18,9486 ²	17,4726 ²
Clase 1E	11,0174	13,3070	12,4836
Clase 1EP	10,5075	12,6891	12,2262
Clase 1G	10,7457 ³	12,4978 ³	11,8186 ³
Clase 1GP	10,2538 ³	11,9244 ³	11,5799 ³
Clase 2E	11,2706	13,5821	12,6844
Clase 2G	10,9918 ³	12,7552 ³	12,0079 ³
Clase 2U	9,4693 ²	12,9544 ²	12,7712 ²
Clase 3E	11,3339	13,6488	12,7289
Clase 3G	11,0540 ³	12,8183 ³	12,0504 ³
Clase 3GP	10,5586 ³	12,2439 ³	11,8079 ³
Clase 4E	11,7403	14,0773	13,0161
Clase 4G	11,4688 ³	13,2403 ³	12,3357 ³
Clase 8E	11,2475	13,5570	12,6660
Clase 8G	10,9744 ³	12,7375 ³	11,9961 ³
Clase 8U	9,4495 ²	12,9310 ²	12,7491 ²
Clase 9E	11,3858	13,7069	12,7770
Clase 9G	11,0966 ³	12,8673 ³	12,0896 ³
Clase 9GP	10,6113 ³	12,3004 ³	11,8602 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.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	47.100.519
Efectivo en el banco	2	830.251
Por cobrar para la venta de inversiones		703.976
Suscripciones por cobrar		9.773
Interés y dividendos por cobrar, neto		33.231
Otros activos		266.376
Total de activos		48.944.126
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(1.149.143)
Reembolsos pagaderos		(9.467)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(38.609)
Otros pasivos		(6.934)
Total de pasivos		(1.204.153)
Total de patrimonio neto		47.739.973

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	550,646
Clase AEP	34.358,326
Clase AUP	80,000
Clase DE	3.669,213
Clase DEP	17.230,092
Clase IE	284.090,796
Clase IEP	860.036,000
Clase ZE	65,000
Clase ZEP	22.802,000
Clase 1E	3.628.010,132
Clase 1EP	10.613.927,366
Clase 1G	169.704,240
Clase 1GP	330.532,117
Clase 2E	974.334,004
Clase 2EP	72,000
Clase 2G	58,000
Clase 2GP	63,000
Clase 3EP	71.251,006
Clase 3G	43.316,653
Clase 3GP	608.470,116
Clase 4GP	5.181.531,118
Clase 8E	253.521,001
Clase 8EP	860.721,752
Clase 8G	47.778,661
Clase 8GP	474.371,238
Clase 9EP	71,000
Clase 9G	57,000
Clase 9GP	63,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		60.925.035
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.687.062
Interés bancario	2	311
Otros ingresos		87
Total de ingresos		1.687.460
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(254.601)
Interés bancario	2	(3.553)
Gastos operativos	3, 5	(41.477)
Total de gastos		(299.631)
Ingresos netos de inversiones		1.387.829
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(1.506.136)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		4.247
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(17.024)
Ganancia neta realizada en reembolso de impuestos		10
(Pérdida) neta realizada		(1.518.903)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(8.402.593)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(8.402.593)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(8.533.667)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		1.322.920
Reembolsos de acciones		(4.903.886)
Dividendos	7	(1.070.429)
Total de movimientos de capital		(4.651.395)
Patrimonio neto al final del periodo		47.739.973

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	47.739.973	60.925.035	72.471.914

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	10,4519	12,2899	12,2123
Clase AEP	8,8395	10,7997	11,1512
Clase AUP	7,8599 ¹	10,9127 ¹	11,9099 ¹
Clase DE	10,3020	12,1356	12,1020
Clase DEP	8,7072	10,6571	11,0429
Clase IE	10,8375	12,6707	12,4632
Clase IEP	9,1679	11,1344	11,3788
Clase ZE	10,7646	12,6183	12,4458
Clase ZEP	9,1016	11,0767	11,3507
Clase 1E	1,7069	2,0062	1,9917
Clase 1EP	0,8767	1,0714	1,1057
Clase 1G	1,4978 ²	1,6952 ²	1,6964 ²
Clase 1GP	0,7706 ²	0,9066 ²	0,9428 ²
Clase 2E	10,7528	12,5994	12,4322
Clase 2EP	9,1129	11,0904	11,3572
Clase 2G	10,7486 ²	12,1240 ²	12,0502 ²
Clase 2GP	9,0865 ²	10,6484 ²	10,9938 ²
Clase 3EP	1,4395	1,7509	1,7928
Clase 3G	1,4593 ²	1,6454 ²	1,6343 ²
Clase 3GP	1,2554 ²	1,4708 ²	1,5182 ²
Clase 4GP	1,1200 ²	1,3081 ²	1,3394 ²
Clase 8E	1,8927	2,2182	2,1897
Clase 8EP	0,9609	1,1693	1,1990
Clase 8G	1,6623 ²	1,8760 ²	1,8667 ²
Clase 8GP	0,8426 ²	0,9875 ²	1,0208 ²
Clase 9EP	9,1704	11,1480	11,4256
Clase 9G	10,7975 ²	12,1739 ²	12,0857 ²
Clase 9GP	9,1379 ²	10,6983 ²	11,0352 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 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	356.100.494
Efectivo en el banco	2	957.266
Por cobrar para la venta de inversiones		10.439.372
Suscripciones por cobrar		205.496
Interés y dividendos por cobrar, neto		322.081
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	25.839
Otros activos		639.685
Total de activos		368.690.233
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(7.247.773)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(456.121)
Otros pasivos		(126.580)
Total de pasivos		(7.830.474)
Total de patrimonio neto		360.859.759

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	5.505.675,589
Clase ASH	395.156,727
Clase AUH	14.092,289
Clase DE	1.154.312,229
Clase DUH	1.177,000
Clase IE	1.720.714,796
Clase W	9.912,171
Clase XE	88,000
Clase ZE	3.051.677,260
Clase ZFH	4.291,004

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	37,1398	50,4135	53,6034
Clase ASH	25,8296 ¹	34,6658 ¹	36,5279 ¹
Clase AUH	10,0303 ²	13,4075 ²	14,0753 ²
Clase DE	33,0378	45,0490	48,3327
Clase DUH	9,6528 ²	12,9610 ²	13,7346 ²
Clase IE	47,1933	63,8189	67,3496
Clase W	62,0794	84,2877	89,6657
Clase XE	7,7344	10,4050	-
Clase ZE	9,4912	12,8349	13,5449
Clase ZFH	9,1279 ³	12,3467 ³	13,0545 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.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		673.597.948
Ingresos		
Dividendos, neto	2	6.311.237
Interés bancario	2	772
Otros ingresos		6
Total de ingresos		6.312.015
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(3.364.265)
Interés bancario	2	(12.002)
Gastos operativos	3, 5	(799.755)
Total de gastos		(4.176.022)
Ingresos netos de inversiones		2.135.993
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		2.840.946
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		764.646
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		124.249
Ganancia neta realizada		3.729.841
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(154.788.779)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		50.395
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(154.738.384)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(148.872.550)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		19.395.590
Reembolsos de acciones		(183.261.229)
Total de movimientos de capital		(163.865.639)
Patrimonio neto al final del periodo		360.859.759

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	360.859.759	673.597.948	967.772.792

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	706.808.637
Efectivo en el banco	2	6.354
Suscripciones por cobrar		37.818
Interés y dividendos por cobrar, neto		531.982
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	651.637
Otros activos		1.693.468
Total de activos		709.729.896
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(1.717.507)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(641.040)
Otros pasivos		(99.122)
Total de pasivos		(2.457.669)
Total de patrimonio neto		707.272.227

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase 1E	831.378,314
Clase 2E	813.060,219
Clase 1E	22.421.039,808
Clase 1EP	731.941,932
Clase 1FH	234.812,896
Clase 1G	663.907,075
Clase 1UH	1.754.821,928
Clase 2E	15.098.456,283
Clase 2G	56,000
Clase 3E	14.486.174,578
Clase 3EP	1.053.651,703
Clase 3FH	660.134,197
Clase 3G	2.027.150,524
Clase 3GP	175.055,525
Clase 3UH	806.765,449
Clase 4E	1.842.223,296
Clase 4G	1.832.020,560
Clase 8E	4.064.063,587
Clase 8G	492.416,803
Clase 9E	7.529.762,295
Clase 9EP	64,000
Clase 9FH	16.227,059
Clase 9G	926.888,277
Clase 9GP	57,000
Clase 9UH	129.324,441

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		1.236.395.974
Ingresos		
Dividendos, neto	2	13.569.784
Interés bancario	2	1.882
Otros ingresos		281
Total de ingresos		13.571.947
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(4.706.492)
Interés bancario	2	(15.190)
Gastos operativos	3, 5	(727.951)
Total de gastos		(5.449.633)
Ingresos netos de inversiones		8.122.314
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(15.132.918)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		4.417.029
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		130.049
Ganancia neta realizada en reembolso de impuestos		107
(Pérdida) neta realizada		(10.585.733)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(252.632.616)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		943.257
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(251.689.359)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(254.152.778)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		27.986.347
Reembolsos de acciones		(302.957.316)
Total de movimientos de capital		(274.970.969)
Patrimonio neto al final del periodo		707.272.227

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	707.272.227	1.236.395.974	1.980.272.935

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase IE	9,1663	12,1084	13,0732
Clase ZE	8,8911	11,7537	12,7094
Clase 1E	8,6710	11,4986	12,5109
Clase 1EP	8,2454	10,9343	12,0777
Clase 1FH	8,5928 ¹	11,3955 ¹	12,4182 ¹
Clase 1G	8,4551 ²	10,7968 ²	11,8416 ²
Clase 1UH	9,4000 ³	12,2785 ³	13,1915 ³
Clase 2E	8,9027	11,7673	12,7202
Clase 2G	8,6916 ²	11,0646 ²	12,0514 ²
Clase 3E	8,9623	11,8366	12,7747
Clase 3EP	8,5254	11,2596	12,3346
Clase 3FH	8,8824 ¹	11,7317 ¹	12,6823 ¹
Clase 3G	8,7383 ²	11,1130 ²	12,0901 ²
Clase 3GP	8,3121 ²	10,5711 ²	11,6735 ²
Clase 3UH	9,7121 ³	12,6338 ³	13,4644 ³
Clase 4E	9,2754	12,1985	13,0550
Clase 4G	10,1218 ²	12,8182 ²	13,8285 ²
Clase 8E	8,8899	11,7527	12,7095
Clase 8G	8,6685 ²	11,0354 ²	12,0297 ²
Clase 9E	8,9781	11,8550	12,7895
Clase 9EP	8,5527	11,2856	12,3547
Clase 9FH	8,8972 ¹	11,7487 ¹	12,6978 ¹
Clase 9G	8,7556 ²	11,1328 ²	12,1068 ²
Clase 9GP	8,3455 ²	10,6036 ²	11,7010 ²
Clase 9UH	9,7336 ³	12,6594 ³	13,4863 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 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.238.480.105
Efectivo en el banco	2	1.158.049
Por cobrar para la venta de inversiones		23.676.070
Suscripciones por cobrar		155.173
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	132.193
Otros activos		3.419.419
Total de activos		1.267.021.009
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(22.767.010)
Reembolsos pagaderos		(491.949)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.428.329)
Otros pasivos		(156.584)
Total de pasivos		(24.843.872)
Total de patrimonio neto		1.242.177.137

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	130.497,439
Clase AGH	3.835,978
Clase AUH	65.714,182
Clase DUH	66,000
Clase IE	614.326,286
Clase ZE	85,000
Clase ZG	20.264,090
Clase ZGH	175.693,096
Clase 1E	73.525.306,848
Clase 1EP	899.495,302
Clase 1SH	2.127.337,481
Clase 1U	31.258,807
Clase 1UH	320.450,440
Clase 2E	11.065.314,904
Clase 2EP	57,000
Clase 3E	1.899.997,587
Clase 3U	525.317,385
Clase 8E	2.217.245,968
Clase 8EP	19.226,558
Clase 9E	7.805.988,562
Clase 9U	63,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		1.623.386.971
Ingresos		
Dividendos, neto	2	15.897.522
Interés bancario	2	2.477
Otros ingresos		1.203
Total de ingresos		15.901.202
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(9.409.077)
Interés bancario	2	(17.930)
Gastos operativos	3, 5	(973.188)
Total de gastos		(10.400.195)
Ingresos netos de inversiones		5.501.007
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		39.661.113
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		2.129.443
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		98.389
Ganancia neta realizada		41.888.945
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(304.816.237)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		235.720
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(304.580.517)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(257.190.565)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		69.006.936
Reembolsos de acciones		(193.026.205)
Total de movimientos de capital		(124.019.269)
Patrimonio neto al final del periodo		1.242.177.137

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	1.242.177.137	1.623.386.971	1.641.460.241

Threadneedle (Lux) - European Select

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	25,1879	30,1120	29,4285
Clase AGH	27,1454 ¹	32,2683 ¹	31,3771 ¹
Clase AUH	29,0107 ²	34,1941 ²	33,0305 ²
Clase DUH	12,0797 ²	14,2740 ²	13,8650 ²
Clase IE	36,7601	43,7595	42,4042
Clase ZE	7,6540	9,1184	–
Clase ZG	12,7233 ¹	14,5919 ¹	14,2678 ¹
Clase ZGH	28,1387 ¹	33,3203 ¹	32,1562 ¹
Clase 1E	12,0294	14,3703	14,0231
Clase 1EP	11,4195	13,6418	13,5040
Clase 1SH	12,6496 ³	14,9506 ³	14,4595 ³
Clase 1U	10,1767 ²	13,8075 ²	14,2325 ²
Clase 1UH	12,9802 ²	15,2829 ²	14,7401 ²
Clase 2E	12,3127	14,6652	14,2266
Clase 2EP	11,7012	13,9345	13,7092
Clase 3E	12,4010	14,7570	14,2900
Clase 3U	10,4896 ²	14,1771 ²	14,5014 ²
Clase 8E	12,2938	14,6457	14,2134
Clase 8EP	11,6836	13,9187	13,7016
Clase 9E	12,4198	14,7765	14,3031
Clase 9U	10,5242 ²	14,2172 ²	14,5368 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.

Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.241.262.644
Efectivo en el banco	2	2.106.529
Suscripciones por cobrar		263.511
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.061.345
Otros activos		3.108.121
Total de activos		1.247.802.150
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(1.513.215)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(12.893)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.487.808)
Otros pasivos		(223.446)
Total de pasivos		(3.237.362)
Total de patrimonio neto		1.244.564.788

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IE	279.441,771
Clase ZE	536.598,703
Clase 1E	89.568.085,570
Clase 1EP	3.270.274,427
Clase 1FH	61,000
Clase 2E	3.234.796,689
Clase 3E	4.865.317,950
Clase 3EP	173.360,366
Clase 3FH	724.700,982
Clase 8E	4.841.674,734
Clase 9E	8.433.996,528
Clase 9EP	556.375,000
Clase 9FH	221,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase IE	9,8098	12,6494	13,0435
Clase ZE	10,9007	14,0668	14,5269
Clase 1E	10,6389	13,7718	14,3106
Clase 1EP	10,1429	13,1298	13,8388
Clase 1FH	10,5453 ¹	13,6535 ¹	14,2143 ¹
Clase 2E	10,9164	14,0850	14,5412
Clase 3E	10,9505	14,1189	14,5559
Clase 3EP	10,4589	13,4851	14,0994
Clase 3FH	10,8776 ¹	14,0261 ¹	14,4944 ¹
Clase 8E	10,9013	14,0682	14,5297
Clase 9E	10,9917	14,1693	14,6020
Clase 9EP	10,4837	13,5144	14,1156
Clase 9FH	10,8803 ¹	14,0265 ¹	14,4918 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 contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		1.772.635.200
Ingresos		
Dividendos, neto	2	21.175.572
Interés bancario	2	746
Otros ingresos		102
Total de ingresos		21.176.420
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(10.205.525)
Interés bancario	2	(20.158)
Gastos operativos	3, 5	(1.529.216)
Total de gastos		(11.754.899)
Ingresos netos de inversiones		9.421.521
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(5.125.132)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		588.306
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		24.859
Ganancia neta realizada en reembolso de impuestos		74
(Pérdida) neta realizada		(4.511.893)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(389.706.627)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(100.976)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(389.807.603)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(384.897.975)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		66.957.371
Reembolsos de acciones		(210.129.808)
Total de movimientos de capital		(143.172.437)
Patrimonio neto al final del periodo		1.244.564.788

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	1.244.564.788	1.772.635.200	1.932.987.086

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	41.422.819
Efectivo en el banco	2	608.082
Por cobrar para la venta de inversiones		935.702
Suscripciones por cobrar		9.648
Interés y dividendos por cobrar, neto		74.088
Otros activos		2.081
Total de activos		43.052.420
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(342.650)
Reembolsos pagaderos		(21.989)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(79.930)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(27.524)
Otros pasivos	20	(898.034)
Total de pasivos		(1.370.127)
Total de patrimonio neto		41.682.293

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	28.398,092
Clase AU	42.188,939
Clase AUP	157.912,395
Clase DEH	77.848,160
Clase DU	41.395,893
Clase DUP	59.097,036
Clase IEP	1.048.049,465
Clase IU	70,000
Clase W	19.129,778
Clase XU	1.341.544,014
Clase XUP	251.482,953
Clase ZG	51,000
Clase ZGH	6.917,198
Clase ZGP	56,000
Clase ZU	100,000
Clase ZUP	3.774,045

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	33,8271 ¹	45,2875 ¹	49,6140 ¹
Clase AU	86,9027	114,4216	123,7850
Clase AUP	9,9676	13,4844	15,1272
Clase DEH	23,7939 ¹	31,9765 ¹	35,2821 ¹
Clase DU	41,8325	55,2874	60,2623
Clase DUP	9,6690	13,1305	14,8423
Clase IEP	11,8061 ¹	14,0025 ¹	14,7448 ¹
Clase IU	10,0849	13,2161	14,1867
Clase W	64,1621	84,5649	91,6683
Clase XU	11,3198	14,7814	15,7291
Clase XUP	10,5411	14,1419	15,6032
Clase ZG	12,4815 ²	13,8913 ²	14,2390 ²
Clase ZGH	19,4885 ²	25,8292 ²	27,9288 ²
Clase ZGP	10,6876 ²	12,2208 ²	12,9909 ²
Clase ZU	7,5269	9,8775	—
Clase ZUP	11,6469	15,6966	17,4725

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 contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		52.164.940
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.054.580
Interés bancario	2	5.249
Otros ingresos	3	79.788
Total de ingresos		1.139.617
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(174.510)
Interés bancario	2	(158)
Gastos operativos	3, 5	(51.022)
Comisiones varias	4	(49)
Total de gastos		(225.739)
Ingresos netos de inversiones		913.878
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(915.871)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(403.071)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(11.412)
(Pérdida) neta realizada		(1.330.354)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(12.913.430)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(123.352)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(13.036.782)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(13.453.258)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		6.075.100
Reembolsos de acciones		(2.617.368)
Dividendos	7	(487.121)
Total de movimientos de capital		2.970.611
Patrimonio neto al final del periodo		41.682.293

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	41.682.293	52.164.940	52.863.212

Threadneedle (Lux) - Global Technology

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	515.909.390
Efectivo en el banco	2	3.613.320
Suscripciones por cobrar		758.510
Interés y dividendos por cobrar, neto		272.981
Total de activos		520.554.201
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(526.728)
Reembolsos pagaderos		(666.530)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(1.646.538)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(657.556)
Otros pasivos		(131.039)
Total de pasivos		(3.628.391)
Total de patrimonio neto		516.925.810

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	554.536,736
Clase AS	702.053,096
Clase AU	3.056.763,233
Clase AUP	61.189,551
Clase BU	58.486,322
Clase DEH	158.771,868
Clase DU	536.564,179
Clase IE	938.108,073
Clase IEH	1.710.876,000
Clase IG	17.898,636
Clase IU	9.020.900,867
Clase ZEH	74.787,112
Clase ZFH	42.370,627
Clase ZG	22.235,555
Clase ZU	1.044.688,087

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	52,5525 ¹	73,7380 ¹	67,4347 ¹
Clase AS	19,7922 ²	25,6949 ²	23,0106 ²
Clase AU	71,5464	98,4809	88,8329
Clase AUP	15,3033	21,0644	19,1460
Clase BU	90,1336	124,3152	112,5857
Clase DEH	15,0538 ¹	21,1515 ¹	19,4109 ¹
Clase DU	104,7363	144,4193	130,7275
Clase IE	14,4239 ¹	17,4019 ¹	14,7271 ¹
Clase IEH	17,9542 ¹	25,0771 ¹	22,7318 ¹
Clase IG	20,0285 ³	23,2680 ³	19,8499 ³
Clase IU	12,7290	17,4419	15,5922
Clase ZEH	14,8783 ¹	20,7904 ¹	18,8611 ¹
Clase ZFH	17,4258 ⁴	24,2713 ⁴	22,0485 ⁴
Clase ZG	19,9589 ³	23,1988 ³	19,8092 ³
Clase ZU	32,8659	45,0572	40,3192

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 contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		651.663.253
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.774.792
Interés bancario	2	55.678
Total de ingresos		1.830.470
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(4.184.656)
Interés bancario	2	(455)
Gastos operativos	3, 5	(807.103)
Total de gastos		(4.992.214)
(Pérdida) neta de inversiones		(3.161.744)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(4.040.264)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(8.602.917)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(49.171)
(Pérdida) neta realizada		(12.692.352)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(177.863.603)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(2.613.520)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(180.477.123)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(196.331.219)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		148.014.174
Reembolsos de acciones		(86.420.398)
Total de movimientos de capital		61.593.776
Patrimonio neto al final del periodo		516.925.810

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	516.925.810	651.663.253	537.276.170

Threadneedle (Lux) - UK Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 GBP
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	252.509.772
Efectivo en el banco	2	1.383.522
Por cobrar para la venta de inversiones		1.018.199
Suscripciones por cobrar		2.668.867
Interés y dividendos por cobrar, neto		573.114
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	326.899
Total de activos		258.480.373
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(38.818)
Pagadero por inversiones adquiridas		(595.548)
Reembolsos pagaderos		(1.728.335)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(170.603)
Otros pasivos		(62.975)
Total de pasivos		(2.596.279)
Total de patrimonio neto		255.884.094

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	124.313,240
Clase AEH	161.226,116
Clase AFH	7.192,000
Clase AG	571.966,726
Clase AGP	43.805,042
Clase DEH	118.622,171
Clase DG	3.155,252
Clase IE	750.340,434
Clase IEH	216.394,697
Clase IG	2.182.027,458
Clase IGP	597.584,296
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	88,000
Clase ZEH	77.919,254
Clase ZFH	3.325,000
Clase ZG	205.853,213
Clase ZGP	1.325.583,731
Clase ZUH	57.569,000
Clase 3EH	2.121.697,683
Clase 3FH	49.785,040
Clase 3UH	1.860.367,359
Clase 9EH	1.062,000
Clase 9EP	2.589.832,979
Clase 9FH	6.085,000
Clase 9G	9.480.065,895
Clase 9UH	87,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 GBP
Patrimonio neto al inicio del periodo		274.453.238
Ingresos		
Dividendos, neto	2	5.048.893
Interés bancario	2	6.536
Total de ingresos		5.055.429
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.056.498)
Interés bancario	2	(484)
Gastos operativos	3, 5	(221.037)
Total de gastos		(1.278.019)
Ingresos netos de inversiones		3.777.410
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(2.130.724)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		879.001
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(30.096)
(Pérdida) neta realizada		(1.281.819)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(33.055.796)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		363.740
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(32.692.056)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(30.196.465)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		54.439.052
Reembolsos de acciones		(41.778.154)
Dividendos	7	(1.033.577)
Total de movimientos de capital		11.627.321
Patrimonio neto al final del periodo		255.884.094

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
GBP	255.884.094	274.453.238	296.943.244

Threadneedle (Lux) - UK Equities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	7,9707 ¹	9,3165 ¹	9,2845 ¹
Clase AEH	17,5542 ¹	19,9122 ¹	20,1489 ¹
Clase AFH	8,5622 ²	9,7085 ²	9,8231 ²
Clase AG	24,7462	27,8526	27,9800
Clase AGP	17,6640	20,3018	21,0118
Clase DEH	8,2439 ¹	9,3874 ¹	9,5731 ¹
Clase DG	8,6081	9,7276	9,8507
Clase IE	8,5719 ¹	9,9716 ¹	9,8435 ¹
Clase IEH	26,7187 ¹	30,1611 ¹	30,2322 ¹
Clase IG	36,3509	40,7193	40,5187
Clase IGP	26,2219	29,9926	30,7471
Clase NEH	10,9798 ¹	12,3773 ¹	12,3770 ¹
Clase NFH	10,9837 ²	12,3772 ²	12,3746 ²
Clase NG	11,1716	12,5034	12,4164
Clase NGP	10,5258	12,0225	12,2963
Clase NUH	11,3284 ³	12,6056 ³	12,4477 ³
Clase TEH	10,9729 ¹	12,3724 ¹	12,3766 ¹
Clase TFH	10,9744 ²	12,3703 ²	12,3738 ²
Clase TG	11,1746	12,5042	12,4163
Clase TGP	10,5175	12,0170	12,2962
Clase TUH	11,3244 ³	12,6005 ³	12,4472 ³
Clase ZE	8,1265 ¹	9,4643 ¹	9,3628 ¹
Clase ZEH	10,9240 ¹	12,3480 ¹	12,4008 ¹
Clase ZFH	10,5932 ²	11,9648 ²	12,0143 ²
Clase ZG	24,0745	26,9947	26,9156
Clase ZGP	9,4127	10,7776	11,0735
Clase ZUH	9,8451 ³	10,9752 ³	10,8824 ³
Clase 3EH	1,5594 ¹	1,7608 ¹	1,7651 ¹
Clase 3FH	1,6765 ²	1,8918 ²	1,8962 ²
Clase 3UH	1,9620 ³	2,1863 ³	2,1639 ³
Clase 9EH	9,3449 ¹	10,5479 ¹	10,5716 ¹
Clase 9EP	8,3824 ¹	9,9562 ¹	10,1260 ¹
Clase 9FH	9,3325 ²	10,5292 ²	10,5498 ²
Clase 9G	9,0213	10,1044	10,0527
Clase 9UH	10,0876 ³	11,2422 ³	11,1280 ³

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

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

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

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 GBP
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	218.935.110
Efectivo en el banco	2	336.272
Suscripciones por cobrar		203.487
Interés y dividendos por cobrar, neto		599.833
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	454.109
Total de activos		220.528.811
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(1.059.683)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(137.909)
Otros pasivos		(47.476)
Total de pasivos		(1.245.068)
Total de patrimonio neto		219.283.743

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.832.973,732
Clase AEC	48.893,611
Clase AEH	126.876,437
Clase AG	579.952,681
Clase ASC	133,600
Clase AUC	531.322,637
Clase DE	6.108,118
Clase DEC	12.739,967
Clase DEH	4.780,573
Clase DG	24.865,456
Clase DGP	808,187
Clase IE	2.144.577,140
Clase IEH	20.401,291
Clase IG	520.446,259
Clase IGP	1.421.010,526
Clase IU	489.310,087
Clase IUH	80,000
Clase LG	391.618,526
Clase LGP	12.075.350,164
Clase ZE	180.178,072
Clase ZEH	18.770,600
Clase ZFH	10.046,000
Clase ZG	169.715,774
Clase ZGP	162.981,383
Clase ZUH	125.597,184
Clase 1EH	254.434,756
Clase 1FH	29.291,102
Clase 1UH	92.880,092
Clase 3EH	135.339,622
Clase 3FH	28.981,742
Clase 3UH	246.707,532
Clase 9EH	42.173,000
Clase 9FH	81,000
Clase 9G	711.914,313
Clase 9UH	2.174,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 GBP
Patrimonio neto al inicio del periodo		232.631.300
Ingresos		
Dividendos, neto	2	5.080.382
Interés bancario	2	5.425
Total de ingresos		5.085.807
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(868.459)
Interés bancario	2	(216)
Gastos operativos	3, 5	(254.339)
Total de gastos		(1.123.014)
Ingresos netos de inversiones		3.962.793
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		765.489
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		1.390.828
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		103.953
Ganancia neta realizada		2.260.270
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(27.769.454)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		545.820
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(27.223.634)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(21.000.571)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		50.296.249
Reembolsos de acciones		(39.520.748)
Dividendos	7	(3.122.487)
Total de movimientos de capital		7.653.014
Patrimonio neto al final del periodo		219.283.743

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
GBP	219.283.743	232.631.300	203.529.182

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	11,0263 ¹	12,6812 ¹	11,6608 ¹
Clase AEC	8,4759 ¹	9,6686 ¹	9,3261 ¹
Clase AEH	10,3822 ¹	11,5877 ¹	10,8296 ¹
Clase AG	11,0028	12,1852	11,2947
Clase ASC	8,9557 ²	10,1013 ²	9,6533 ²
Clase AUC	9,4348 ³	10,6068 ³	10,1151 ³
Clase DE	10,5443 ¹	12,1725 ¹	11,2772 ¹
Clase DEC	8,0629 ¹	9,2267 ¹	8,9790 ¹
Clase DEH	9,9244 ¹	11,1182 ¹	10,4678 ¹
Clase DG	10,5235	11,6992	10,9259
Clase DGP	8,8847	10,0965	9,7473
Clase IE	11,6664 ¹	13,3535 ¹	12,1630 ¹
Clase IEH	10,9752 ¹	12,1998 ¹	11,2958 ¹
Clase IG	11,6652	12,8573	11,8052
Clase IGP	9,4995	10,7015	10,1383
Clase IU	10,2029 ³	13,2640 ³	12,7617 ³
Clase IUH	11,8760 ³	13,0077 ³	11,8874 ³
Clase LG	11,7649	12,9575	11,8792
Clase LGP	9,5615	10,7649	10,1870
Clase ZE	11,5343 ¹	13,2156 ¹	12,0615 ¹
Clase ZEH	10,8533 ¹	12,0729 ¹	11,2040 ¹
Clase ZFH	10,6970 ⁴	11,8925 ⁴	11,0386 ⁴
Clase ZG	11,5167	12,7064	11,6899
Clase ZGP	9,8534	11,1107	10,5523
Clase ZUH	12,1485 ³	13,3271 ³	12,2225 ³
Clase 1EH	10,2935 ¹	11,4780 ¹	10,7111 ¹
Clase 1FH	10,2328 ⁴	11,4101 ⁴	10,6537 ⁴
Clase 1UH	11,1182 ³	12,2298 ³	11,2829 ³
Clase 3EH	10,6058 ¹	11,7863 ¹	10,9193 ¹
Clase 3FH	10,5389 ⁴	11,7136 ⁴	10,8540 ⁴
Clase 3UH	11,4639 ³	12,5625 ³	11,5019 ³
Clase 9EH	10,6198 ¹	11,7980 ¹	10,9227 ¹
Clase 9FH	10,5379 ⁴	11,7077 ⁴	10,8516 ⁴
Clase 9G	10,4273	11,4924	10,5508
Clase 9UH	11,4671 ³	12,5653 ³	11,4992 ³

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

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

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

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

Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Efectivo en el banco	2	1.499.229
Interés y dividendos por cobrar, neto		484
Otros activos		21.106
Total de activos		1.520.819
Pasivos		
Otros pasivos		(440)
Total de pasivos		(440)
Total de patrimonio neto		1.520.379

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IU	398.459,064
Clase ZU	12.351,905

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase IU	3,7009	3,8464	3,8047
Clase ZU	3,7014	3,8469	3,8053

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		1.580.155
Ingresos		
Interés bancario	2	1.714
Total de ingresos		1.714
Gastos		
Gastos operativos	3, 5	(2.743)
Total de gastos		(2.743)
(Pérdida) neta de inversiones		(1.029)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(58.709)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(38)
(Pérdida) neta realizada		(58.747)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(59.776)
Patrimonio neto al final del periodo		1.520.379

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	1.520.379	1.580.155	6.857.182

* Consulte la nota 22.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	38.152.190
Efectivo en el banco	2	804.431
Por cobrar para la venta de inversiones		106.648
Suscripciones por cobrar		121.876
Interés por cobrar en swaps	2	15.384
Interés y dividendos por cobrar, neto		22.988
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	1.059.295
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	2.090.428
Total de activos		42.373.240
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(513.809)
Reembolsos pagaderos		(18.640)
Dividendo pagadero en swaps (Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2	(23.359)
	2, 9	(574.899)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(16.095)
Comisiones de rendimiento pagaderas	8	(13)
Otros pasivos		(5.575)
Total de pasivos		(1.152.390)
Total de patrimonio neto		41.220.850

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	46.864,276
Clase AFH	764,000
Clase AGH	751,881
Clase AU	166.176,656
Clase DEH	8.492,859
Clase DU	76.857,427
Clase IEH	110.271,141
Clase IGH	79.457,937
Clase IU	837.415,976
Clase XGH	1.013.084,972
Clase ZE	80,000
Clase ZEH	83,000
Clase ZGH	1.774,875
Clase ZU	100,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	14,6833 ¹	15,5801 ¹	15,3714 ¹
Clase AFH	13,3577 ²	14,1612 ²	13,9949 ²
Clase AGH	15,9117 ³	16,7573 ³	16,4018 ³
Clase AU	16,8748	17,6966	17,2872
Clase DEH	11,2952 ¹	12,0140 ¹	11,9135 ¹
Clase DU	12,8821	13,5433	13,2965
Clase IEH	21,5510 ¹	22,7694 ¹	22,2720 ¹
Clase IGH	23,1115 ³	24,2352 ³	23,5814 ³
Clase IU	24,4565	25,5384	24,8005
Clase XGH	10,3831 ³	10,8426 ³	10,4372 ³
Clase ZE	11,8096 ¹	11,0174 ¹	10,1161 ¹
Clase ZEH	9,3843 ¹	9,9289 ¹	9,7263 ¹
Clase ZGH	15,8576 ³	16,6367 ³	16,1525 ³
Clase ZU	10,1644	10,6198	10,3329

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 contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		24.741.485
Ingresos		
Dividendos, neto	2	108.242
Interés bancario	2	13.425
Ingresos por intereses en swaps		67.647
Ingresos por intereses en contratos de futuros		1.809
Total de ingresos		191.123
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(66.446)
Comisiones de rendimiento	8	(13)
Interés bancario	2	(330)
Dividendos pagados en swaps		(68.970)
Gastos por intereses en swaps		(57.024)
Gastos operativos	3, 5	(24.815)
Total de gastos		(217.598)
(Pérdida) neta de inversiones		(26.475)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(497.563)
Ganancia neta realizada en swaps		1.384.249
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(2.306.764)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		297.439
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		46.053
(Pérdida) neta realizada		(1.076.586)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(6.522.193)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		1.199.919
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(793.521)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		2.985.088
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(3.130.707)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(4.233.768)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		23.061.935
Reembolsos de acciones		(2.348.802)
Total de movimientos de capital		20.713.133
Patrimonio neto al final del periodo		41.220.850

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	41.220.850	24.741.485	103.961.830

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	588.077.891
Efectivo en el banco	2	7.902.108
Depósitos a plazo	2, 19	25.005.695
Por cobrar para la venta de inversiones		873.406
Suscripciones por cobrar		181.033
Interés por cobrar en swaps	2	570.816
Interés y dividendos por cobrar, neto		7.569.828
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	15.529.597
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	14.646.519
Otros activos		2.165
Total de activos		660.359.058
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(3.807.855)
Reembolsos pagaderos		(32.834.589)
Interés pagadero en swaps	2	(870.828)
Pago por adelantado cobrado en swaps	2	(83.095)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(571.480)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(326.362)
Otros pasivos		(52.870)
Total de pasivos		(38.547.079)
Total de patrimonio neto		621.811.979

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	85,000
Clase IE	85,000
Clase ZE	95.018,437
Clase 1E	12.087.291,081
Clase 1EP	54.711,959
Clase 1GH	167.602,993
Clase 1UH	195.285,628
Clase 2E	29.960.397,034
Clase 2EP	432.990,926
Clase 2GC	76,000
Clase 2GH	7.497,154
Clase 4GH	242.001,138
Clase 8E	19.902.401,986
Clase 8EP	124.630,995
Clase 8GC	34.663,272
Clase 8GH	688.646,775

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		980.879.073
Ingresos		
Dividendos, neto	2	12.553
Interés sobre bonos, neto	2	14.498.868
Interés bancario	2	18.970
Ingresos por intereses en swaps		3.734.705
Ingresos por intereses en contratos de futuros		37.108
Otros ingresos		314
Total de ingresos		18.302.518
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(2.286.015)
Interés bancario	2	(213.670)
Gastos por intereses en swaps		(11.162.982)
Gastos operativos	3, 5	(357.421)
Total de gastos		(14.020.088)
Ingresos netos de inversiones		
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(17.408.721)
Ganancia neta realizada en swaps		3.293.509
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(15.808.021)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		42.058.476
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		1.538.928
Ganancia neta realizada		13.674.171
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(72.645.072)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		35.378.123
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(5.079.287)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(1.948.032)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(44.294.268)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(26.337.667)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		93.294.168
Reembolsos de acciones		(426.023.595)
Total de movimientos de capital		(332.729.427)
Patrimonio neto al final del periodo		621.811.979

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	621.811.979	980.879.073	1.105.181.704

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	9,4200	9,7720	–
Clase IE	9,4772	9,8024	–
Clase ZE	9,6589	9,9967	10,2122
Clase 1E	9,5066	9,8622	10,1181
Clase 1EP	8,4005	8,7147	9,2533
Clase 1GH	9,8447 ¹	10,1307 ¹	10,3276 ¹
Clase 1UH	10,1582 ²	10,4460 ²	10,6393 ²
Clase 2E	9,7473	10,0810	10,2797
Clase 2EP	8,5975	8,8919	9,3705
Clase 2GC	8,8935 ¹	9,1211 ¹	9,5453 ¹
Clase 2GH	10,0953 ¹	10,3563 ¹	10,4925 ¹
Clase 4GH	10,3042 ¹	10,5443 ¹	10,6305 ¹
Clase 8E	9,7275	10,0626	10,2650
Clase 8EP	8,6030	8,8993	9,3952
Clase 8GC	8,9091 ¹	9,1415 ¹	9,5801 ¹
Clase 8GH	10,0826 ¹	10,3438 ¹	10,4843 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.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	28.640.320
Efectivo en el banco	2	1.289.422
Interés por cobrar en swaps	2	14.973
Interés y dividendos por cobrar, neto		273.640
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	1.040.288
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	878.315
Otros activos		10.893
Total de activos		32.147.851
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(265.348)
Interés pagadero en swaps	2	(27.956)
Pago por adelantado cobrado en swaps	2	(8.309)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(369.323)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(974)
Otros pasivos		(3.189)
Total de pasivos		(675.099)
Total de patrimonio neto		31.472.752

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	374,659
Clase AFH	92,200
Clase AKH	84,000
Clase ANH	830,000
Clase AUH	572,957
Clase DE	17.592,059
Clase IE	217.877,632
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	2.262.571,117
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 contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		44.628.404
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	524.067
Interés bancario	2	3.353
Ingresos por intereses en swaps		161.215
Ingresos por intereses en contratos de futuros		2.412
Otros ingresos		10
Total de ingresos		691.057
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(6.513)
Interés bancario	2	(12.235)
Gastos por intereses en swaps		(408.272)
Gastos operativos	3, 5	(25.438)
Total de gastos		(452.458)
Ingresos netos de inversiones		
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(522.176)
Ganancia neta realizada en swaps		78.816
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.764.958)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		2.502.839
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		152.825
Ganancia neta realizada		447.346
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(3.507.364)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		1.434.290
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(347.055)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(152.706)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(2.572.835)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(1.886.890)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		613.952
Reembolsos de acciones		(11.882.684)
Dividendos	7	(30)
Total de movimientos de capital		(11.268.762)
Patrimonio neto al final del periodo		31.472.752

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	31.472.752	44.628.404	53.361.804

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	9,5779	9,9429	10,2349
Clase AFH	9,4402 ¹	9,8101 ¹	10,1268 ¹
Clase AKH	96,2522 ²	99,6323 ²	102,3358 ²
Clase ANH	9,8433 ³	10,1446 ³	10,3661 ³
Clase AUH	10,3561 ⁴	10,6635 ⁴	10,8977 ⁴
Clase DE	9,3379	9,7208	10,0608
Clase IE	9,8616	10,2044	10,4353
Clase IEP	8,5871	9,0524	9,4983
Clase IGH	10,2669 ⁵	10,5320 ⁵	10,6920 ⁵
Clase INH	9,9909 ³	10,2572 ³	10,4013 ³
Clase IU	8,5694 ⁴	10,0660 ⁴	10,8726 ⁴
Clase IUH	10,6505 ⁴	10,9297 ⁴	11,0910 ⁴
Clase JE	9,8501	10,1884	10,4159
Clase JGH	10,2799 ⁵	10,5456 ⁵	10,6939 ⁵
Clase JUH	10,6042 ⁴	10,8783 ⁴	11,0321 ⁴
Clase LE	9,9262	10,2635	10,4800
Clase LEP	8,7023	9,1580	9,5877
Clase LGH	10,3554 ⁵	10,6048 ⁵	10,7382 ⁵
Clase XE	10,2535	10,5895	10,7859
Clase XGH	10,0480 ⁵	10,2913 ⁵	10,4148 ⁵
Clase XUH	10,5155 ⁴	10,7628 ⁴	10,8737 ⁴
Clase YE	9,7971	10,1443	10,3910
Clase YGH	10,1933 ⁵	10,4650 ⁵	10,6432 ⁵
Clase YUH	10,5274 ⁴	10,8066 ⁴	10,9872 ⁴
Clase ZE	9,7755	10,1272	10,3835
Clase ZFH	9,6364 ¹	9,9880 ¹	10,2620 ¹
Clase ZGH	10,1997 ⁵	10,4758 ⁵	10,6642 ⁵
Clase ZUH	10,5800 ⁴	10,8614 ⁴	11,0490 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 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	83.478.866
Efectivo en el banco	2	2.039.560
Por cobrar para la venta de inversiones		7.451.284
Suscripciones por cobrar		24.030
Interés por cobrar en swaps	2	4.910.909
Interés y dividendos por cobrar, neto		23.050
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	697.184
Otros activos		212.266
Total de activos		98.837.149
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(1.237.966)
Pagadero por inversiones adquiridas		(2.669.535)
Reembolsos pagaderos		(131.981)
Interés pagadero en swaps	2	(503.602)
Dividendo pagadero en swaps	2	(36.769)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(134.404)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(84.012)
Otros pasivos		(22.286)
Total de pasivos		(4.820.555)
Total de patrimonio neto		94.016.594

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.913.987,648
Clase AEP	28.416,953
Clase AUH	77,000
Clase DE	2.125.469,418
Clase IE	1.658.092,106
Clase IGH	16.517,702
Clase LE	1.401.504,591
Clase XGH	783.616,969
Clase ZE	170.281,038
Clase ZF	76,000
Clase ZFH	77,000
Clase ZGH	57,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	11,0759	12,1389	11,9823
Clase AEP	11,3021	12,3867	12,3580
Clase AUH	12,1646 ¹	13,1642 ¹	12,8933 ¹
Clase DE	10,7213	11,7798	11,7839
Clase IE	11,5638	12,6164	12,5007
Clase IGH	11,9745 ²	12,9699 ²	12,7513 ²
Clase LE	11,7702	12,8174	12,6752
Clase XGH	13,2529 ²	14,3002 ²	13,8662 ²
Clase ZE	11,6044	12,6671	12,5092
Clase ZF	9,9485 ³	11,5379 ³	12,2367 ³
Clase ZFH	10,9021 ³	11,9019 ³	11,8267 ³
Clase ZGH	12,0976 ²	13,1142 ²	12,7204 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 contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		123.839.076
Ingresos		
Dividendos, neto	2	2.155.688
Interés bancario	2	449
Ingresos por intereses en swaps		44.914
Total de ingresos		2.201.051
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(565.912)
Interés bancario	2	(11.337)
Dividendos pagados en swaps		(1.000.805)
Gastos por intereses en swaps		(289.678)
Gastos operativos	3, 5	(142.254)
Total de gastos		(2.009.986)
Ingresos netos de inversiones		191.065
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(5.524.437)
Ganancia neta realizada en swaps		7.126.241
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(216.972)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		2.447
Ganancia neta realizada en reembolso de impuestos		20
Ganancia neta realizada		1.387.299
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(12.565.847)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		744.187
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(135.351)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(11.957.011)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(10.378.647)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		4.756.026
Reembolsos de acciones		(24.199.861)
Total de movimientos de capital		(19.443.835)
Patrimonio neto al final del periodo		94.016.594

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	94.016.594	123.839.076	235.387.755

Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	82.996.317
Efectivo en el banco	2	526.993
Por cobrar para la venta de inversiones		382.152
Suscripciones por cobrar		7.919
Interés por cobrar en swaps	2	31.385
Interés y dividendos por cobrar, neto		66.268
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	970.489
Otros activos		1.597
Total de activos		84.983.120
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(1.141.006)
Reembolsos pagaderos		(325.801)
Interés pagadero en swaps	2	(11.540)
Dividendo pagadero en swaps	2	(43.508)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(41.803)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(97.998)
Otros pasivos		(12.933)
Total de pasivos		(1.674.589)
Total de patrimonio neto		83.308.531

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	747,414
Clase AU	1.957,786
Clase DEH	219,748
Clase DU	27.259,443
Clase IU	176.332,124
Clase ZU	57,000
Clase 1E	3.293.257,868
Clase 1EH	370.556,382
Clase 1U	5.641.713,206
Clase 2E	49,000
Clase 2U	186,000
Clase 3U	45.196,000
Clase 8E	271.198,724
Clase 8U	1.945.805,937
Clase 9U	56,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	12,3385 ¹	16,4272 ¹	14,7944 ¹
Clase AU	13,3117	17,4066	15,4832
Clase DEH	12,1062 ¹	16,1610 ¹	14,6365 ¹
Clase DU	13,0607	17,1211	15,3058
Clase IU	13,7613	17,9132	15,7911
Clase ZU	13,6891	17,8411	15,7432
Clase 1E	7,0572 ¹	8,1204 ¹	6,8306 ¹
Clase 1EH	4,4940 ¹	5,9805 ¹	5,3803 ¹
Clase 1U	6,9123	9,0336	8,0266
Clase 2E	16,0515 ¹	18,3931 ¹	15,3339 ¹
Clase 2U	13,8196	17,9863	15,8326
Clase 3U	3,9245	5,1096	4,5061
Clase 8E	7,8278 ¹	8,9701 ¹	7,4837 ¹
Clase 8U	7,6212	9,9191	8,7414
Clase 9U	13,7889	17,9452	15,8025

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 contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		125.198.445
Ingresos		
Dividendos, neto	2	478.197
Interés bancario	2	14.773
Ingresos por intereses en swaps		179.787
Total de ingresos		672.757
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(696.875)
Interés bancario	2	(312)
Dividendos pagados en swaps		(53.044)
Gastos por intereses en swaps		(326.440)
Gastos operativos	3, 5	(91.774)
Total de gastos		(1.168.445)
(Pérdida) neta de inversiones		(495.688)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(3.519.666)
(Pérdida) neta realizada en swaps		(296.754)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(223.812)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(897)
(Pérdida) neta realizada		(4.041.129)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(25.123.812)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		1.500.525
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(67.260)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(23.690.547)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(28.227.364)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		4.126.243
Reembolsos de acciones		(17.788.793)
Total de movimientos de capital		(13.662.550)
Patrimonio neto al final del periodo		83.308.531

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	83.308.531	125.198.445	112.622.890

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	66.647.034
Efectivo en el banco	2	2.035.879
Depósitos a plazo	2, 19	7.308.478
Suscripciones por cobrar		16.916
Interés por cobrar en swaps	2	7.308
Interés y dividendos por cobrar, neto		62.248
Otros activos		47.801
Total de activos		76.125.664
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(9.479)
Reembolsos pagaderos		(39.071)
Interés pagadero en swaps	2	(217.546)
Dividendo pagadero en swaps	2	(60.588)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(3.778)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(1.373.513)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(97.196)
Otros pasivos		(12.484)
Total de pasivos		(1.813.655)
Total de patrimonio neto		74.312.009

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	52,000
Clase AU	18.715,185
Clase DEH	13.179,370
Clase DU	618,597
Clase IU	126.664,000
Clase ZU	58,000
Clase 1E	14.789.701,905
Clase 1U	888.455,848
Clase 2E	52,000
Clase 2U	643,023
Clase 8E	207.506,384
Clase 8U	197.736,102

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	11,0473 ¹	14,5886 ¹	15,0223 ¹
Clase AU	11,8916	15,4367	15,6740
Clase DEH	10,9214 ¹	14,4782 ¹	14,9762 ¹
Clase DU	11,7374	15,2753	15,5884
Clase IU	12,4163	16,0451	16,1456
Clase ZU	12,2686	15,8776	15,9900
Clase 1E	4,5780 ¹	5,2295 ¹	5,0213 ¹
Clase 1U	4,4917	5,8275	5,9106
Clase 2E	14,3515 ¹	16,3297 ¹	15,5305 ¹
Clase 2U	12,3404	15,9419	16,0307
Clase 8E	5,1045 ¹	5,8070 ¹	5,5302 ¹
Clase 8U	5,0640	6,5431	6,5821

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 contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		99.127.304
Ingresos		
Dividendos, neto	2	392.082
Interés bancario	2	75.446
Ingresos por intereses en swaps		79.649
Total de ingresos		547.177
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(623.304)
Interés bancario	2	(4.744)
Dividendos pagados en swaps		(88.851)
Gastos por intereses en swaps		(304.865)
Gastos operativos	3, 5	(80.255)
Total de gastos		(1.102.019)
(Pérdida) neta de inversiones		(554.842)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(776.019)
Ganancia neta realizada en swaps		1.276.355
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(62.144)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(46.233)
Ganancia neta realizada		391.959
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(19.046.774)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(3.239.225)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(18.117)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(22.304.116)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(22.466.999)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		2.913.894
Reembolsos de acciones		(5.262.190)
Total de movimientos de capital		(2.348.296)
Patrimonio neto al final del periodo		74.312.009

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	74.312.009	99.127.304	209.555.266

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	335.735.697
Efectivo en el banco	2	40.488.366
Suscripciones por cobrar		163.366
Interés y dividendos por cobrar, neto		24.660
Otros activos		1.498
Total de activos		376.413.587
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(6.414.201)
Interés pagadero en swaps	2	(28.673)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(2.667.386)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(18.968.632)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(87.832)
Otros pasivos		(36.376)
Total de pasivos		(28.203.100)
Total de patrimonio neto		348.210.487

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	326.058,311
Clase AFH	246.441,729
Clase AGH	65.250,229
Clase ASH	1.188.832,304
Clase AU	1.853.720,538
Clase DEH	203.277,082
Clase DU	532.234,945
Clase IEH	345.151,815
Clase IG	64,000
Clase IGH	2.733.760,438
Clase IU	143.286,070
Clase NG	52.987,388
Clase XU	11.454.921,832
Clase ZEH	28.401,630
Clase ZFH	160,000
Clase ZGH	303.337,694
Clase ZU	15.781,123

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2022

	Notas	2022 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		547.084.733
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	1.903.849
Interés bancario	2	156.175
Ingresos por intereses en swaps		23.495
Total de ingresos		2.083.519
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(695.005)
Interés bancario	2	(7.421)
Gastos por intereses en swaps		(475.736)
Gastos operativos	3, 5	(375.194)
Comisiones varias	4	(1.194)
Total de gastos		(1.554.550)
Ingresos netos de inversiones		528.969
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		533.918
(Pérdida) neta realizada en swaps		(3.355.504)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(11.472.545)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(432.349)
(Pérdida) neta realizada		(14.726.480)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(15.495)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(36.825.763)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(3.874.305)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(40.715.563)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(54.913.074)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		75.859.873
Reembolsos de acciones		(219.821.045)
Total de movimientos de capital		(143.961.172)
Patrimonio neto al final del periodo		348.210.487

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	348.210.487	547.084.733	528.893.598

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2022	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	10,9109 ¹	12,2529 ¹	8,4906 ¹
Clase AFH	8,0309 ²	9,0157 ²	6,2739 ²
Clase AGH	11,7954 ³	13,1736 ³	9,0951 ³
Clase ASH	6,2369 ⁴	6,9266 ⁴	4,7702 ⁴
Clase AU	13,1558	14,5604	10,0129
Clase DEH	8,2372 ¹	9,2625 ¹	6,4457 ¹
Clase DU	9,9366	11,0114	7,6039
Clase IEH	16,2019 ¹	18,1687 ¹	12,4903 ¹
Clase IG	16,4532 ³	15,4257 ³	10,0476 ³
Clase IGH	17,4793 ³	19,4921 ³	13,3493 ³
Clase IU	19,5150	21,5661	14,7124
Clase NG	15,9426 ³	14,9110 ³	9,6735 ³
Clase XU	20,8738	22,9751	15,5436
Clase ZEH	6,8400 ¹	7,6710 ¹	5,2751 ¹
Clase ZFH	6,5896 ²	7,3902 ²	5,1075 ²
Clase ZGH	9,9994 ³	11,1531 ³	7,6437 ³
Clase ZU	8,0437	8,8906	6,0682

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 30 de septiembre 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					
EUR	3.306.000	APA Infrastructure Limited 1.25% 15/03/2033	2.251.619	0,42	EUR	4.295.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	3.497.351	0,65
EUR	1.000.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	703.770	0,13	Total de Finlandia				
EUR	1.030.000	Ausgrid Finance Pty Limited 1.25% 30/07/2025	943.829	0,18	FRANCIA				
USD	1.708.000	Ausgrid Finance Pty Limited 4.35% 01/08/2028	1.584.368	0,29	EUR	2.800.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	1.846.837	0,34
EUR	1.372.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	1.236.578	0,23	EUR	2.200.000	Electricite de France SA - Perp FRN	1.519.130	0,28
USD	2.315.000	SGSP Australia Assets Pty 3.50% 07/07/2027	2.115.309	0,39	EUR	2.185.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	1.456.316	0,27
Total de Australia			8.835.473	1,64	EUR	1.200.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 0.63% 08/07/2032	873.298	0,16
BERMUDAS				Total de Francia					
USD	2.222.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	1.910.314	0,36	EUR	2.300.000	Sanef SA 1.88% 16/03/2026	2.113.110	0,39
Total de Bermudas			1.910.314	0,36	ALEMANIA				
ISLAS CAIMÁN				ALEMANIA					
USD	732.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	561.655	0,10	EUR	800.000	Adler Real Estate AG 3.00% 27/04/2026	546.906	0,10
GBP	2.080.000	Southern Water Services Finance Limited 1.63% 30/03/2027	1.887.360	0,35	EUR	1.500.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	1.205.565	0,22
GBP	1.404.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	1.264.477	0,24	EUR	5.800.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	3.931.910	0,74
GBP	2.060.000	Southern Water Services Finance Limited 3.00% 28/05/2037	1.565.401	0,29	EUR	2.200.000	Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032	2.120.085	0,39
USD	566.000	Tencent Holdings Limited 3.24% 03/06/2050	343.472	0,06	EUR	1.700.000	BASF SE 3.75% 29/06/2032	1.576.828	0,29
USD	1.008.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	909.395	0,17	EUR	1.600.000	Commerzbank AG FRN 29/12/2031	1.224.574	0,23
USD	1.000.000	Tencent Holdings Limited 3.93% 19/01/2038	774.750	0,14	EUR	3.200.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	2.858.234	0,53
Total de Islas Caimán			7.306.510	1,35	EUR	388.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	357.483	0,07
DINAMARCA				DINAMARCA					
EUR	476.000	Danske Bank AS FRN 15/05/2031	390.703	0,07	EUR	1.500.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	1.114.144	0,20
Total de Dinamarca			390.703	0,07	USD	1.610.000	Deutsche Bank AG FRN 28/05/2032	1.157.121	0,22
					EUR	1.300.000	Deutsche Bank AG FRN 05/09/2030	1.199.052	0,22
					EUR	349.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	293.732	0,05
					EUR	1.600.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	1.036.020	0,19
					EUR	200.000	Vier Gas Transport GmbH 0.13% 10/09/2029	142.526	0,03
					EUR	100.000	Vier Gas Transport GmbH 0.50% 10/09/2034	59.294	0,01
					EUR	1.800.000	Vier Gas Transport GmbH 4.00% 26/09/2027	1.731.652	0,32
					EUR	5.400.000	Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	5.175.340	0,96

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	1.091.000	Volkswagen Financial Services AG 3.38% 06/04/2028	1.026.729	0,19	USD	1.447.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	1.122.057	0,21	
EUR	1.508.000	Volkswagen Leasing GmbH 0.63% 19/07/2029	1.148.716	0,21	USD	2.325.471	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.94% 30/09/2040	1.777.678	0,32	
EUR	1.100.000	Vonovia SE 1.50% 14/06/2041	588.313	0,11	EUR	1.376.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	1.035.896	0,19	
EUR	2.500.000	Vonovia SE 1.88% 28/06/2028	2.084.198	0,39	EUR	1.200.000	Heathrow Funding Limited 1.88% 14/03/2034	831.557	0,15	
Total de Alemania				30.578.422	5,67	Total de Jersey - Islas del Canal		4.767.188	0,87	
INDIA				LUXEMBURGO						
USD	1.830.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	1.538.468	0,29	EUR	1.800.000	Aroundtown SA 0.00% 16/07/2026	1.394.640	0,26	
USD	1.380.000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	1.120.367	0,22	EUR	2.900.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	2.154.435	0,40	
Total de India				2.658.835	0,51	EUR	1.100.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	811.957	0,15
IRLANDA				PAÍSES BAJOS						
EUR	2.330.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	2.062.144	0,38	EUR	302.000	Airbus SE 2.38% 09/06/2040	224.667	0,04	
EUR	1.100.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	937.798	0,17	EUR	746.000	Akelius Residential Property Financing BV 0.75% 22/02/2030	522.578	0,10	
EUR	1.882.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	1.509.148	0,28	Total de Luxemburgo					
EUR	3.000.000	Experian Europe Dac 1.56% 16/05/2031	2.417.426	0,45	23.082.705					
EUR	2.000.000	Glencore Capital Finance Dac 0.75% 01/03/2029	1.472.364	0,28	4,28					
Total de Irlanda				8.398.880	1,56					
ITALIA										
EUR	427.000	Aeroporti di Roma SpA 1.63% 02/02/2029	334.413	0,06						
EUR	598.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	420.830	0,08						
EUR	100.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	70.373	0,01						
EUR	950.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 26/09/2029	691.461	0,13						
EUR	801.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	606.887	0,11						
EUR	1.684.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	1.173.786	0,22						
EUR	749.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	596.108	0,11						
EUR	673.000	ENI SpA - Perp FRN	499.500	0,09						
EUR	559.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	469.259	0,09						
Total de Italia				4.862.617	0,90					

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)				ESPAÑA				
EUR	800.000 Diageo Capital BV 1.88% 08/06/2034	641.648	0,12	GBP	1.800.000 Banco Santander SA FRN 30/08/2028	1.832.042	0,34	
EUR	1.090.000 Diageo Capital BV 1.88% 08/06/2034	874.246	0,16	EUR	309.000 Nortegas Energia Distribucion SA 2.07% 28/09/2027	270.194	0,05	
EUR	3.970.000 Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	2.989.373	0,56	Total de España			2.102.236	0,39
EUR	900.000 Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	599.568	0,11	SUECIA				
EUR	1.193.000 Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	794.760	0,15	EUR	2.254.000 Sagax AB 1.13% 30/01/2027	1.769.725	0,33	
GBP	2.414.000 E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	2.603.689	0,48	EUR	573.000 Sagax AB 2.00% 17/01/2024	540.076	0,10	
USD	1.025.000 ING Groep NV FRN 28/03/2033	870.115	0,16	Total de Suecia			2.309.801	0,43
EUR	1.869.000 Nederlandse Gasunie NV 3.38% 11/07/2034	1.691.383	0,31	SUIZA				
EUR	400.000 Nederlandse Gasunie NV 3.38% 11/07/2034	361.987	0,07	EUR	1.814.000 Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	1.348.907	0,25	
EUR	2.410.000 Sagax Euro MTN BV 0.75% 26/01/2028	1.699.419	0,32	USD	4.404.000 Credit Suisse Group AG FRN 14/05/2032	3.095.668	0,58	
GBP	820.000 Shell International Finance BV 1.75% 10/09/2052	426.259	0,08	USD	1.000.000 Credit Suisse Group AG FRN 01/04/2031	787.492	0,15	
EUR	1.040.000 Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	807.893	0,15	USD	330.000 Credit Suisse Group AG - Perp FRN	304.293	0,06	
EUR	1.391.000 Stedin Holding NV 2.38% 03/06/2030	1.225.954	0,23	EUR	2.697.000 UBS AG 0.50% 31/03/2031	1.980.379	0,37	
EUR	400.000 Stedin Holding NV 2.38% 03/06/2030	352.539	0,07	USD	530.000 UBS Group AG - Perp FRN	450.426	0,08	
EUR	3.300.000 Stedin Holding NV - Perp FRN	2.571.451	0,48	USD	900.000 UBS Group AG - Perp FRN	856.125	0,16	
EUR	1.000.000 Telefonica Europe BV - Perp FRN	698.145	0,13	USD	768.000 UBS Group Funding Switzerland AG - Perp FRN	728.122	0,14	
EUR	500.000 Telefonica Europe BV - Perp FRN	464.105	0,09	Total de Suiza			9.551.412	1,79
EUR	3.883.000 TenneT Holding BV - Perp FRN	3.448.102	0,65	REINO UNIDO				
EUR	872.000 Thermo Fisher Scientific Finance I BV 1.63% 18/10/2041	566.879	0,11	EUR	1.201.000 Anglo American Capital plc 4.75% 21/09/2032	1.138.785	0,21	
EUR	2.100.000 Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	1.673.799	0,31	USD	691.000 Anglo American Capital plc 4.75% 16/03/2052	531.682	0,10	
EUR	2.100.000 Universal Music Group NV 3.75% 30/06/2032	1.924.849	0,36	USD	7.579.000 Bae Systems plc 3.40% 15/04/2030	6.575.990	1,23	
EUR	900.000 Vonovia Finance BV 1.00% 28/01/2041	430.610	0,08	USD	2.457.000 Barclays plc FRN 24/11/2032	1.775.415	0,33	
Total de Países Bajos			28.464.018	5,32	USD	2.063.000 Barclays plc FRN 09/08/2033	1.878.800	0,35
NORUEGA				GBP	509.000 BAT International Finance plc 2.25% 26/06/2028	420.855	0,08	
EUR	1.754.000 DNB Bank ASA FRN 21/09/2027	1.683.620	0,31	EUR	2.023.000 BP Capital Markets plc - Perp FRN	1.766.591	0,33	
Total de Noruega			1.683.620	0,31	USD	2.001.000 BP Capital Markets plc - Perp FRN	1.857.178	0,35
				EUR	2.459.000 British American Tobacco plc - Perp FRN	1.782.207	0,33	
				GBP	750.000 Broadgate Financing plc 5.00% 05/10/2031	763.972	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)				
REINO UNIDO (continuación)				REINO UNIDO (continuación)				
GBP	476.150 Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	472.544	0,09	GBP	485.584 Tesco Property Finance 6 plc 5.41% 13/07/2044	457.256	0,09	
EUR	1.000.000 Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	732.257	0,14	GBP	1.120.000 Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	1.044.026	0,19	
EUR	2.591.000 Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	1.897.277	0,35	EUR	4.198.000 Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	3.402.385	0,63	
EUR	707.000 Cadent Finance plc 0.75% 11/03/2032	485.626	0,09	GBP	1.010.000 Virgin Money UK plc FRN 19/08/2031	872.898	0,16	
GBP	1.626.000 Ds Smith plc 2.88% 26/07/2029	1.384.223	0,26	EUR	1.817.000 Western Power Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	1.713.009	0,32	
EUR	2.875.000 DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	2.399.831	0,44	Total de Reino Unido			57.438.891	10,66
EUR	424.000 HBOS plc FRN 18/03/2030	395.934	0,07	ESTADOS UNIDOS				
EUR	28.000 HBOS plc FRN 18/03/2030	26.147	0,00	USD	2.762.000 AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	2.229.915	0,42	
GBP	1.398.000 HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	1.335.022	0,25	USD	1.217.000 AbbVie Inc. 4.88% 14/11/2048	1.077.314	0,20	
USD	2.701.000 HSBC Holdings plc FRN 22/11/2032	1.977.753	0,37	USD	875.000 AEP Texas Inc. 3.45% 15/05/2051	607.470	0,11	
USD	2.585.000 HSBC Holdings plc FRN 11/08/2033	2.301.998	0,43	USD	1.565.000 Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	1.371.179	0,26	
GBP	453.000 Imperial Brands Finance plc 5.50% 28/09/2026	465.802	0,09	USD	1.805.000 Amgen Inc. 3.15% 21/02/2040	1.304.618	0,24	
EUR	773.000 International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	677.550	0,13	USD	831.000 Amgen Inc. 4.20% 22/02/2052	655.821	0,12	
GBP	520.000 Legal & General Group FRN 27/06/2064	440.702	0,08	USD	600.000 Amgen Inc. 4.88% 01/03/2053	530.828	0,10	
GBP	278.000 Legal & General Group plc FRN 01/11/2050	239.652	0,04	USD	2.012.000 Anheuser-Busch Companies LLC 4.70% 01/02/2036	1.816.743	0,34	
EUR	780.000 National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	551.494	0,10	USD	540.000 Anheuser-Busch Companies LLC 4.90% 01/02/2046	469.422	0,09	
EUR	4.826.000 National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	3.412.195	0,63	USD	2.574.000 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	2.457.904	0,45	
GBP	720.000 National Grid plc 3.50% 16/10/2026	715.592	0,13	EUR	854.000 Ardagh Metal Packaging Finance LLC 2.00% 01/09/2028	641.315	0,12	
EUR	3.435.000 Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	2.666.885	0,50	USD	4.127.000 AT&T Inc. 3.50% 15/09/2053	2.759.545	0,51	
USD	3.264.000 Nationwide Building Society 1.50% 13/10/2026	2.779.589	0,51	CAD	1.500.000 AT&T Inc. 4.00% 25/11/2025	1.055.850	0,20	
GBP	458.000 NatWest Group plc - Perp FRN	384.599	0,07	USD	1.997.000 AT&T Inc. 4.90% 15/08/2037	1.774.035	0,33	
EUR	2.505.000 NGG Finance plc FRN 05/09/2082	1.948.082	0,36	USD	1.350.000 Bank of America Corp. FRN 21/07/2032	1.009.944	0,19	
GBP	683.000 Phoenix Group Holdings plc 5.63% 28/04/2031	605.436	0,11	USD	1.617.000 Bank of America Corp. FRN 13/02/2031	1.279.518	0,24	
GBP	270.000 Santander UK plc - Perp 10.06%	465.381	0,09	USD	1.933.000 Bank of America Corp. FRN 29/04/2031	1.533.369	0,29	
GBP	1.121.000 Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	1.070.793	0,20	USD	6.976.000 Bank of America Corp. FRN 11/03/2032	5.440.934	1,01	
GBP	413.952 Tesco Property Finance 7.62% 13/07/2039	473.391	0,09	USD	3.000.000 Bank of America Corp. FRN 04/02/2033	2.356.182	0,44	
GBP	1.197.771 Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	1.152.087	0,20	USD	1.488.000 Bank of America Corp. FRN 23/07/2030	1.256.023	0,23	
				USD	2.100.000 Bayer US Finance II LLC 4.63% 25/06/2038	1.742.429	0,33	

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	4.451.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 3.85% 15/03/2052	3.417.193	0,63	USD	930.000	Georgia Power Company 5.13% 15/05/2052	844.776	0,16
USD	844.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 4.25% 15/01/2049	702.472	0,13	USD	327.000	Goodman USA Finance Three 3.70% 15/03/2028	296.648	0,06
USD	2.011.000	Boeing Company 3.95% 01/08/2059	1.257.182	0,23	USD	3.245.000	HCA Inc. 5.88% 01/02/2029	3.162.151	0,59
USD	950.000	Boeing Company 5.93% 01/05/2060	818.147	0,15	USD	228.000	Intel Corp. 4.75% 25/03/2050	196.891	0,04
USD	693.000	Bristol-Myers Squibb Company 3.70% 15/03/2052	533.696	0,10	USD	762.000	Intel Corp. 4.90% 05/08/2052	673.886	0,13
USD	1.025.000	Broadcom Inc. 4.15% 15/11/2030	887.949	0,17	EUR	1.119.000	IQVIA Inc. 1.75% 15/03/2026	950.909	0,18
USD	1.133.000	Charter Communications Operating LLC 3.90% 01/06/2052	703.883	0,13	EUR	400.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	315.795	0,06
USD	1.663.000	Charter Communications Operating LLC 3.95% 30/06/2062	993.764	0,19	EUR	330.000	IQVIA Inc. 2.88% 15/09/2025	304.754	0,06
USD	3.020.000	Citigroup Inc. FRN 31/03/2031	2.717.213	0,51	USD	1.710.000	JPMorgan Chase & Company FRN 04/02/2032	1.264.933	0,24
USD	343.000	Commonwealth Edison Company 4.00% 01/03/2049	274.861	0,05	USD	3.423.000	JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	2.597.015	0,48
USD	250.000	Conagra Brands Inc. 5.40% 01/11/2048	216.890	0,04	USD	6.743.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	5.224.394	0,97
USD	303.000	Consolidated Edison Company of New York Inc. 3.95% 01/04/2050	234.642	0,04	USD	1.358.000	JPMorgan Chase & Company FRN 25/01/2033	1.065.703	0,20
USD	150.000	CSX Corp. 3.80% 01/11/2046	115.025	0,02	USD	1.591.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	1.295.592	0,24
USD	726.000	CSX Corp. 3.80% 15/04/2050	547.919	0,10	GBP	3.700.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	3.663.488	0,68
EUR	995.000	Eli Lilly & Company 1.38% 14/09/2061	501.760	0,09	USD	312.000	Kraft Heinz Foods Company 4.38% 01/06/2046	245.245	0,05
USD	960.000	Emera USA Finance LP 4.75% 15/06/2046	751.688	0,14	USD	2.351.000	Lowe's Companies Inc. 5.80% 15/09/2062	2.168.645	0,41
USD	1.902.000	Enterprise Products Operating LLC 4.45% 15/02/2043	1.533.876	0,29	EUR	6.572.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	5.526.657	1,04
USD	3.515.000	Eversource Energy 2.55% 15/03/2031	2.813.449	0,52	EUR	2.443.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	2.119.778	0,39
USD	1.972.000	Eversource Energy 3.38% 01/03/2032	1.666.609	0,31	USD	1.425.000	Nisource Inc. 4.38% 15/05/2047	1.135.737	0,21
USD	580.000	Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	404.069	0,08	USD	4.327.000	Nisource Inc. 4.80% 15/02/2044	3.637.068	0,68
USD	441.000	Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	307.232	0,06	USD	563.000	Nisource Inc. 5.00% 15/06/2052	492.345	0,09
USD	2.196.000	Eversource Energy 4.20% 27/06/2024	2.162.858	0,40	USD	2.192.000	Oracle Corp. 2.88% 25/03/2031	1.722.090	0,32
EUR	700.000	Fidelity National Information Services Inc 1.50% 21/05/2027	613.831	0,11	USD	1.176.000	Oracle Corp. 3.60% 01/04/2040	798.216	0,15
EUR	917.000	Fidelity National Information Services Inc 1.50% 21/05/2027	804.119	0,15	USD	1.200.000	Oracle Corp. 3.65% 25/03/2041	817.770	0,15
USD	1.750.000	General Motors Financial Company Inc. 2.40% 15/10/2028	1.384.336	0,26	USD	3.342.000	Pacific Gas and Electric Company 4.95% 01/07/2050	2.471.749	0,46
USD	491.000	Georgia Power Company 3.70% 30/01/2050	355.111	0,07	USD	640.000	Piedmont Natural Gas Company Inc. 3.35% 01/06/2050	426.374	0,08
					USD	524.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	436.694	0,08
					USD	1.839.000	Plains All American Pipeline LP 4.70% 15/06/2044	1.322.249	0,25
					USD	726.000	PPL Electric Utilities Corp 4.15% 15/06/2048	600.781	0,11
					USD	1.565.000	Relx Capital Inc. 3.50% 16/03/2023	1.554.840	0,29
					USD	1.340.000	Relx Capital Inc. 4.75% 20/05/2032	1.255.844	0,23

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 (continuación)						
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ALEMANIA						
USD	460.000	Southern California Edison Company 3.65% 01/02/2050	316.390	0,06	EUR	1.700.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2052	898.719	0,17	
USD	654.000	Southern California Edison Company 4.13% 01/03/2048	487.983	0,09	EUR	2.780.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 15/09/2028	2.338.116	0,43	
EUR	1.105.000	Southern Company FRN 15/09/2081	761.243	0,14	GBP	6.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.00% 15/12/2022	6.665.705	1,24	
EUR	615.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	380.163	0,07	Total de Alemania			9.902.540	1,84	
GBP	1.300.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	1.271.383	0,24	JAPÓN					
USD	934.000	T-Mobile USA Inc. 2.63% 15/02/2029	774.384	0,14	JPY	191.000.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.40% 20/06/2049	1.049.751	0,20	
USD	1.760.000	T-Mobile USA Inc. 2.88% 15/02/2031	1.416.214	0,26	Total de Japón			1.049.751	0,20	
USD	1.440.000	T-Mobile USA Inc. 3.40% 15/10/2052	956.225	0,18	SUPRANACIONAL					
USD	1.693.000	T-Mobile USA Inc. 5.80% 15/09/2062	1.579.163	0,29	EUR	2.300.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.00% 15/01/2027	2.006.514	0,37	
USD	566.000	TSMC Arizona Corp. 2.50% 25/10/2031	450.694	0,08	USD	5.465.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 11/03/2025	5.014.248	0,93	
USD	1.618.000	UnitedHealth Group Inc. 4.95% 15/05/2062	1.458.094	0,27	USD	4.000.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 24/11/2027	3.369.308	0,63	
USD	3.601.000	Verizon Communications Inc. 4.40% 01/11/2034	3.173.585	0,59	Total de supranacional			10.390.070	1,93	
USD	1.790.000	Williams Partners LP 2.60% 15/03/2031	1.406.904	0,26	REINO UNIDO					
USD	1.136.000	Williams Partners LP 4.85% 01/03/2048	946.737	0,18	GBP	2.208.000	United Kingdom Gilt 0.13% 31/01/2028	1.982.283	0,37	
Total de Estados Unidos			124.058.311	23,12	GBP	2.908.000	United Kingdom Gilt 1.75% 07/09/2037	2.369.174	0,44	
ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)				Total de Reino Unido				4.351.457	0,81	
USD	879.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	828.370	0,15	ESTADOS UNIDOS					
Total de Islas Vírgenes (Británicas)			828.370	0,15	USD	7.685.000	United States Treasury N/B 0.38% 15/07/2024	7.178.871	1,33	
Total de bonos				330.534.348	61,47	USD	17.800.000	United States Treasury N/B 0.38% 30/09/2027	14.846.313	2,76
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				ESTADOS UNIDOS						
CANADÁ				USD 13.904.000 United States Treasury N/B 1.13% 15/08/2040				8.623.738	1,60	
CAD	5.008.000	Canada (Govt of) 1.00% 01/09/2026	3.321.089	0,62	USD	2.108.000	United States Treasury N/B 1.25% 15/05/2050	1.183.774	0,22	
CAD	2.857.000	Canada (Govt of) 2.75% 01/12/2048	1.937.477	0,36	USD	10.200.000	United States Treasury N/B 2.00% 15/11/2041	7.305.749	1,36	
Total de Canadá			5.258.566	0,98	USD	212.000	United States Treasury N/B 2.00% 15/02/2050	146.098	0,03	

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 (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)							
USD	35.033.000	United States Treasury N/B 2.75% 30/04/2027	33.067.865	6,14	USD	1.380.000	Verizon Communications Inc. 2.36% 15/03/2032	1.065.638	0,20		
USD	23.036.100	United States Treasury N/B 2.88% 30/04/2029	21.502.760	4,00	USD	6.297.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	4.589.864	0,85		
USD	5.178.000	United States Treasury N/B 2.88% 15/05/2032	4.784.391	0,89	USD	2.589.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.39% 15/03/2062	1.882.629	0,35		
Total de Estados Unidos			98.639.559	18,33	Total de Estados Unidos			18.598.471	3,45		
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				129.591.943	24,09	Total de bonos				24.944.817	4,63
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				460.126.291	85,56	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				24.944.817	4,63
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario							
Bonos				Bonos							
AUSTRALIA				AUSTRALIA							
USD	6.228.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	5.693.519	1,05	USD	1.347.000	APA Infrastructure Limited 4.25% 15/07/2027	1.249.147	0,23		
Total de Australia			5.693.519	1,05	Total de Australia			1.249.147	0,23		
PAÍSES BAJOS				CANADÁ							
USD	249.000	E.ON International Finance BV 6.65% 30/04/2038	245.909	0,05	CAD	1.980.000	Rogers Communications Inc. 3.65% 31/03/2027	1.348.009	0,25		
USD	409.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	406.918	0,08	Total de Canadá			1.348.009	0,25		
Total de Países Bajos			652.827	0,13	DINAMARCA						
USD	1.701.000	Atlantic City Electric 2.30% 15/03/2031	1.383.823	0,26	USD	4.727.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	3.970.058	0,74		
USD	1.205.000	Broadcom Inc. 4.93% 15/05/2037	1.001.188	0,18	Total de Dinamarca			3.970.058	0,74		
USD	5.013.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	4.138.624	0,77	FRANCIA						
USD	2.800.000	HCA Inc. 3.63% 15/03/2032	2.268.174	0,42	USD	2.384.000	BNP Paribas SA FRN 15/09/2029	1.871.477	0,35		
USD	608.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.63% 30/09/2059	417.030	0,08	USD	1.300.000	BNP Paribas SA FRN 20/01/2033	991.654	0,18		
USD	2.267.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.27% 15/05/2047	1.851.501	0,34	USD	1.816.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	1.498.767	0,28		
Total de Francia			4.887.401	0,91	USD	567.000	BPCE SA FRN 19/07/2033	525.503	0,10		
ITALIA				ITALIA							
USD	300.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	247.381	0,05	Total de Italia			247.381	0,05		

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*		
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios					
Bonos (continuación)				Fondos					
NORUEGA				IRLANDA					
USD	2.317.000	DNB Bank ASA 1.13% 16/09/2026	2.024.082	0,38	6.922	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	6.922	0,00	
Total de Noruega			2.024.082	0,38	Total de Irlanda			6.922	0,00
PORTUGAL				Total de fondos					
EUR	200.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	17.634	0,00	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			6.922	0,00
Total de Portugal			17.634	0,00	Valor total de las inversiones			516.595.443	96,05
ESTADOS UNIDOS				(Coste total: 645.933.436 USD)					
USD	879.000	American Transmission Systems Inc. 2.65% 15/01/2032	690.652	0,13	<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>				
USD	2.033.000	Broadcom Inc. 2.45% 15/02/2031	1.535.518	0,28	<i>** Titulo a su valor razonable.</i>				
USD	784.000	Goodman US Finance Five LLC 4.63% 04/05/2032	720.506	0,13					
USD	568.000	Guardian Life Insurance Company of America 4.85% 24/01/2077	467.090	0,09					
USD	2.112.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	1.676.160	0,31					
USD	1.406.000	Metropolitan Edison Company 4.30% 15/01/2029	1.314.165	0,24					
USD	3.200.000	Metropolitan Life Global Funding I 1.55% 07/01/2031	2.411.945	0,45					
USD	493.000	New York Life Insurance Company 4.45% 04/04/2069	397.688	0,07					
USD	3.530.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.45% 30/03/2051	2.448.471	0,46					
USD	394.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.85% 30/09/2047	298.491	0,06					
USD	495.000	Peachtree Fund Trust 3.98% 15/02/2025	477.847	0,09					
USD	2.522.000	Roche Holdings Inc. 1.93% 13/12/2028	2.118.564	0,39					
USD	1.850.000	Stellantis Finance US Inc. 6.38% 12/09/2032	1.721.117	0,32					
USD	1.689.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.90% 15/09/2044	1.495.487	0,28					
Total de Estados Unidos			17.773.701	3,30					
Total de bonos			31.517.413	5,86					
Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			31.517.413	5,86					

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	678.000 Medtronic Global Holdings SCA 1.38% 15/10/2040	449.192	0,47	EUR	339.000 Stedin Holding NV 2.38% 03/06/2030	304.983	0,32
EUR	542.000 Novartis Finance SA 0.00% 23/09/2028	448.722	0,47	EUR	867.000 Stedin Holding NV - Perp FRN	689.624	0,73
EUR	665.000 P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	494.037	0,52	EUR	300.000 Telefonica Europe BV - Perp FRN	230.621	0,24
EUR	500.000 Selp Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	462.169	0,49	EUR	600.000 Telefonica Europe BV - Perp FRN	568.494	0,61
	Total de Luxemburgo	4.870.506	5,14	EUR	485.000 TenneT Holding BV 1.63% 17/11/2026	456.333	0,48
				EUR	753.000 TenneT Holding BV 2.13% 17/11/2029	685.340	0,72
PAÍSES BAJOS				EUR	567.000 TenneT Holding BV - Perp FRN	513.955	0,54
EUR	300.000 Airbus SE 2.38% 09/06/2040	227.815	0,24	EUR	438.000 Thermo Fisher Scientific Finance I BV 1.63% 18/10/2041	290.655	0,31
EUR	361.000 Akelius Residential Property Financing BV 0.75% 22/02/2030	258.136	0,27	EUR	400.000 Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	325.442	0,34
EUR	174.000 Akelius Residential Property Financing BV 1.13% 11/01/2029	134.574	0,14	EUR	548.000 Unilever Finance Netherlands BV 1.75% 16/11/2028	504.366	0,53
EUR	265.000 Alliander NV 2.63% 09/09/2027	257.226	0,27	EUR	278.000 Universal Music Group NV 3.75% 30/06/2032	260.107	0,27
EUR	300.000 Allianz Finance II BV 0.00% 22/11/2026	263.883	0,28	EUR	700.000 Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	637.404	0,67
EUR	302.000 Diageo Capital BV 1.88% 08/06/2034	247.254	0,26	EUR	300.000 Vonovia Finance BV 1.00% 28/01/2041	146.518	0,15
EUR	684.000 Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	525.744	0,56	EUR	249.000 Wolters Kluwer NV 3.00% 23/09/2026	246.121	0,26
EUR	160.000 Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	108.804	0,11		Total de Países Bajos	14.745.184	15,55
EUR	345.000 Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	234.609	0,25	NORUEGA			
EUR	482.000 Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	358.456	0,38	EUR	800.000 DNB Bank ASA FRN 23/02/2029	648.450	0,68
EUR	556.000 Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	413.488	0,44		Total de Noruega	648.450	0,68
EUR	590.000 Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	457.566	0,48	ESPAÑA			
EUR	300.000 ING Groep NV FRN 01/02/2030	226.372	0,24	GBP	500.000 Banco Santander SA FRN 30/08/2028	519.472	0,55
EUR	300.000 ING Groep NV FRN 29/09/2028	243.862	0,26		Total de España	519.472	0,55
EUR	300.000 ING Groep NV FRN 29/11/2030	230.046	0,24	SUECIA			
EUR	500.000 ING Groep NV FRN 16/02/2031	406.134	0,43	EUR	560.000 Sagax AB 1.13% 30/01/2027	448.817	0,47
EUR	437.000 Nederlandse Gasunie NV 3.38% 11/07/2034	403.686	0,43	EUR	466.000 Swedbank AB 0.25% 02/11/2026	407.791	0,43
EUR	1.301.000 Relx Finance 1.00% 22/03/2024	1.261.431	1,33		Total de Suecia	856.608	0,90
EUR	257.000 Rentokil Initial Finance BV 4.38% 27/06/2030	254.099	0,27	SUIZA			
EUR	445.000 Royal Schiphol Group NV 0.75% 22/04/2033	318.668	0,34	EUR	414.000 Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	314.249	0,33
EUR	640.000 Sagax Euro MTN BV 0.75% 26/01/2028	460.673	0,49				
EUR	345.000 Shell International Finance BV 1.88% 07/04/2032	295.417	0,31				
EUR	1.636.000 Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	1.297.278	1,36				

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 (continuación)				REINO UNIDO (continuación)					
EUR	674.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	404.267	0,43	EUR	881.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	698.204	0,74
EUR	145.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	86.971	0,09	USD	898.000	Nationwide Building Society 1.50% 13/10/2026	780.613	0,82
EUR	200.000	Credit Suisse Group AG FRN 02/04/2032	155.155	0,16	EUR	570.000	NatWest Group plc FRN 26/02/2030	434.289	0,46
EUR	603.000	UBS AG 0.50% 31/03/2031	451.974	0,48	USD	850.000	NatWest Markets plc 1.60% 29/09/2026	738.874	0,78
	Total de Suiza		1.412.616	1,49	EUR	751.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	596.168	0,63
REINO UNIDO				ESTADOS UNIDOS					
EUR	213.000	Anglo American Capital plc 4.75% 21/09/2032	206.161	0,22	EUR	1.644.000	AbbVie Inc. 0.75% 18/11/2027	1.420.810	1,50
EUR	181.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	127.439	0,13	EUR	317.000	Ardagh Metal Packaging Finance LLC 2.00% 01/09/2028	242.997	0,26
EUR	336.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	236.571	0,25	EUR	341.000	AT&T Inc. 1.80% 14/09/2039	231.025	0,24
EUR	534.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	476.004	0,50	EUR	200.000	AT&T Inc. 1.80% 14/09/2039	135.498	0,14
EUR	415.000	British American Tobacco plc - Perp FRN	307.027	0,32	EUR	437.000	AT&T Inc. 3.15% 04/09/2036	373.795	0,39
EUR	51.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	38.121	0,04	EUR	92.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	70.310	0,07
EUR	489.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	365.512	0,39	EUR	634.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	484.528	0,51
EUR	252.000	Cadent Finance plc 0.75% 11/03/2032	176.690	0,19	EUR	393.000	Bank of America Corp. FRN 27/04/2033	338.794	0,36
GBP	521.448	Delamare Finance plc 5.55% 19/02/2029	577.166	0,61	EUR	265.000	Bank of America Corp. FRN 31/03/2029	256.298	0,27
EUR	550.000	Diageo Finance plc 0.50% 19/06/2024	528.132	0,56	EUR	519.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 1.50% 18/03/2030	435.813	0,46
EUR	330.000	Diageo Finance plc 1.00% 22/04/2025	314.252	0,33	EUR	278.000	Eli Lilly & Company 1.38% 14/09/2061	143.102	0,15
EUR	332.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	282.886	0,30	EUR	185.000	Exxon Mobil Corp. 0.52% 26/06/2028	157.658	0,17
EUR	280.000	Glaxosmithkline Capital plc 0.00% 23/09/2023	272.294	0,29	EUR	251.000	Fidelity National Information Services Inc 1.50% 21/05/2027	224.674	0,24
EUR	571.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	544.280	0,57	EUR	358.000	Fidelity National Information Services Inc 2.00% 21/05/2030	301.838	0,31
USD	484.000	HSBC Holdings plc FRN 11/08/2033	439.966	0,46	EUR	343.000	Fiserv Inc. 1.63% 01/07/2030	280.594	0,30
EUR	766.000	Imperial Brands Finance plc 3.38% 26/02/2026	724.682	0,77	EUR	485.000	General Motors Financial Company Inc. 0.60% 20/05/2027	395.104	0,42
EUR	294.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	263.050	0,28					
EUR	328.000	Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	265.435	0,28					
EUR	735.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	530.473	0,56					
EUR	368.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	265.597	0,28					

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	402.000	Goldman Sachs Group Inc. 1.00% 18/03/2033	279.920	0,30	EUR	1.214.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.00% 15/01/2027	1.081.091	1,14
EUR	327.000	IQVIA Inc. 1.75% 15/03/2026	283.652	0,30			Total de supranacional	2.770.614	2,92
EUR	486.000	JPMorgan Chase & Company FRN 17/02/2033	345.672	0,36			Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda	7.940.329	8,38
EUR	625.000	JPMorgan Chase & Company FRN 23/03/2030	541.197	0,57			Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	85.492.142	90,23
EUR	505.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	455.016	0,48			Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		
EUR	1.268.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	1.088.462	1,15			Bonos		
EUR	488.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	432.231	0,46			PAÍSES BAJOS		
EUR	281.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	177.309	0,19	USD	1.150.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	1.167.912	1,24
EUR	570.000	Verizon Communications Inc. 0.75% 22/03/2032	424.179	0,45			Total de Países Bajos	1.167.912	1,24
EUR	10.000	Verizon Communications Inc. 1.13% 19/09/2035	6.969	0,01			Total de bonos	1.167.912	1,24
EUR	484.000	Verizon Communications Inc. 1.13% 19/09/2035	337.276	0,36			Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente	1.167.912	1,24
		Total de Estados Unidos	9.864.721	10,42			Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario		
Total de bonos			77.551.813	81,85			Bonos		
		Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					DINAMARCA		
		ALEMANIA			USD	1.085.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	930.187	0,98
EUR	1.251.000	Germany (Govt of) 0.00% 09/10/2026	1.160.315	1,22			Total de Dinamarca	930.187	0,98
EUR	966.000	Germany (Govt of) 0.00% 16/04/2027	885.909	0,94			FRANCIA		
EUR	787.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2030	673.294	0,71	USD	930.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.60% 04/10/2026	813.913	0,86
EUR	1.300.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 18/02/2025	1.232.498	1,30	USD	1.600.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	1.347.929	1,42
EUR	1.259.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.05% 30/05/2024	1.217.699	1,29			Total de Francia	2.161.842	2,28
		Total de Alemania	5.169.715	5,46					
		SUPRANACIONAL							
EUR	874.000	European Bank for Reconstruction & Development 0.00% 10/01/2024	847.138	0,89					
EUR	962.000	European Investment Bank 0.00% 15/11/2027	842.385	0,89					

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*
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)			
Bonos (continuación)			
ITALIA			
USD	500.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	420.866 0,44
	Total de Italia	420.866	0,44
NORUEGA			
USD	1.950.000	DNB Bank ASA FRN 30/09/2025	1.814.219 1,93
	Total de Noruega	1.814.219	1,93
PORTUGAL			
EUR	600.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	54.000 0,06
	Total de Portugal	54.000	0,06
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
ESTADOS UNIDOS			
USD	800.000	Nestle Holdings Inc. 4.00% 12/09/2025	803.890 0,85
	Total de Estados Unidos	803.890	0,85
	Total de bonos	6.185.004	6,54
	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	6.185.004	6,54
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
	52	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	5.147 0,01
	Total de Irlanda	5.147	0,01
	Total de fondos	5.147	0,01
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	5.147	0,01
	Valor total de las inversiones	92.850.205	98,02

(Coste total: 108.944.524 EUR)

* Diferencias menores 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 30 de septiembre 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	2.898.500	0,84	EUR	894.000	Casino Guichard Perrachon SA		
EUR	800.000	Solvay SA FRN 02/03/2169	672.973	0,20			5.25% 15/04/2027	437.841	0,13
EUR	300.000	Solvay SA Perp FRN	290.359	0,08	EUR	783.000	Casino Guichard Perrachon SA		
		Total de Bélgica	3.861.832	1,12			6.63% 15/01/2026	410.610	0,12
					EUR	1.500.000	Casino Guichard-Perrachon SA		
							4.50% 07/03/2024	1.010.063	0,30
					EUR	433.000	Chrome Bidco SASU 3.50%		
							31/05/2028	345.274	0,10
					EUR	334.000	Chrome Holding SASU 5.00%		
							31/05/2029	254.833	0,07
					EUR	928.000	CMA CGM SA 7.50% 15/01/2026	946.658	0,28
					EUR	51.000	CMA CGM SA 7.50% 15/01/2026	52.025	0,02
					EUR	2.545.000	Constellium SE 3.13% 15/07/2029	1.836.663	0,53
					EUR	1.015.000	Crown European Holdings		
							2.63% 30/09/2024	970.317	0,28
					EUR	650.000	Crown European Holdings		
							3.38% 15/05/2025	619.565	0,18
					EUR	587.000	Crown European Holdings SA		
							2.88% 01/02/2026	540.646	0,16
					EUR	2.200.000	Electricite de France SA - Perp		
							FRN	1.550.686	0,45
					EUR	1.600.000	Electricite de France SA - Perp		
							FRN	1.229.220	0,36
					EUR	400.000	Electricite de France SA - Perp		
							FRN	273.541	0,08
					EUR	2.800.000	Electricite de France SA - Perp		
							FRN	2.449.009	0,73
					EUR	1.700.000	Electricite de France SA - Perp		
							FRN	1.586.180	0,46
					GBP	1.200.000	Electricite de France SA - Perp		
							FRN	1.032.643	0,30
					EUR	1.016.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	781.574	0,23
					EUR	1.100.000	Elis SA 1.00% 03/04/2025	984.987	0,29
					EUR	400.000	Elis SA 1.88% 15/02/2023	396.706	0,12
					EUR	100.000	Elis SA 4.13% 24/05/2027	92.421	0,03
					EUR	476.000	Emeria SASU 3.38% 31/03/2028	385.077	0,11
					EUR	4.184.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2027	3.085.828	0,89
					EUR	100.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	68.035	0,02
					EUR	1.685.000	Faurecia SE 2.75% 15/02/2027	1.298.791	0,38
					EUR	100.000	Faurecia SE 3.13% 15/06/2026	84.207	0,02
					EUR	1.059.000	Faurecia SE 3.75% 15/06/2028	804.181	0,24
					EUR	1.864.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	1.708.312	0,50
					EUR	3.160.000	Iliad Holdings SAS 5.13%		
							15/10/2026	2.861.262	0,84
					EUR	882.000	Iliad Holdings SAS 5.63%		
							15/10/2028	760.039	0,22
					EUR	900.000	Iliad SA 0.75% 11/02/2024	848.978	0,25
					EUR	500.000	Iliad SA 1.50% 14/10/2024	467.116	0,14
					EUR	500.000	Iliad SA 1.88% 11/02/2028	399.303	0,12

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	400.000	Iliad SA 2.38% 17/06/2026	353.934	0,10	EUR	2.600.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	2.036.389	0,60
EUR	578.000	Laboratoire Eimer Selas 5.00% 01/02/2029	416.342	0,12	EUR	2.200.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	1.854.556	0,54
EUR	1.379.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	1.247.178	0,36	EUR	1.200.000	Deutsche Lufthansa AG 3.75% 11/02/2028	949.991	0,28
EUR	429.000	Loxam SAS 3.75% 15/07/2026	363.888	0,11	EUR	874.000	Douglas GmbH 6.00% 08/04/2026	671.088	0,20
EUR	305.000	Loxam SAS 5.75% 15/07/2027	237.228	0,07	EUR	1.145.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	983.694	0,29
EUR	200.000	Orano SA 3.38% 23/04/2026	187.177	0,05	EUR	804.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	670.373	0,20
EUR	100.000	Orano SA 4.88% 23/09/2024	101.156	0,03	EUR	771.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	642.857	0,19
EUR	554.000	Paprec Holding SA 3.50% 01/07/2028	426.955	0,12	EUR	1.343.000	HT Troplast AG 9.25% 15/07/2025	1.191.794	0,35
EUR	1.293.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	1.162.245	0,34	EUR	550.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.88% 15/05/2027	423.718	0,12
EUR	1.138.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	1.138.597	0,33	EUR	530.000	Ineos Styrolution Group GmbH 2.25% 16/01/2027	410.161	0,12
EUR	429.000	Picard Groupe SAS 3.88% 01/07/2026	360.392	0,11	EUR	500.000	Infineon Technologies AG - Perp FRN	458.423	0,13
EUR	500.000	Renault SA 1.25% 24/06/2025	434.912	0,13	EUR	500.000	Infineon Technologies AG - Perp FRN	438.123	0,13
EUR	400.000	Renault SA 2.00% 28/09/2026	323.237	0,09	EUR	2.200.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	1.454.119	0,43
EUR	1.000.000	Renault SA 2.38% 25/05/2026	838.142	0,25	EUR	1.535.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	1.215.711	0,36
EUR	400.000	Renault SA 2.50% 02/06/2027	319.335	0,09	EUR	1.344.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	1.088.330	0,32
EUR	600.000	Renault SA 2.50% 01/04/2028	469.331	0,14	EUR	1.318.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	1.062.250	0,31
EUR	1.350.000	Rexel SA 2.13% 15/06/2028	1.055.496	0,31	EUR	434.000	Progroup AG 3.00% 31/03/2026	358.919	0,11
EUR	961.000	Rexel SA 2.13% 15/12/2028	738.469	0,22	EUR	900.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	817.906	0,24
EUR	1.843.000	Solvay Finance SA - Perp FRN	1.829.991	0,54	EUR	1.900.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	1.726.690	0,51
EUR	1.100.000	Spie SA 2.63% 18/06/2026	1.000.851	0,29	EUR	667.000	Schaeffler AG 2.88% 26/03/2027	572.229	0,17
EUR	2.900.000	Valeo 1.00% 03/08/2028	2.220.858	0,65	EUR	800.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	655.699	0,19
EUR	500.000	Valeo SA 1.50% 18/06/2025	462.226	0,14	EUR	700.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	573.737	0,17
EUR	600.000	Valeo SA 1.63% 18/03/2026	544.430	0,16	EUR	1.311.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 2.00% 15/07/2025	1.152.107	0,34
EUR	300.000	Valeo SA 3.25% 22/01/2024	297.549	0,09	EUR	1.159.662	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	1.046.080	0,31
EUR	1.100.000	Veolia Environnement SA - Perp FRN	952.200	0,28	EUR	753.000	Thyssenkrupp AG 1.88% 06/03/2023	739.436	0,22
EUR	1.400.000	Verallia SA 1.63% 14/05/2028	1.111.183	0,33	EUR	1.002.000	Thyssenkrupp AG 2.50% 25/02/2025	903.182	0,26
EUR	1.600.000	Verallia SA 1.88% 10/11/2031	1.099.720	0,32	EUR	1.968.000	Thyssenkrupp AG 2.88% 22/02/2024	1.848.974	0,54
	Total de Francia	55.440.855	16,23		EUR	100.000	ZF Finance GmbH 2.75% 25/05/2027	79.671	0,02
ALEMANIA									
EUR	700.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	573.696	0,17					
EUR	550.000	Adler Real Estate AG 2.13% 06/02/2024	430.632	0,13					
EUR	1.473.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	1.210.577	0,35					
EUR	163.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	134.300	0,04					
EUR	598.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	492.708	0,14					
EUR	500.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	448.629	0,13					

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	900.000 ZF Finance GmbH 3.00% 21/09/2025	798.501	0,23	EUR	188.000 Infrastrutture Wireless Italiane SpA 1.88% 08/07/2026	167.055	0,05
EUR	500.000 ZF Finance GmbH 3.75% 21/09/2028	390.567	0,11	EUR	471.000 International Design Group SPA 6.50% 15/11/2025	429.844	0,13
Total de Alemania		30.505.817	8,95	EUR	178.000 Leonardo SpA 1.50% 07/06/2024	169.873	0,05
IRLANDA				EUR	507.000 Leonardo SpA 2.38% 08/01/2026	467.751	0,14
EUR	3.436.000 Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	3.045.251	0,89	EUR	540.000 Leonardo SpA 4.88% 24/03/2025	542.531	0,16
GBP	826.000 Virgin Media Vendor Financing Notes III 4.88% 15/07/2028	704.894	0,21	EUR	605.000 Lottomatica SpA 9.75% 30/09/2027	607.069	0,18
Total de Irlanda		3.750.145	1,10	EUR	629.000 Marcolin SpA 6.13% 15/11/2026	555.158	0,16
ISLA DE MAN				EUR	2.478.000 Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	2.123.395	0,62
EUR	1.057.000 Playtech plc 3.75% 12/10/2023	1.033.928	0,30	EUR	939.000 Nexi SpA 2.13% 30/04/2029	716.017	0,21
EUR	119.000 Playtech plc 4.25% 07/03/2026	108.167	0,03	EUR	1.000.000 Telecom Italia SpA 2.38% 12/10/2027	795.348	0,23
Total de Isla de Man		1.142.095	0,33	EUR	1.669.000 Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	1.543.330	0,45
ITALIA				EUR	275.000 Telecom Italia SpA 2.88% 28/01/2026	247.470	0,07
EUR	833.000 Atlantia SpA 1.63% 03/02/2025	757.100	0,22	EUR	818.000 Telecom Italia SpA 3.63% 25/05/2026	752.597	0,22
EUR	625.000 Atlantia SpA 1.88% 12/02/2028	472.200	0,14	EUR	1.064.000 Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	1.030.168	0,30
EUR	2.011.000 Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 26/06/2026	1.761.031	0,52	EUR	600.000 Telecom Italia SpA 5.25% 17/03/2025	463.731	0,14
EUR	1.363.000 Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 01/02/2027	1.143.997	0,33	GBP	950.000 Telecom Italia SpA 5.88% 19/05/2023	1.075.030	0,31
EUR	1.159.000 Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 26/09/2029	861.106	0,25	Total de Italia		24.844.734	7,27
EUR	1.805.000 Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	1.395.989	0,41	JAPÓN			
EUR	1.525.000 Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 15/01/2030	1.146.762	0,34	EUR	530.000 SoftBank Group Corp 4.00% 20/04/2023	523.976	0,15
EUR	609.000 Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	494.754	0,14	EUR	852.000 SoftBank Group Corp 5.00% 15/04/2028	677.255	0,20
EUR	1.223.000 Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2.63% 28/04/2025	1.051.808	0,31	EUR	1.046.000 Softbank Group Corp. 3.13% 19/09/2025	903.252	0,26
EUR	826.000 Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3.63% 24/09/2024	752.977	0,22	EUR	493.000 Softbank Group Corp. 4.00% 19/09/2029	352.412	0,10
EUR	1.478.000 Fis Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	1.237.556	0,36	EUR	582.000 SoftBank Group Corp. 2.88% 06/01/2027	448.494	0,13
EUR	730.000 Gamma Bidco SpA 5.13% 15/07/2025	659.727	0,19	Total de Japón		2.905.389	0,84
EUR	522.000 Gamma Bidco SpA 6.25% 15/07/2025	483.063	0,14	JERSEY - ISLAS DEL CANAL			
EUR	1.184.000 IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3.75% 15/01/2028	940.297	0,28	EUR	1.439.000 Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	1.333.465	0,40
				EUR	2.687.000 Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	2.467.902	0,73

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)			
JERSEY - ISLAS DEL CANAL (continuación)				LUXEMBURGO (continuación)			
EUR	849.000 Kane Bidco Limited 5.00% 14/01/2026	716.450	0,21	EUR	930.000 Loarre Investments Sarl 6.50% 15/05/2029	884.706	0,26
	Total de Jersey - Islas del Canal	4.517.817	1,34	EUR	684.000 Matterhorn Telecom SA 4.00% 15/11/2027	601.025	0,18
LUXEMBURGO				EUR	857.000 Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	809.780	0,24
EUR	1.600.000 Adler Group SA 1.88% 14/01/2026	824.418	0,24	EUR	258.000 Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/01/2033	267.625	0,08
EUR	200.000 Adler Group SA 2.75% 13/11/2026	101.871	0,03	EUR	2.100.000 Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	1.762.280	0,51
EUR	1.600.000 Adler Group SA 3.25% 05/08/2025	883.917	0,26		Total de Luxemburgo	24.714.811	7,23
EUR	810.000 Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	714.426	0,21	PAÍSES BAJOS			
EUR	1.293.000 Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	976.372	0,29	EUR	1.300.000 Abertis Finance BV - Perp FRN	972.297	0,28
EUR	1.481.000 Altice Finco SA 4.75% 15/01/2028	1.083.803	0,31	EUR	1.802.000 Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	1.443.981	0,42
EUR	3.152.000 Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	2.400.521	0,70	EUR	100.000 Constellium NV 4.25% 15/02/2026	90.183	0,03
EUR	548.872 ARD Finance SA 5.00% 30/06/2027	375.975	0,11	EUR	1.717.000 Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	1.628.467	0,48
GBP	564.000 B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	547.952	0,16	EUR	200.000 Dufry One BV 2.50% 15/10/2024	184.050	0,05
EUR	1.091.000 Canpack SA 2.38% 01/11/2027	871.822	0,26	EUR	472.000 Dufry One BV 3.38% 15/04/2028	361.862	0,11
EUR	604.000 Cirs Finance International Sarl 4.50% 15/03/2027	484.925	0,14	EUR	1.053.000 Goodyear Europe BV 2.75% 15/08/2028	803.548	0,24
EUR	257.000 Cirs Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	230.315	0,07	EUR	1.855.000 Intertrust Group BV 3.38% 15/11/2025	1.813.979	0,52
EUR	1.303.477 Cirs Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	1.274.491	0,37	EUR	1.107.000 Lkq European Holdings BV 4.13% 01/04/2028	1.035.843	0,30
EUR	443.000 CPI Property Group SA - Perp FRN	285.490	0,08	EUR	1.322.000 Nobel Bidco BV 3.13% 15/06/2028	893.375	0,26
EUR	871.105 Gamma Bondco Sarl 8.13% 15/11/2026	719.939	0,21	EUR	200.000 Phoenix Pib Dutch Finance BV 2.38% 05/08/2025	187.406	0,05
EUR	539.000 Garfunkelux Holdingco 3 SA 6.75% 01/11/2025	420.759	0,12	EUR	624.000 PPF Telecom Group BV 2.13% 31/01/2025	578.654	0,17
GBP	857.000 Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	765.059	0,22	EUR	500.000 PPF Telecom Group BV 3.13% 27/03/2026	453.761	0,13
EUR	1.284.000 Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	1.193.119	0,35	EUR	459.000 PPF Telecom Group BV 3.25% 29/09/2027	394.384	0,12
EUR	3.946.000 InPost SA 2.25% 15/07/2027	2.975.593	0,86	EUR	612.000 PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	597.885	0,17
EUR	460.000 Intralot Capital Lux 5.25% 15/09/2024	434.700	0,13	EUR	622.000 Q-Park Holding I BV 1.50% 01/03/2025	541.533	0,16
EUR	740.799 Lhmc Finco 2 Sarl 7.25% 02/10/2025	628.081	0,18	EUR	837.000 Repsol International Finance BV FRN 25/03/2075	788.523	0,23
EUR	1.780.000 Lincoln Financing Sarl 3.63% 01/04/2024	1.729.666	0,52	EUR	2.465.000 Repsol International Finance BV - Perp FRN	1.961.955	0,58
EUR	490.000 Loarre Investments Sarl FRN 15/05/2029	466.181	0,14	EUR	1.252.000 Repsol International Finance BV - Perp FRN	1.115.765	0,33

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)				PAÍSES BAJOS (continuación)						
EUR	462.000	Repsol International Finance BV - Perp FRN	411.728	0,12	EUR	600.000	ZF Europe Finance BV 3.00% 23/10/2029	433.826	0,13	
EUR	1.557.000	Repsol International Finance BV - Perp FRN	1.290.893	0,38	Total de Países Bajos				38.524.101	11,27
EUR	949.939	Summer Bidco BV 9.00% 15/11/2025	701.509	0,21	PANAMÁ					
EUR	899.045	Summer Bidco BV 9.00% 15/11/2025	663.925	0,19	EUR	1.562.000	Carnival Corp. 7.63% 01/03/2026	1.221.702	0,36	
EUR	600.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	461.241	0,13	Total de Panamá				1.221.702	0,36
EUR	3.200.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	2.804.783	0,82	PORTUGAL					
EUR	3.500.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	3.316.218	0,98	EUR	100.000	Edp - Energias de Portugal SA FRN 30/04/2079	95.786	0,03	
EUR	1.100.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	1.090.836	0,32	EUR	700.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 14/03/2082	547.730	0,16	
EUR	1.631.000	TenneT Holding BV - Perp FRN	1.478.413	0,43	EUR	700.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 20/07/2080	603.361	0,18	
EUR	495.000	TenneT Holding BV - Perp FRN	476.791	0,14	Total de Portugal				1.246.877	0,37
EUR	715.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.25% 31/03/2023	705.164	0,21	RUMANÍA					
EUR	525.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.88% 31/03/2027	416.692	0,12	EUR	1.100.000	RCS & RDS SA 2.50% 05/02/2025	966.751	0,28	
EUR	1.391.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.75% 09/05/2027	1.171.984	0,34	EUR	400.000	RCS & RDS SA 3.25% 05/02/2028	307.350	0,09	
EUR	1.309.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.38% 09/05/2030	1.031.560	0,30	Total de Rumanía				1.274.101	0,37
EUR	1.255.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	1.183.693	0,35	ESPAÑA					
EUR	1.110.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	1.001.881	0,29	EUR	400.000	Banco de Sabadell SA FRN 24/03/2026	370.391	0,11	
EUR	1.097.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	836.752	0,24	EUR	700.000	Banco de Sabadell SA FRN 08/09/2026	688.277	0,20	
EUR	346.000	United Group BV 4.63% 15/08/2028	246.088	0,07	EUR	1.100.000	Cellnex Finance Company SA 1.00% 15/09/2027	877.816	0,26	
EUR	641.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	598.342	0,18	EUR	1.300.000	Cellnex Finance Company SA 1.25% 15/01/2029	967.210	0,28	
EUR	214.000	United Group BV 5.25% 01/02/2030	150.807	0,04	EUR	1.100.000	Cellnex Finance Company SA 1.50% 08/06/2028	863.973	0,25	
EUR	1.075.000	VZ Secured Financing BV 3.50% 15/01/2032	773.585	0,23	EUR	1.100.000	Cellnex Finance Company SA 2.00% 15/02/2033	720.308	0,21	
EUR	717.000	VZ Vendor Financing II BV 2.88% 15/01/2029	511.007	0,15	EUR	700.000	Cellnex Finance Company SA 2.25% 12/04/2026	632.311	0,19	
EUR	1.100.000	ZF Europe Finance BV 2.00% 23/02/2026	918.932	0,27	EUR	500.000	Cellnex Telecom SA 1.00% 20/04/2027	409.456	0,12	
					EUR	500.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	378.762	0,11	
					EUR	600.000	Cellnex Telecom SA 2.88% 18/04/2025	574.740	0,17	

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)					
ESPAÑA (continuación)				REINO UNIDO (continuación)					
EUR	1.848.000	Grifols Escrow Issuer SA 3.88% 15/10/2028	1.370.615	0,40	GBP	1.561.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	1.166.001	0,34
EUR	881.000	Grifols SA 1.63% 15/02/2025	781.906	0,23	EUR	997.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	888.719	0,26
EUR	1.602.000	Grifols SA 2.25% 15/11/2027	1.250.552	0,37	EUR	686.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	555.144	0,16
EUR	1.032.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	906.620	0,27	GBP	510.000	Centrica plc FRN 10/04/2075	484.877	0,14
EUR	400.000	International Consolidated Airlines Group SA 2.75% 25/03/2025	335.049	0,10	GBP	926.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	954.720	0,28
EUR	1.382.000	Kaixo Bondco Telecom SA 5.13% 30/09/2029	1.091.519	0,32	GBP	835.000	Co-operative Group FRN 08/07/2026	835.289	0,24
EUR	3.669.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	3.199.805	0,95	GBP	621.000	Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	651.520	0,19
		Total de España	15.419.310	4,54	GBP	1.512.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	1.293.758	0,38
SUECIA				EUR 1.267.000 EC Finance plc 3.00% 15/10/2026 1.107.671 0,32					
EUR	1.540.000	Heimstaden Bostad AB FRN 01/05/2169	911.020	0,27	USD	1.846.295	Enquest plc 7.00% 15/10/2023	1.735.225	0,51
EUR	770.000	Heimstaden Bostad AB FRN 01/05/2170	455.510	0,13	EUR	1.670.000	Ineos Finance plc 2.88% 01/05/2026	1.402.633	0,41
EUR	1.559.000	Heimstaden Bostad AB - Perp FRN	1.134.390	0,33	EUR	474.000	Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	406.384	0,12
EUR	1.420.000	Heimstaden Bostad AB - Perp FRN	948.903	0,28	EUR	396.000	Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	339.511	0,10
EUR	1.074.000	Intrum AB 3.00% 15/09/2027	802.889	0,23	EUR	98.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	80.937	0,02
EUR	1.602.000	Intrum AB 3.50% 15/07/2026	1.289.689	0,38	EUR	2.074.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	1.712.893	0,50
EUR	478.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	425.307	0,12	GBP	1.358.000	Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	1.449.727	0,43
EUR	1.174.000	Intrum Justitia AB 3.13% 15/07/2024	1.075.140	0,31	EUR	1.483.000	International Game Technology plc 2.38% 15/04/2028	1.179.650	0,35
EUR	1.190.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB - Perp FRN	505.488	0,15	EUR	324.000	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	317.253	0,09
EUR	1.775.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	1.448.131	0,42	EUR	1.925.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	1.722.351	0,50
EUR	80.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	65.268	0,02	GBP	1.423.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	1.440.615	0,42
EUR	386.000	Verisure Holding AB 3.88% 15/07/2026	332.702	0,10	EUR	320.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.20% 15/01/2024	285.169	0,08
EUR	583.000	Verisure Holding AB 9.25% 15/10/2027	591.370	0,17	GBP	687.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 3.88% 01/03/2023	756.230	0,22
EUR	1.932.000	Verisure Midholding A 5.25% 15/02/2029	1.428.265	0,42	EUR	102.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 4.50% 15/07/2028	66.638	0,02
EUR	11.000	Verisure Midholding A 5.25% 15/02/2029	8.132	0,00	EUR	602.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	532.544	0,16
		Total de Suecia	11.422.204	3,33	EUR	1.640.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	1.285.058	0,38
REINO UNIDO				GBP 578.000 Jerrold Finco plc 4.88% 15/01/2026 517.020 0,15					
EUR	1.457.000	BCP V Modular Services Finance II plc 4.75% 30/11/2028	1.176.823	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)				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	1.376.000	Jerrold Finco plc 5.25% 15/01/2027	1.184.072	0,35	EUR	233.000	Ardagh Metal Packaging Finance LLC 3.00% 01/09/2029	167.048	0,05
GBP	1.417.000	Ladbrokes Group Finance plc 5.13% 08/09/2023	1.593.660	0,47	EUR	1.905.000	Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	1.737.304	0,51
GBP	1.141.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	1.048.967	0,30	EUR	150.000	Avantor Funding Inc. 3.88% 15/07/2028	129.987	0,04
GBP	490.000	Marks & Spencer plc 6.00% 12/06/2025	507.926	0,15	EUR	1.552.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	1.203.013	0,35
EUR	896.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	780.248	0,23	EUR	565.000	Ford Motor Credit Company LLC 1.36% 07/02/2025	501.461	0,15
GBP	1.229.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	1.197.518	0,35	EUR	1.054.000	Ford Motor Credit Company LLC 1.74% 19/07/2024	972.948	0,28
GBP	650.000	Premier Foods Finance plc 3.50% 15/10/2026	593.727	0,17	EUR	1.599.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.33% 25/11/2025	1.405.761	0,41
GBP	559.000	Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	514.033	0,15	EUR	271.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	236.792	0,07
GBP	1.377.000	Santander UK plc - Perp 10.06%	2.422.747	0,71	EUR	291.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	254.267	0,07
EUR	1.411.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	1.082.552	0,32	GBP	1.323.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	1.360.147	0,40
EUR	508.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	416.762	0,12	EUR	1.813.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	1.736.038	0,51
GBP	331.000	Travis Perkins plc 3.75% 17/02/2026	323.863	0,09	EUR	1.697.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	1.539.133	0,45
EUR	829.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	610.581	0,18	GBP	952.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	971.866	0,28
EUR	1.572.000	Victoria plc 3.75% 15/03/2028	1.104.118	0,32	EUR	2.611.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	2.104.175	0,62
GBP	603.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.25% 15/01/2030	503.631	0,15	EUR	139.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/03/2029	106.441	0,03
GBP	866.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.00% 15/04/2027	858.431	0,25	EUR	2.384.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/03/2029	1.825.580	0,54
GBP	959.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	869.116	0,25	EUR	1.236.000	IQVIA Inc. 2.88% 15/06/2028	1.010.943	0,30
EUR	1.860.000	Vmed O2 UK Financing I plc 3.25% 31/01/2031	1.408.805	0,41	EUR	586.000	MPT Operating Partnership 3.33% 24/03/2025	548.340	0,16
EUR	876.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	752.057	0,22	GBP	648.000	MPT Operating Partnership 3.69% 05/06/2028	547.695	0,16
EUR	1.516.000	Vodafone Group plc FRN 03/01/2079	1.464.656	0,43	EUR	2.690.000	Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	2.542.044	0,75
EUR	1.909.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	1.662.019	0,49	EUR	360.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	309.027	0,09
GBP	335.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	328.449	0,10	EUR	666.000	Netflix Inc. 4.63% 15/05/2029	624.049	0,18
USD	1.727.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	1.680.247	0,49	USD	490.000	Occidental Petroleum Corp. 5.88% 01/09/2025	503.561	0,15
GBP	2.506.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	2.254.225	0,66	USD	310.000	Occidental Petroleum Corp. 6.38% 01/09/2028	317.645	0,09
		Total de Reino Unido	49.506.770	14,47	USD	718.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	740.244	0,22
					USD	550.000	Occidental Petroleum Corp. 8.00% 15/07/2025	597.604	0,17
					USD	345.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	380.340	0,11
					USD	850.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	966.223	0,28
ESTADOS UNIDOS									
EUR	1.468.000	Ardagh Metal Packaging Finance LLC 2.00% 01/09/2028	1.125.300	0,32					

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)				PORTUGAL (continuación)					
EUR	966.000 Olympus Water USA 3.88% 01/10/2028	736.531	0,22	EUR	1.400.000 Banco Espirito Santo SA 4.75% 15/01/2023**	126.000	0,04		
EUR	730.000 Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	626.318	0,18	Total de Portugal			837.000	0,25	
EUR	600.000 ZF North America Capital 2.75% 27/04/2023	592.511	0,17	REINO UNIDO					
Total de Estados Unidos				EUR	644.000 BCP V Modular Services Finance II plc 6.75% 30/11/2029	449.673	0,13		
Total de bonos				GBP	2.611.000 Bellis Acquisition Company 3.25% 16/02/2026	2.252.341	0,66		
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				GBP	296.369 Bracken Midco1 plc 6.75% 01/11/2027	240.128	0,07		
				GBP	3.181.000 Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	3.120.651	0,91		
				GBP	297.000 Pinewood Finance Company Limited 3.63% 15/11/2027	274.073	0,08		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				GBP	989.000 Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	850.243	0,25		
Bonos				GBP	885.000 Virgin Media Secured Finance plc 4.13% 15/08/2030	719.013	0,21		
ESTADOS UNIDOS				GBP	1.220.000 Vmed O2 UK Financing I plc 4.50% 15/07/2031	988.415	0,29		
USD	445.000 Occidental Petroleum Corp. 6.95% 01/07/2024	467.019	0,14	Total de Reino Unido			8.894.537	2,60	
USD	478.000 Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	523.828	0,15	Total de bonos				10.595.740	3,10
Total de Estados Unidos				Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				10.595.740	3,10
Total de bonos				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios					
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				Fondos					
				IRLANDA					
				1.760.155	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	2.005.676	0,59		
				144.213	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	14.140.105	4,13		
				1.014.642	Insight Liquidity Funds plc	1.156.173	0,34		
				Total de Irlanda			17.301.954	5,06	
				Total de fondos				17.301.954	5,06
				Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				17.301.954	5,06
PORTUGAL				Valor total de las inversiones				332.077.822	97,18
EUR	6.900.000 Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	621.000	0,18	(Coste total: 394.743.777 EUR)					
EUR	1.000.000 Banco Espirito Santo SA 2.63% 31/12/2049**	90.000	0,03						

* Diferencias menores 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 30 de septiembre 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	200.000	House of Finance NV 4.38% 15/07/2026	201.311	0,25	EUR	300.000	Spie SA 3.13% 22/03/2024	294.213	0,36
					EUR	300.000	Valeo SA 3.25% 22/01/2024	297.549	0,37
		Total de Bélgica	201.311	0,25			Total de Francia	10.792.714	13,34
REPÚBLICA CHECA				ALEMANIA					
EUR	268.000	Allwyn International AS 4.13% 20/11/2024	256.672	0,32	EUR	800.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	655.652	0,82
		Total de República Checa	256.672	0,32	EUR	250.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	205.461	0,25
FINLANDIA				FRANCIA (continuación)					
EUR	540.000	Teollisuuden Voima Oyj 2.13% 04/02/2025	506.829	0,63	EUR	200.000	Demire Deutsche Mittelstand Real Estate AG 1.88% 15/10/2024	146.479	0,18
		Total de Finlandia	506.829	0,63	EUR	300.000	Deutsche Lufthansa AG 1.63% 16/11/2023	289.025	0,36
FRANCIA				FRANCIA (continuación)					
EUR	316.000	Altice France SA 2.13% 15/02/2025	277.643	0,34	EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 2.00% 14/07/2024	187.977	0,23
EUR	1.356.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	1.211.723	1,50	EUR	400.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	358.902	0,45
EUR	271.000	Banijay Entertainment Sasu 3.50% 01/03/2025	252.127	0,31	EUR	300.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	234.968	0,29
EUR	300.000	Casino Guichard-Perrachon SA 4.50% 07/03/2024	202.013	0,25	EUR	300.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	252.894	0,31
EUR	355.000	CMA CGM SA 7.50% 15/01/2026	362.138	0,45	EUR	726.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	623.722	0,77
EUR	100.000	Crown European Holdings 3.38% 15/05/2025	95.318	0,12	EUR	660.000	HT Troplast AG 9.25% 15/07/2025	585.692	0,72
EUR	550.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	423.096	0,52	EUR	484.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.63% 15/05/2025	426.726	0,53
EUR	500.000	Elis SA 2.88% 15/02/2026	465.551	0,58	EUR	529.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	428.368	0,53
EUR	271.000	Faurecia SE 2.63% 15/06/2025	237.771	0,29	EUR	100.000	Progroup AG 3.00% 31/03/2026	82.700	0,10
EUR	1.291.000	Faurecia SE 2.63% 15/06/2025	1.132.701	1,40	EUR	400.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	363.514	0,45
EUR	250.000	Faurecia SE 2.75% 15/02/2027	192.699	0,24	EUR	146.000	SGL Carbon SE 4.63% 30/09/2024	140.240	0,17
EUR	1.428.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	1.308.728	1,61	EUR	1.030.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 2.00% 15/07/2025	905.164	1,12
EUR	1.206.000	Iliad Holdings SAS 5.13% 15/10/2026	1.091.989	1,35	EUR	464.000	Tele Columbus AG 3.88% 02/05/2025	379.179	0,47
EUR	200.000	Iliad SA 0.75% 11/02/2024	188.662	0,23	EUR	495.000	Thyssenkrupp AG 1.88% 06/03/2023	486.084	0,60
EUR	289.000	Iqera Group SAS 6.50% 30/09/2024	272.977	0,34	EUR	1.009.000	Thyssenkrupp AG 2.88% 22/02/2024	947.974	1,17
EUR	180.000	Kapla Holding SAS 3.38% 15/12/2026	150.672	0,19	EUR	500.000	TUI Cruises GmbH 6.50% 15/05/2026	382.617	0,47
EUR	381.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	344.579	0,43	EUR	100.000	ZF Finance GmbH 3.00% 21/09/2025	88.722	0,11
EUR	177.178	Loxam SAS 6.00% 15/04/2025	160.521	0,20			Total de Alemania	8.172.060	10,10
EUR	820.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	737.077	0,91					
EUR	713.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	713.374	0,88					
EUR	405.000	Quatrim Sasu 5.88% 15/01/2024	379.593	0,47					

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)					
IRLANDA				JERSEY - ISLAS DEL CANAL (continuación)					
EUR	1.283.000	Eircom Finance DAC 1.75% 01/11/2024	1.242.661	1,53	EUR	370.000	Avis Budget Finance plc 4.50% 15/05/2025	352.931	0,44
EUR	544.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	482.135	0,60	EUR	233.000	Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	196.623	0,24
		Total de Irlanda	1.724.796	2,13			Total de Jersey - Islas del Canal	2.157.153	2,67
ISLA DE MAN				LUXEMBURGO					
EUR	1.476.000	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	1.443.781	1,78	EUR	750.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	661.506	0,82
EUR	110.000	Playtech plc 4.25% 07/03/2026	99.986	0,12	GBP	837.000	B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	813.185	1,00
		Total de Isla de Man	1.543.767	1,90	EUR	100.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	89.617	0,11
ITALIA				LUXEMBURGO					
GBP	150.000	Aeroporti di Roma SpA 5.44% 20/02/2023	170.514	0,21	EUR	529.882	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	518.099	0,64
EUR	400.000	Autostrade per l'Italia SpA 5.88% 09/06/2024	408.541	0,51	EUR	214.000	Gamma Bondco Sarl 8.13% 15/11/2026	176.864	0,22
EUR	419.000	Fis Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	350.836	0,43	EUR	200.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 6.75% 01/11/2025	156.126	0,19
EUR	686.000	Gamma Bidco SpA 5.13% 15/07/2025	619.963	0,77	GBP	143.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	127.659	0,16
EUR	300.000	International Design Group SPA 6.50% 15/11/2025	273.786	0,34	EUR	200.000	Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	185.844	0,23
EUR	428.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	366.753	0,45	EUR	493.000	HSE Finance Sarl 5.63% 15/10/2026	317.130	0,39
EUR	1.028.000	Nexi SpA 1.75% 31/10/2024	994.547	1,23	EUR	100.000	Lincoln Financing Sarl 3.63% 01/04/2024	97.172	0,12
EUR	681.000	Rossini Sarl 6.75% 30/10/2025	661.192	0,83	EUR	800.000	Matterhorn Telecom SA 2.63% 15/09/2024	786.553	0,97
EUR	277.000	Telecom Italia SpA 2.50% 19/07/2023	273.056	0,34	EUR	375.000	PLT VII Finance sarl 4.63% 05/01/2026	337.081	0,42
EUR	100.000	Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	92.470	0,11	EUR	100.000	PLT VII Finance sarl 4.63% 05/01/2026	89.888	0,11
EUR	500.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	484.101	0,60	EUR	222.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	209.768	0,26
		Total de Italia	4.695.759	5,82			Total de Luxemburgo	4.566.492	5,64
JAPÓN				MÉXICO					
EUR	130.000	SoftBank Group Corp 4.00% 20/04/2023	128.522	0,16	EUR	385.000	Petroleos Mexicanos 2.50% 24/11/2022	383.727	0,47
EUR	500.000	SoftBank Group Corp. 2.13% 06/07/2024	460.443	0,57	EUR	247.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 21/02/2024	236.278	0,29
		Total de Japón	588.965	0,73			Total de México	620.005	0,76
JERSEY - ISLAS DEL CANAL				PAÍSES BAJOS					
EUR	1.047.000	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	970.215	1,20	EUR	610.000	Constellium NV 4.25% 15/02/2026	550.117	0,68
EUR	664.000	Avis Budget Finance plc 4.13% 15/11/2024	637.384	0,79					

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)			
PAÍSES BAJOS (continuación)				ESPAÑA (continuación)			
EUR	475.000 Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	450.508	0,56	EUR	300.000 Cellnex Telecom SA 2.88% 18/04/2025	287.370	0,36
EUR	400.000 Intertrust Group BV 3.38% 15/11/2025	391.154	0,48	EUR	1.145.000 Gestamp Automocion SA 3.25% 30/04/2026	1.009.426	1,25
EUR	327.273 Kongsberg Actuation Systems BV 5.00% 15/07/2025	278.252	0,34	EUR	250.000 Grifols SA 1.63% 15/02/2025	221.880	0,27
EUR	485.000 OI European Group BV 3.13% 15/11/2024	451.910	0,56	EUR	1.580.000 Grifols SA 3.20% 01/05/2025	1.388.042	1,72
EUR	475.000 PPF Telecom Group BV 2.13% 31/01/2025	440.482	0,54	EUR	500.000 Grupo Antolin-Irausa SA 3.38% 30/04/2026	378.748	0,47
EUR	468.000 PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	457.206	0,57	EUR	300.000 International Consolidated Airlines Group SA 2.75% 25/03/2025	251.287	0,31
EUR	246.000 Q-Park Holding I BV 1.50% 01/03/2025	214.176	0,26		Total de España	4.191.929	5,19
EUR	100.000 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.25% 31/03/2023	98.624	0,12		SUECIA		
EUR	600.000 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	565.909	0,70	EUR	777.000 Intrum AB 4.88% 15/08/2025	691.346	0,86
EUR	340.000 Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	306.882	0,38	EUR	126.000 Intrum Justitia AB 3.13% 15/07/2024	115.390	0,14
EUR	650.000 United Group BV 3.13% 15/02/2026	495.796	0,62	EUR	1.482.000 Verisure Holding AB 3.50% 15/05/2023	1.482.380	1,83
EUR	440.000 United Group BV 4.88% 01/07/2024	410.719	0,51	EUR	100.000 Verisure Holding AB 9.25% 15/10/2027	101.436	0,13
	Total de Países Bajos	5.111.735	6,32		Total de Suecia	2.390.552	2,96
	PANAMÁ				REINO UNIDO		
EUR	200.000 Carnival Corp. 7.63% 01/03/2026	156.428	0,19	GBP	300.000 Anglian Water Osprey Financing plc 5.00% 30/04/2023	340.074	0,42
EUR	212.000 Carnival Corp. 10.13% 01/02/2026	210.490	0,26	GBP	306.000 Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	228.569	0,28
	Total de Panamá	366.918	0,45	GBP	145.000 Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	149.497	0,18
	RUMANÍA			GBP	124.000 Co-operative Group FRN 08/07/2026	124.043	0,15
EUR	600.000 RCS & RDS SA 2.50% 05/02/2025	527.319	0,65	GBP	1.150.000 Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	1.206.519	1,49
	Total de Rumanía	527.319	0,65	EUR	289.000 EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	252.657	0,31
	ESPAÑA			EUR	365.000 EG Global Finance plc 3.63% 07/02/2024	324.843	0,40
EUR	300.000 Banco de Sabadell SA FRN 24/03/2026	277.793	0,35	USD	473.720 Enquest plc 7.00% 15/10/2023	445.223	0,56
EUR	200.000 Cellnex Finance Company SA 2.25% 12/04/2026	180.660	0,22	GBP	200.000 Heathrow Finance plc 5.25% 01/03/2024	213.855	0,27
EUR	200.000 Cellnex Telecom SA 2.38% 16/01/2024	196.723	0,24	GBP	244.000 Iceland Bondco plc 4.63% 15/03/2025	209.585	0,26
				EUR	800.000 Ineos Finance plc 2.88% 01/05/2026	671.921	0,84
				EUR	100.000 Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	85.735	0,11

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 (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
EUR	394.000 Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	325.400	0,40	EUR	200.000 Ford Motor Credit Company LLC 2.33% 25/11/2025	175.830	0,22
EUR	482.000 Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	398.078	0,49	GBP	391.000 Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	401.978	0,50
GBP	357.000 Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	381.114	0,47	EUR	344.000 Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	329.397	0,41
EUR	207.000 International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	202.690	0,25	EUR	123.000 Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	111.558	0,14
EUR	590.000 International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	527.889	0,65	GBP	370.000 Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	377.721	0,47
GBP	900.000 Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	911.141	1,13	EUR	464.000 IQVIA Inc. 1.75% 15/03/2026	402.491	0,50
GBP	934.000 Jaguar Land Rover Automotive plc 3.88% 01/03/2023	1.028.121	1,26	EUR	1.250.000 IQVIA Inc. 2.88% 15/09/2025	1.178.350	1,46
EUR	140.000 Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	123.848	0,15	GBP	727.000 MPT Operating Partnership 2.55% 05/12/2023	771.130	0,95
EUR	177.000 Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	138.692	0,17	USD	260.000 Occidental Petroleum Corp. 5.88% 01/09/2025	267.195	0,33
GBP	543.000 Jerrold Finco plc 4.88% 15/01/2026	485.713	0,60	USD	160.000 Occidental Petroleum Corp. 8.00% 15/07/2025	173.848	0,21
GBP	835.000 Ladbrokes Group Finance plc 5.13% 08/09/2023	939.101	1,16	EUR	1.719.000 Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	1.621.533	2,00
GBP	200.000 Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	183.868	0,23	EUR	1.200.000 ZF North America Capital 2.75% 27/04/2023	1.185.022	1,46
EUR	304.000 Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	264.727	0,33	Total de Estados Unidos		9.261.893	11,46
GBP	400.000 Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	389.754	0,48	Total de bonos		70.655.014	87,37
GBP	271.000 Premier Foods Finance plc 3.50% 15/10/2026	247.538	0,31	Bonos - convertibles			
GBP	141.000 Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	129.658	0,16	FRANCIA			
EUR	482.000 Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	369.802	0,46	EUR	10.988 Elis SA 0.00% 06/10/2023	337.744	0,42
EUR	400.000 Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	328.159	0,41	Total de Francia		337.744	0,42
GBP	197.000 Travis Perkins 4.50% 07/09/2023	216.634	0,27	ESPAÑA			
EUR	975.000 Victoria plc 3.63% 26/08/2026	718.114	0,89	EUR	500.000 International Consolidated Airlines Group SA 0.63% 17/11/2022	497.968	0,61
GBP	462.000 Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	415.583	0,51	Total de España		497.968	0,61
Total de Reino Unido		12.978.145	16,05	Total de bonos - convertibles		835.712	1,03
ESTADOS UNIDOS				Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
EUR	1.457.000 Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	1.328.741	1,64			71.490.726	88,40
EUR	290.000 Ball Corp. 0.88% 15/03/2024	273.313	0,34				
EUR	465.000 Ball Corp. 4.38% 15/12/2023	465.319	0,58				
EUR	200.000 Ford Motor Credit Company LLC 1.51% 17/02/2023	198.467	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 negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios					
Bonos				Fondos					
ESTADOS UNIDOS				IRLANDA					
USD	260.000	Occidental Petroleum Corp. 6.95% 01/07/2024	272.865	0,34	20.454	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	2.005.494	2,48	
Total de Estados Unidos			272.865	0,34	Total de Irlanda			2.005.494	2,48
Total de bonos			272.865	0,34	Total de fondos			2.005.494	2,48
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					
			272.865	0,34				2.005.494	2,48
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				Valor total de las inversiones					
Bonos				(Coste total: 85.762.779 EUR)					
GIBRALTAR				<i>*Diferencias menores debido al redondeo.</i>					
EUR	340.000	888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027	286.663	0,35					
Total de Gibraltar			286.663	0,35					
REINO UNIDO									
GBP	520.000	Bellis Acquisition Company 3.25% 16/02/2026	448.571	0,55					
GBP	1.605.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	1.574.549	1,96					
GBP	178.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	153.027	0,19					
GBP	400.000	Talktalk Telecom Group plc 3.88% 20/02/2025	382.868	0,47					
Total de Reino Unido			2.559.015	3,17					
Total de bonos			2.845.678	3,52					
Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario									
			2.845.678	3,52					

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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	320.641	0,09	EUR	2.400.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/11/2026	2.169.063	0,60	
EUR	100.000	Erste Group Bank AG 0.13% 17/05/2028	80.160	0,02	EUR	1.500.000	Caisse des Depots et Consignations 0.01% 15/09/2025	1.404.750	0,40	
EUR	2.200.000	Telekom Finanzmanagement GmbH 1.50% 07/12/2026	2.053.692	0,58	EUR	1.500.000	Caisse des Depots et Consignations 0.01% 01/06/2026	1.379.089	0,39	
Total de Austria			2.454.493	0,69	EUR	2.000.000	Carrefour SA 2.63% 15/12/2027	1.877.979	0,53	
BÉLGICA				USD 1.600.000				CNP Assurances - Perp FRN	1.018.427	0,29
EUR	700.000	Bpost SA 1.25% 11/07/2026	656.123	0,19	EUR	9.500.000	Credit Agricole SA 0.13% 09/12/2027	7.718.339	2,18	
EUR	1.000.000	KBC Group NV FRN 16/06/2027	875.287	0,25	EUR	2.000.000	Credit Agricole SA FRN 21/09/2029	1.587.156	0,45	
EUR	1.600.000	KBC Group NV 0.88% 27/06/2023	1.580.065	0,45	USD	1.055.000	Credit Agricole SA - Perp FRN	744.194	0,21	
EUR	900.000	VGP NV 1.63% 17/01/2027	723.072	0,20	USD	300.000	Credit Agricole SA - Perp FRN	294.815	0,08	
Total de Bélgica			3.834.547	1,09	EUR	2.600.000	Credit Mutuel Arkea SA 0.38% 03/10/2028	2.096.460	0,59	
DINAMARCA				EUR 700.000				Credit Mutuel Arkea SA FRN 11/06/2029	589.378	0,17
EUR	600.000	Nykredit Realkredit A/S 0.88% 17/01/2024	580.234	0,16	EUR	4.300.000	Danone SA 1.00% 26/03/2025	4.109.066	1,16	
EUR	550.000	Nykredit Realkredit AS 0.38% 17/01/2028	437.375	0,12	EUR	300.000	Electricite de France SA 1.00% 29/11/2033	210.820	0,06	
GBP	900.000	Orsted A/S 2.13% 17/05/2027	864.654	0,24	EUR	700.000	Electricite de France SA 1.00% 29/11/2033	491.913	0,14	
GBP	900.000	Orsted A/S 2.50% 16/05/2033	744.513	0,21	EUR	1.200.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	816.422	0,23	
EUR	1.300.000	Orsted AS FRN 09/12/3019	1.098.906	0,31	EUR	675.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	618.622	0,17	
EUR	700.000	Orsted AS FRN 24/11/3017	666.458	0,19	EUR	800.000	Ile-de-France Mobilites 0.40% 28/05/2031	657.748	0,19	
Total de Dinamarca			4.392.140	1,23	EUR	3.400.000	La Banque Postale SA 0.75% 23/06/2031	2.454.168	0,69	
FINLANDIA				EUR 200.000				La Banque Postale SA - Perp FRN	155.952	0,04
EUR	1.500.000	Elenia Finance Oyj 0.38% 06/02/2027	1.279.825	0,36	EUR	800.000	La Poste SA 1.38% 21/04/2032	653.453	0,18	
EUR	900.000	OP Corporate Bank plc 0.38% 26/02/2024	868.662	0,25	EUR	300.000	Orange SA 0.13% 16/09/2029	239.504	0,07	
Total de Finlandia			2.148.487	0,61	EUR	3.700.000	Orange SA 0.13% 16/09/2029	2.953.884	0,83	
FRANCIA				EUR 900.000				Orange SA 2.38% 18/05/2032	808.428	0,23
EUR	1.500.000	Air Liquide Finance SA 0.38% 27/05/2031	1.167.911	0,33	EUR	1.100.000	Orange SA - Perp FRN	1.101.579	0,31	
EUR	3.000.000	AXA SA FRN 07/10/2041	2.133.414	0,60	EUR	400.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	359.550	0,10	
GBP	2.400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.88% 26/10/2028	2.124.974	0,60	EUR	800.000	Regie Autonome des Transports Parisiens 0.88% 25/05/2027	741.752	0,21	
EUR	400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.63% 14/09/2032	381.779	0,11	EUR	1.100.000	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR 0.75% 12/01/2034	782.623	0,22	
EUR	2.200.000	BNP Paribas 1.00% 17/04/2024	2.129.995	0,60	EUR	700.000	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR 1.88% 23/10/2037	516.348	0,15	
EUR	2.500.000	BNP Paribas SA FRN 14/10/2027	2.139.249	0,60						
EUR	3.100.000	BPCE SA 0.63% 26/09/2023	3.034.757	0,86						
EUR	3.500.000	BPCE SA FRN 02/02/2034	2.744.180	0,77						

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	2.800.000	Sanofi 1.50% 01/04/2030	2.479.804	0,70	EUR	1.400.000	Eurogrid GmbH 1.63% 03/11/2023	1.380.402	0,39
EUR	1.600.000	Schneider Electric SE 1.84% 13/10/2025	1.572.020	0,44	EUR	300.000	Hamburger Hochbahn AG 0.13% 24/02/2031	231.869	0,07
EUR	200.000	SNCF Reseau 2.25% 20/12/2047	161.747	0,05	EUR	600.000	Hamburger Hochbahn AG 0.13% 24/02/2031	463.738	0,13
EUR	1.100.000	Societe du Grand Paris EPIC 1.63% 08/04/2042	822.027	0,23	EUR	400.000	Landesbank Baden-Wuerttemberg 0.38% 21/02/2031	283.188	0,08
EUR	2.500.000	Societe Generale SA FRN 02/12/2027	2.127.207	0,60	EUR	250.000	Mercedes-Benz Group AG 0.75% 10/09/2030	201.909	0,06
EUR	900.000	Societe Generale SA FRN 02/12/2027	765.794	0,22	EUR	750.000	Mercedes-Benz Group AG 0.75% 10/09/2030	605.726	0,17
EUR	1.500.000	Unedic Asseo 0.25% 25/11/2029	1.265.911	0,36	EUR	3.800.000	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG FRN 26/05/2041	2.717.175	0,76
	Total de Francia		64.690.643	18,25	EUR	1.000.000	NRW Bank 0.10% 09/07/2035	683.649	0,20
ALEMANIA					EUR	2.900.000	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 05/07/2025	2.764.046	0,78
EUR	1.500.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	1.037.997	0,29	EUR	1.900.000	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 05/07/2025	1.810.928	0,51
EUR	1.400.000	Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032	1.377.170	0,39	EUR	500.000	Vantage Towers AG 0.38% 31/03/2027	427.166	0,12
EUR	900.000	Bayerische Landesbode 0.25% 21/03/2036	617.373	0,17	EUR	300.000	Vantage Towers AG 0.38% 31/03/2027	256.300	0,07
EUR	1.100.000	Bayerische Landesbodenkreditanstalt 0.63% 22/11/2027	980.827	0,28	EUR	100.000	Vantage Towers AG 0.75% 31/03/2030	77.136	0,02
EUR	2.200.000	Commerzbank AG FRN 24/03/2026	2.001.357	0,56	EUR	900.000	Vantage Towers AG 0.75% 31/03/2030	694.220	0,20
EUR	1.500.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 0.35% 29/09/2031	1.142.969	0,32	EUR	3.000.000	Vonovia SE 1.38% 28/01/2026	2.723.498	0,78
EUR	600.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 0.63% 08/12/2050	290.049	0,08	EUR	2.000.000	Vonovia SE 1.50% 14/06/2041	1.091.880	0,31
GBP	1.500.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 1.88% 13/02/2026	1.523.522	0,43	EUR	2.400.000	Vonovia SE 1.88% 28/06/2028	2.042.393	0,58
EUR	2.300.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	2.163.120	0,61		Total de Alemania	40.423.998	11,44	
EUR	1.200.000	Deutsche Bank AG FRN 23/02/2028	1.022.704	0,29	IRLANDA				
EUR	500.000	Deutsche Bank AG FRN 24/05/2028	451.430	0,13	EUR	1.620.000	AIB Group plc FRN 04/04/2028	1.426.525	0,40
EUR	425.000	Deutsche Kreditbank AG 0.01% 07/11/2029	343.778	0,10	EUR	2.300.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	2.001.583	0,56
EUR	600.000	Deutsche Kreditbank AG 0.88% 02/10/2028	531.784	0,15	EUR	1.000.000	Bank of Ireland Group plc FRN 10/05/2027	849.220	0,24
EUR	1.985.000	E.ON SE 0.60% 01/10/2032	1.403.021	0,40	EUR	800.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	654.834	0,18
EUR	1.700.000	E.ON SE 0.35% 28/02/2030	1.294.713	0,37	GBP	758.000	Bank of Ireland Group plc FRN 06/12/2032	799.647	0,23
EUR	915.000	E.ON SE 0.60% 01/10/2032	646.733	0,18	EUR	600.000	ESB Finance DAC 1.00% 19/07/2034	432.896	0,12
EUR	2.000.000	E.ON SE 1.63% 29/03/2031	1.638.726	0,46	EUR	1.250.000	Kerry Group Financial Services 0.88% 01/12/2031	932.385	0,26
EUR	4.500.000	Eurogrid GmbH 1.11% 15/05/2032	3.501.502	1,00					

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)			
IRLANDA (continuación)				LUXEMBURGO (continuación)			
EUR	800.000 Lunar Funding V for Swisscom AG 1.13% 12/10/2026	737.016	0,21	EUR	1.700.000 Prologis International Funding II SA 3.13% 01/06/2031	1.518.739	0,43
	Total de Irlanda	7.834.106	2,20	EUR	1.600.000 Segro Capital Sarl 0.50% 22/09/2031	1.111.325	0,31
				EUR	2.150.000 Selp Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	1.987.325	0,56
ITALIA				Total de Luxemburgo			
EUR	700.000 Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	502.843	0,14			14.210.289	4,00
EUR	700.000 Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	502.843	0,14	PAÍSES BAJOS			
EUR	1.100.000 Assicurazioni Generali SpA 1.71% 30/06/2032	735.712	0,21	EUR	300.000 ABN Amro Bank NV 0.50% 23/09/2029	232.815	0,07
EUR	2.200.000 Assicurazioni Generali SpA 2.12% 01/10/2030	1.642.450	0,46	EUR	1.300.000 ABN Amro Bank NV 0.88% 22/04/2025	1.238.219	0,35
EUR	400.000 Banco BPM SpA 0.88% 15/07/2026	338.279	0,10	EUR	600.000 Achmea BV 1.50% 26/05/2027	549.900	0,16
EUR	1.300.000 Ferrovie dello Stato 1.50% 27/06/2025	1.234.309	0,34	EUR	1.100.000 Allianz Finance II BV 0.00% 22/11/2026	967.572	0,27
EUR	1.200.000 Ferrovie dello Stato Italiane SpA 1.13% 09/07/2026	1.084.127	0,31	EUR	2.600.000 Allianz Finance II BV 1.50% 15/01/2030	2.281.256	0,64
EUR	2.200.000 Intesa Sanpaolo SpA 0.75% 04/12/2024	2.069.702	0,58	EUR	800.000 Cooperatieve Rabobank UA 0.25% 30/10/2026	701.856	0,20
EUR	1.800.000 Snam SpA 0.00% 07/12/2028	1.370.224	0,39	GBP	1.000.000 Cooperatieve Rabobank UA 4.63% 23/05/2029	961.667	0,27
EUR	1.800.000 Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 0.38% 23/06/2029	1.418.238	0,40	EUR	600.000 Cooperatieve Rabobank UA - Perp FRN	401.385	0,11
EUR	400.000 Terna Rete Elettrica Nazionale SpA - Perp FRN	307.206	0,09	EUR	1.000.000 Cooperatieve Rabobank UA - Perp FRN	829.080	0,23
EUR	200.000 Terna Rete Elettrica Nazionale SpA - Perp FRN	153.603	0,04	EUR	200.000 Cooperatieve Rabobank UA - Perp FRN	165.816	0,05
	Total de Italia	11.359.536	3,20	EUR	3.700.000 De Volksbank NV FRN 22/10/2030	3.288.909	0,93
LUXEMBURGO				EUR	1.450.000 Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	1.114.517	0,31
EUR	2.850.000 Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	2.621.364	0,73	EUR	3.290.000 Digital Intrepid Holding BV 0.63% 15/07/2031	2.206.955	0,63
EUR	400.000 Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 12/02/2036	271.380	0,08	EUR	1.000.000 EDP Finance BV 1.88% 21/09/2029	873.066	0,25
EUR	850.000 Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	514.550	0,15	EUR	300.000 EnBW International Finance BV 1.88% 31/10/2033	223.006	0,06
EUR	600.000 CPI Property Group SA 1.75% 14/01/2030	415.826	0,12	EUR	2.200.000 Enel Finance International NV 1.50% 21/07/2025	2.089.734	0,59
EUR	900.000 CPI Property Group SA 2.75% 12/05/2026	777.772	0,22	EUR	1.775.000 Enexis Holding NV 0.38% 14/04/2033	1.245.126	0,35
EUR	2.500.000 Holcim Finance Luxembourg SA 0.50% 23/04/2031	1.768.490	0,50	EUR	1.029.000 Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	765.251	0,22
EUR	1.259.000 P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	935.328	0,26	EUR	221.000 Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	164.354	0,05
EUR	241.000 P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	179.042	0,05	EUR	1.597.000 GSK Consumer Healthcare Capital NI BV 1.75% 29/03/2030	1.354.736	0,38
EUR	2.800.000 Prologis International Funding II SA 1.63% 17/06/2032	2.109.148	0,59				

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)				ESPAÑA (continuación)					
EUR	500.000	Iberdrola International BV - Perp FRN	472.748	0,13	EUR	1.000.000	Banco de Sabadell SA FRN 11/03/2027	887.882	0,25
GBP	3.300.000	ING Groep NV FRN 07/12/2028	2.784.340	0,79	EUR	1.100.000	Banco Santander SA 1.13% 23/06/2027	957.071	0,27
EUR	2.700.000	ING Groep NV 2.50% 15/11/2030	2.372.338	0,67	EUR	4.200.000	CaixaBank SA FRN 21/01/2028	3.594.199	1,01
EUR	100.000	NE Property BV 3.38% 14/07/2027	84.649	0,02	EUR	1.000.000	CaixaBank SA FRN 26/05/2028	823.233	0,23
EUR	600.000	NE Property BV 3.38% 14/07/2027	507.896	0,14	EUR	1.700.000	Iberdrola Finanzas SA 1.38% 11/03/2032	1.396.769	0,39
EUR	250.000	NederFinMaat 0.13% 03/04/2027	221.182	0,06	EUR	300.000	Red Electrica Financiaciones SAU 0.38% 24/07/2028	257.725	0,07
EUR	1.200.000	Rentokil Initial Finance BV 3.88% 27/06/2027	1.180.828	0,33	EUR	1.600.000	Telefonica Emisiones SA 2.59% 25/05/2031	1.436.032	0,41
EUR	900.000	Royal Schiphol Group NV 1.50% 05/11/2030	749.902	0,21			Total de España	10.849.865	3,05
EUR	300.000	Royal Schiphol Group NV 2.00% 06/04/2029	269.500	0,08			SUECIA		
EUR	1.000.000	Stedin Holding NV 0.00% 16/11/2026	869.709	0,25	EUR	1.500.000	Essity AB 1.13% 27/03/2024	1.458.207	0,41
EUR	3.400.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	2.696.054	0,76	EUR	100.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	82.963	0,02
EUR	364.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	289.531	0,08	EUR	500.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	414.816	0,12
EUR	2.200.000	Swisscom Finance BV 0.38% 14/11/2028	1.843.621	0,52			Total de Suecia	1.955.986	0,55
EUR	600.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	427.589	0,12			SUIZA		
EUR	100.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	71.265	0,02	EUR	1.000.000	Credit Suisse AG 0.45% 19/05/2025	912.052	0,26
EUR	500.000	TenneT Holding BV 0.50% 30/11/2040	281.106	0,08			Total de Suiza	912.052	0,26
EUR	1.393.000	TenneT Holding BV 0.88% 16/06/2035	970.746	0,27			REINO UNIDO		
EUR	2.100.000	TenneT Holding BV - Perp FRN	2.022.749	0,57	GBP	500.000	Aster Treasury plc 1.41% 27/01/2036	342.439	0,10
EUR	4.000.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	3.254.416	0,92	EUR	2.100.000	AstraZeneca plc 0.38% 03/06/2029	1.727.014	0,49
EUR	5.200.000	Volkswagen International Finance NV 0.88% 22/09/2028	4.279.142	1,21	GBP	800.000	BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	805.314	0,23
		Total de Países Bajos	47.304.531	13,35	EUR	575.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	429.794	0,12
					EUR	125.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	93.433	0,03
					GBP	200.000	Cardiff University 3.00% 07/12/2055	155.039	0,04
NORUEGA				GBP	810.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	835.122	0,24	
EUR	200.000	Avinor AS 0.75% 01/10/2030	160.035	0,05	GBP	630.000	Ds Smith plc 2.88% 26/07/2029	547.463	0,15
EUR	1.050.000	Avinor AS 0.75% 01/10/2030	840.185	0,24	GBP	400.000	DWR Cymru Financing UK plc 2.38% 31/03/2034	310.813	0,09
EUR	1.850.000	Avinor AS 1.00% 29/04/2025	1.758.949	0,49	USD	1.000.000	HSBC Holdings plc FRN 22/11/2023	1.017.185	0,29
EUR	200.000	Avinor AS 1.25% 09/02/2027	182.268	0,05	GBP	300.000	Legal & General FRN 27/10/2045	316.159	0,09
EUR	1.626.000	DNB Bank ASA FRN 21/09/2027	1.593.177	0,45					
		Total de Noruega	4.534.614	1,28					
ESPAÑA									
EUR	1.600.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.75% 04/06/2025	1.496.954	0,42					

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)					
REINO UNIDO (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
EUR	3.800.000	Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	3.075.160	0,87	EUR	1.000.000	Becton Dickinson and Company 1.40% 24/05/2023	992.903	0,28
EUR	1.500.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.19% 20/01/2025	1.401.622	0,40	USD	1.100.000	Becton Dickinson and Company 2.82% 20/05/2030	942.515	0,27
EUR	300.000	Nationwide Building Society 2.00% 28/04/2027	275.674	0,08	EUR	4.074.000	Prologis Euro Finance LLC 0.38% 06/02/2028	3.382.817	0,96
EUR	8.050.000	NatWest Group plc FRN 26/02/2030	6.133.378	1,73	USD	2.600.000	Roche Holdings Inc. 2.38% 28/01/2027	2.401.214	0,68
EUR	200.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	158.766	0,04	Total de Estados Unidos			7.906.741	2,24
GBP	500.000	Paragon Treasury plc 2.00% 07/05/2036	368.593	0,10	Total de bonos			260.227.392	73,44
GBP	900.000	Pearson Funding plc 3.75% 04/06/2030	838.069	0,24	Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
GBP	450.000	Platform HG Financing plc 1.93% 15/09/2041	295.175	0,08	AUSTRIA				
GBP	400.000	RCB Bonds plc 3.50% 08/12/2031	339.973	0,10	EUR	700.000	Oesterreichische Kontrollbank AG 0.00% 08/10/2026	626.449	0,18
GBP	500.000	RI Finance FRN 30/11/2043	558.370	0,16	Total de Austria			626.449	0,18
GBP	500.000	RI Finance Bonds No 4 plc FRN 07/10/2049	380.717	0,11	BÉLGICA				
GBP	500.000	Severn Trent Utilities Finance plc 2.00% 02/06/2040	331.707	0,09	EUR	250.000	Belgium (Govt of) 1.25% 22/04/2033	216.762	0,06
GBP	1.100.000	Stonewater Funding plc 1.63% 10/09/2036	771.697	0,22	EUR	1.500.000	Communaute Francaise de Belgique 0.63% 11/06/2035	1.086.570	0,31
EUR	2.690.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	2.225.473	0,63	EUR	1.400.000	Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap 0.38% 15/04/2030	1.178.346	0,33
GBP	500.000	Thames Water Utilities Finance plc 1.88% 24/01/2024	539.704	0,15	EUR	1.800.000	Region Wallonne 1.05% 22/06/2040	1.244.734	0,35
GBP	200.000	University College London 1.63% 04/06/2061	115.769	0,03	Total de Bélgica			3.726.412	1,05
GBP	300.000	University of Southampton 2.25% 11/04/2057	193.309	0,06	FINLANDIA				
USD	1.000.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	972.928	0,27	EUR	1.700.000	Kuntarahoitus Oyj 0.05% 10/09/2035	1.149.783	0,32
EUR	8.950.000	WellCome Trust Limited 1.13% 21/01/2027	8.132.089	2,29	Total de Finlandia			1.149.783	0,32
EUR	308.000	Western Power Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	296.404	0,08	FRANCIA				
GBP	1.600.000	Yorkshire Building Society FRN 11/10/2030	1.431.012	0,40	EUR	2.500.000	Action Logement Services SAS 3.13% 28/09/2037	2.390.013	0,68
Total de Reino Unido			35.415.364	10,00	USD	1.400.000	Agence Francaise de Developpement 4.00% 21/09/2027	1.401.160	0,40
ESTADOS UNIDOS					EUR	400.000	Agence France Locale 0.20% 20/03/2029	341.200	0,10
USD	225.000	Astrazeneca Finance LLC 2.25% 28/05/2031	187.292	0,05	EUR	1.000.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/02/2028	867.393	0,24

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)						
FRANCIA (continuación)				ALEMANIA (continuación)						
EUR	1.200.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/11/2030	956.647	0,27	EUR	600.000	Nordrhein-Westfalen Land 0.95% 13/03/2028	545.216	0,15	
USD	300.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 2.13% 26/01/2032	257.877	0,07	Total de Alemania					
GBP	1.200.000	Caisse D'amortissement de la Dette Sociale 0.13% 15/12/2025	1.170.915	0,33				10.531.099	2,96	
EUR	300.000	Caisse Francaise de Financement Local 0.01% 07/05/2025	279.359	0,08	HUNGRÍA					
EUR	1.100.000	Caisse Francaise de Financement Local 0.50% 19/02/2027	990.433	0,28	EUR	250.000	MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt 1.38% 24/06/2025	228.308	0,06	
EUR	2.100.000	City of Paris France 1.38% 20/11/2034	1.725.781	0,49	Total de Hungría					
EUR	400.000	France (Govt of) 1.75% 25/06/2039	336.766	0,10				228.308	0,06	
EUR	1.200.000	Region of Ile de France 0.00% 20/04/2028	1.038.552	0,29	IRLANDA					
EUR	700.000	Region of Ile de France 0.50% 14/06/2025	666.936	0,19	EUR	25.000	Ireland (Govt of) 1.35% 18/03/2031	22.954	0,01	
EUR	400.000	Region of Ile de France 0.61% 02/07/2040	257.972	0,07	Total de Irlanda					
EUR	700.000	SNCF SA 1.00% 19/01/2061	322.287	0,09				22.954	0,01	
EUR	600.000	Societe du Grand Paris EPIC 0.00% 25/11/2030	482.056	0,14	ITALIA					
EUR	100.000	Societe du Grand Paris EPIC 1.70% 25/05/2050	71.698	0,02	EUR	1.900.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 0.75% 21/11/2022	1.899.357	0,54	
EUR	3.000.000	Unedic Asseo 0.00% 25/11/2028	2.555.971	0,73	EUR	800.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 1.00% 11/02/2030	638.737	0,18	
EUR	1.700.000	Unedic Asseo 0.00% 19/11/2030	1.364.608	0,39	EUR	1.200.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 1.50% 20/04/2023	1.197.989	0,34	
EUR	1.200.000	Unedic Asseo 0.10% 25/11/2026	1.089.742	0,31	EUR	700.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 2.00% 20/04/2027	648.528	0,18	
EUR	600.000	Unedic Asseo 1.75% 25/11/2032	538.822	0,15	EUR	2.300.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 2.13% 21/03/2026	2.193.519	0,62	
Total de Francia				19.106.188	5,42	EUR	250.000	Italy (Govt of) 1.50% 30/04/2045	148.734	0,04
ALEMANIA						Total de Italia				
EUR	494.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/11/2028	438.499	0,12				6.726.864	1,90	
EUR	1.200.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2030	1.026.624	0,29	LUXEMBURGO					
EUR	2.245.000	Germany (Govt of) 1.30% 15/10/2027	2.176.483	0,61	EUR	775.000	Luxembourg (Govt of) 0.00% 14/09/2032	579.532	0,16	
EUR	400.000	Hesse (Govt of) 0.01% 18/06/2031	309.609	0,09	Total de Luxemburgo					
EUR	2.000.000	Investitionsbank Berlin 2.75% 04/10/2027	1.997.616	0,56				579.532	0,16	
EUR	1.475.000	Land Nordrhein-Westfalen 0.60% 04/06/2041	976.539	0,28	PAÍSES BAJOS					
EUR	3.500.000	Landwirtschaftliche Rentenbank 0.00% 22/09/2027	3.060.513	0,86	EUR	1.165.000	Bank Nederlandse Gemeenten NV 0.05% 13/07/2024	1.114.852	0,31	
						EUR	600.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 0.13% 03/09/2035	410.502	0,12
						EUR	800.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 1.50% 15/06/2039	636.604	0,18
						EUR	500.000	Netherlands (Govt of) 0.50% 15/01/2040	355.535	0,10
						Total de Países Bajos				
								2.517.493	0,71	

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)					
ESPAÑA				SUPRANACIONAL (continuación)					
EUR	1.400.000	Autonomous Community of Andalusia 0.50% 30/04/2031	1.107.855	0,31	EUR	5.690.000	European Union 0.00% 02/06/2028	4.896.667	1,39
EUR	1.000.000	Autonomous Community of Andalusia 2.40% 30/04/2032	914.780	0,26	EUR	100.000	European Union 0.00% 04/07/2035	67.932	0,02
EUR	1.700.000	Autonomous Community of Madrid 0.42% 30/04/2030	1.396.297	0,39	EUR	700.000	European Union 0.00% 04/07/2035	475.526	0,13
EUR	700.000	Autonomous Community of Madrid 1.57% 30/04/2029	641.258	0,18	EUR	1.700.000	European Union 0.10% 04/10/2040	1.000.705	0,28
EUR	3.200.000	Autonomous Community of Madrid 1.72% 30/04/2032	2.770.093	0,79	EUR	2.700.000	European Union 0.30% 04/11/2050	1.351.272	0,38
EUR	300.000	Basque Government 1.88% 30/07/2033	260.216	0,07	GBP	250.000	Inter-American Development Bank 0.50% 15/09/2026	239.255	0,07
EUR	1.500.000	Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2025	1.413.561	0,40	EUR	500.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.01% 24/04/2028	427.741	0,12
EUR	200.000	Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2025	188.475	0,05	EUR	399.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.20% 21/01/2061	167.434	0,05
EUR	700.000	Instituto de Credito Oficial 0.25% 30/04/2024	679.614	0,19	EUR	300.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.70% 22/10/2046	188.492	0,05
EUR	3.500.000	Instituto de Credito Oficial 0.75% 31/10/2023	3.451.475	0,97	EUR	100.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.70% 22/10/2046	62.831	0,02
EUR	25.000	Spain (Govt of) 1.00% 30/07/2042	16.173	0,00	USD	210.000	International Bank for Reconstruction & Development 1.13% 13/09/2028	179.576	0,05
EUR	400.000	Xunta de Galicia 0.08% 30/07/2027	351.289	0,10	USD	2.790.000	International Finance Facility for Immunisation Company 0.38% 06/11/2023	2.725.119	0,77
		Total de España	13.191.086	3,71			Total de supranacional	29.048.026	8,20
SUPRANACIONAL				SUECIA					
USD	350.000	African Development Bank 0.75% 03/04/2023	350.973	0,10	SEK	3.000.000	Sweden (Govt of) 0.13% 09/09/2030	234.466	0,07
CAD	300.000	Asian Development Bank 1.50% 04/05/2028	198.636	0,06			Total de Suecia	234.466	0,07
CAD	800.000	Asian Development Bank 1.63% 28/01/2025	563.763	0,16	REINO UNIDO				
GBP	1.000.000	Asian Development Bank FRN 23/05/2029	1.193.001	0,34	GBP	1.118.000	International Finance Facility for Immunisation Company 2.75% 07/06/2025	1.193.900	0,34
EUR	1.450.000	Council of Europe 0.38% 27/03/2025	1.370.556	0,39					
EUR	1.000.000	Council of Europe Development Bank 0.00% 10/04/2026	908.895	0,26					
EUR	4.000.000	Council of Europe Development Bank 0.00% 09/04/2027	3.535.344	0,99					
EUR	5.000.000	Council of Europe Development Bank 1.00% 13/04/2029	4.450.685	1,25					
EUR	2.000.000	European Investment Bank 0.00% 15/05/2028	1.716.784	0,48					
GBP	975.000	European Investment Bank 0.88% 15/05/2026	961.610	0,27					

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*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)			
REINO UNIDO (continuación)			
GBP	5.000 United Kingdom Gilt 0.88% 31/07/2033	4.064	0,00
Total de Reino Unido		1.197.964	0,34
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda		88.886.624	25,09
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		349.114.016	98,53
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente			
Bonos			
PAÍSES BAJOS			
USD	550.000 Cooperatieve Rabobank UA 1.00% 24/09/2026	488.151	0,14
Total de Países Bajos		488.151	0,14
Total de bonos		488.151	0,14
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		488.151	0,14
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
61	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	5.990	0,00
Total de Irlanda		5.990	0,00
Total de fondos		5.990	0,00
Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		5.990	0,00
Valor total de las inversiones		349.608.157	98,67
(Coste total: 416.855.015 EUR)			

* Diferencias menores debido al redondeo.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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	APA Infrastructure Limited 1.25% 15/03/2033	572.165	0,38	EUR	377.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	197.701	0,13
EUR	935.000	APA Infrastructure Limited 2.00% 15/07/2030	763.624	0,51	EUR	480.000	Chrome Holding SASU 5.00% 31/05/2029	366.227	0,24
EUR	418.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	300.287	0,20	EUR	832.000	Constellium SE 3.13% 15/07/2029	600.435	0,40
EUR	250.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	179.597	0,12	EUR	700.000	Credit Agricole SA 2.50% 29/08/2029	641.926	0,43
GBP	840.000	Pacific National Finance Pty Ltd 5.00% 19/09/2023	942.043	0,63	EUR	600.000	Electricite de France SA - Perp FRN	422.914	0,28
		Total de Australia	2.757.716	1,84	EUR	400.000	Electricite de France SA - Perp FRN	273.541	0,18
BÉLGICA				EUR 431.000 Elior Group SA 3.75% 15/07/2026 331.554 0,22					
EUR	519.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 3.70% 02/04/2040	472.874	0,32	EUR	367.000	Emeria SASU 3.38% 31/03/2028	296.898	0,20
EUR	400.000	Kbc Group NV - Perp FRN	319.161	0,21	EUR	357.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2027	263.299	0,18
EUR	800.000	VGP NV 1.63% 17/01/2027	642.731	0,43	EUR	687.000	Faurecia SE 2.75% 15/02/2027	529.537	0,35
		Total de Bélgica	1.434.766	0,96	EUR	677.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	620.455	0,41
CANADÁ				EUR 861.000 Iliad Holdings SAS 5.13% 15/10/2026 779.603 0,52					
EUR	299.000	Primo Water Holdings Inc. 3.88% 31/10/2028	247.399	0,17	EUR	200.000	Iliad SA 0.75% 11/02/2024	188.662	0,13
		Total de Canadá	247.399	0,17	EUR	200.000	Iliad SA 1.50% 14/10/2024	186.846	0,12
ISLAS CAIMÁN				EUR 200.000 Iliad SA 1.88% 11/02/2028 159.721 0,11					
USD	1.089.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	852.935	0,57	EUR	270.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	242.696	0,16
USD	800.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	727.198	0,49	EUR	158.000	RCl Banque SA 4.88% 21/09/2028	152.995	0,10
GBP	3.235.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	2.974.041	1,98	EUR	314.000	Rexel SA 2.13% 15/12/2028	241.290	0,16
USD	534.000	Tencent Holdings Limited 3.24% 03/06/2050	330.785	0,22	EUR	1.700.000	Sanef SA 1.88% 16/03/2026	1.594.308	1,07
		Total de Islas Caimán	4.884.959	3,26	EUR	400.000	Verallia SA 1.63% 14/05/2028	317.481	0,21
FRANCIA				EUR 600.000 Verallia SA 1.88% 10/11/2031 412.395 0,28					
EUR	152.000	Altice France SA 3.38% 15/01/2028	116.195	0,08	Total de Francia	10.489.489	7,00		
EUR	171.000	Altice France SA 4.00% 15/07/2029	130.188	0,09	ALEMANIA				
EUR	707.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	538.252	0,36	EUR	400.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	327.826	0,22
EUR	1.000.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	673.286	0,45	EUR	700.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	574.284	0,38
EUR	431.000	Casino Guichard Perrachon SA 5.25% 15/04/2027	211.084	0,14	EUR	1.400.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	968.797	0,65
					EUR	600.000	Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032	590.216	0,39
					EUR	700.000	BASF SE 3.75% 29/06/2032	662.769	0,44
					EUR	1.200.000	Bayer AG 1.13% 06/01/2030	954.797	0,65
					EUR	477.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	392.020	0,26
					EUR	131.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	107.934	0,07

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)				INDIA					
EUR	700.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	638.227	0,43	USD	1.328.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	1.139.632	0,76
EUR	200.000	Commerzbank AG FRN 06/12/2032	191.957	0,13	USD	535.000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	443.368	0,30
EUR	500.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	379.095	0,25	Total de India			1.583.000	1,06
EUR	300.000	Deutsche Bank AG FRN 05/09/2030	282.452	0,19	IRLANDA				
EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	179.452	0,12	EUR	1.000.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	903.424	0,60
EUR	400.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	313.290	0,21	EUR	450.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	391.614	0,26
EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	168.596	0,11	EUR	720.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	589.351	0,39
EUR	100.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	85.912	0,06	EUR	969.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	858.804	0,57
EUR	247.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	205.948	0,14	GBP	135.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III 4.88% 15/07/2028	115.207	0,08
EUR	648.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	540.300	0,36	Total de Irlanda			2.858.400	1,90
EUR	5.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.01% 05/05/2027	4.458.537	2,98	ITALIA				
EUR	800.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	528.771	0,35	EUR	880.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 26/09/2029	653.817	0,44
EUR	513.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	406.293	0,27	EUR	1.201.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	928.854	0,62
EUR	492.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	398.406	0,27	EUR	565.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	401.998	0,27
EUR	705.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	568.199	0,38	EUR	385.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	312.776	0,21
EUR	800.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	727.027	0,49	EUR	371.000	ENI SpA - Perp FRN	281.076	0,19
EUR	310.000	Schaeffler AG 2.88% 26/03/2027	265.953	0,18	EUR	387.000	Fis Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	324.042	0,22
EUR	100.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	81.962	0,05	EUR	150.000	Gamma Bidco SpA 6.25% 15/07/2025	138.811	0,09
EUR	216.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 2.00% 15/07/2025	189.821	0,13	EUR	586.000	IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3.75% 15/01/2028	465.383	0,31
EUR	316.511	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	285.511	0,19	EUR	287.000	International Design Group SPA 6.50% 15/11/2025	261.922	0,17
EUR	200.000	Vier Gas Transport GmbH 0.13% 10/09/2029	145.486	0,10	EUR	178.000	Lottomatica SpA 9.75% 30/09/2027	178.609	0,12
EUR	500.000	Vier Gas Transport GmbH 4.00% 26/09/2027	491.007	0,33	EUR	304.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	260.497	0,17
EUR	1.400.000	Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	1.369.627	0,90	EUR	600.000	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA - Perp FRN	460.809	0,31
EUR	600.000	Vonovia SE 1.50% 14/06/2041	327.564	0,22	Total de Italia			4.668.594	3,12
EUR	700.000	Vonovia SE 1.88% 28/06/2028	595.698	0,40					
Total de Alemania		18.403.734	12,30						

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	142.361	0,10	EUR	400.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.38% 15/10/2040	265.010	0,18
USD	762.845	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.16% 31/03/2034	640.818	0,43	USD	1.143.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	991.732	0,66
USD	776.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	614.238	0,41	EUR	1.406.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	1.044.536	0,69
EUR	631.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	484.904	0,32	EUR	322.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	304.258	0,20
EUR	245.000	Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	206.749	0,14	EUR	1.242.000	Selp Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	1.148.027	0,77
Total de Jersey - Islas del Canal			2.089.070	1,40	Total de Luxemburgo			12.890.892	8,61
LUXEMBURGO				MÉXICO					
EUR	400.000	Adler Group SA 3.25% 05/08/2025	220.979	0,15	EUR	486.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 16/04/2026	391.027	0,26
EUR	568.000	Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	428.909	0,29	EUR	214.000	Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	148.584	0,10
EUR	225.000	Altice Financing SA 4.25% 15/08/2029	174.994	0,12	Total de México			539.611	0,36
EUR	1.090.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	830.130	0,55	PAÍSES BAJOS				
EUR	2.200.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	1.668.350	1,10	EUR	399.000	Alliander NV 2.63% 09/09/2027	387.295	0,26
GBP	300.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	247.308	0,17	EUR	611.000	Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	489.607	0,33
GBP	383.000	B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	372.102	0,25	EUR	160.000	Constellium NV 4.25% 15/02/2026	144.293	0,10
EUR	680.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.33% 13/08/2028	555.083	0,38	EUR	525.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	497.930	0,33
EUR	298.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 12/02/2036	202.178	0,13	EUR	545.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	370.613	0,25
EUR	670.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	405.586	0,27	GBP	1.508.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	1.660.282	1,10
EUR	662.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	529.007	0,35	EUR	700.000	ING Groep NV FRN 29/09/2028	569.012	0,38
EUR	453.457	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	443.373	0,30	EUR	800.000	ING Groep NV FRN 16/02/2031	649.814	0,43
EUR	311.000	Gamma Bondco Sarl 8.13% 15/11/2026	257.031	0,17	EUR	450.000	Lkq European Holdings BV 4.13% 01/04/2028	421.074	0,28
GBP	266.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	237.463	0,16	USD	667.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	537.693	0,36
EUR	1.200.000	Grand City Properties SA 0.13% 11/01/2028	893.008	0,60	EUR	451.000	Nederlandse Gasunie NV 3.38% 11/07/2034	416.618	0,28
EUR	1.430.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	1.078.332	0,72	EUR	416.000	Nobel Bidco BV 3.13% 15/06/2028	281.123	0,19
EUR	180.000	Lincoln Financing Sarl 3.63% 01/04/2024	174.910	0,12	EUR	105.000	PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	102.578	0,07
EUR	160.000	Loarre Investments Sarl FRN 15/05/2029	152.222	0,10	EUR	171.000	Repsol International Finance BV FRN 25/03/2075	161.096	0,11
EUR	280.000	Loarre Investments Sarl 6.50% 15/05/2029	266.364	0,18	EUR	750.000	Sagax Euro MTN BV 0.75% 26/01/2028	539.851	0,36
					EUR	1.258.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	1.000.631	0,67

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)					
PAÍSES BAJOS (continuación)				SUECIA (continuación)					
EUR	610.000	Stichting AK Rabobank - Perp 6.50%	560.622	0,37	EUR	327.000	Heimstaden Bostad AB - Perp FRN	237.938	0,16
EUR	473.700	Summer Bidco BV 9.00% 15/11/2025	349.817	0,23	EUR	660.000	Heimstaden Bostad AB - Perp FRN	441.039	0,29
EUR	100.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	76.874	0,05	EUR	200.000	Intrum Justitia AB 3.13% 15/07/2024	183.159	0,12
EUR	1.700.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	1.610.735	1,07	EUR	1.087.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	871.185	0,58
EUR	300.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	297.501	0,20	EUR	194.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	158.275	0,11
EUR	1.147.000	TenneT Holding BV - Perp FRN	1.039.693	0,69	EUR	555.000	Verisure Midholding A 5.25% 15/02/2029	410.294	0,27
EUR	1.000.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	813.603	0,54			Total de Suecia	2.505.982	1,67
EUR	280.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	252.727	0,17					
EUR	261.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	199.081	0,13					
EUR	109.000	United Group BV 4.63% 15/08/2028	77.525	0,05					
EUR	465.000	Universal Music Group NV 3.75% 30/06/2032	435.070	0,29					
		Total de Países Bajos	13.942.758	9,29					
PANAMÁ				SUIZA					
EUR	265.000	Carnival Corp. 7.63% 01/03/2026	207.267	0,14	EUR	857.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	650.511	0,43
		Total de Panamá	207.267	0,14	EUR	1.255.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	752.752	0,50
					EUR	300.000	Credit Suisse Group AG FRN 02/04/2032	232.733	0,16
					EUR	851.000	UBS AG 0.50% 31/03/2031	637.861	0,43
					USD	481.000	UBS Group AG - Perp FRN	417.275	0,28
					USD	275.000	UBS Group AG - Perp FRN	267.028	0,18
							Total de Suiza	2.958.160	1,98
ESPAÑA				REINO UNIDO					
GBP	500.000	Banco Santander SA FRN 30/08/2028	519.472	0,35	EUR	318.000	Anglo American Capital plc 4.75% 21/09/2032	307.790	0,21
EUR	400.000	Cellnex Finance Company SA 2.00% 15/02/2033	261.930	0,17	EUR	300.000	BCP V Modular Services Finance II plc 4.75% 30/11/2028	242.311	0,16
EUR	470.000	Grifols Escrow Issuer SA 3.88% 15/10/2028	348.587	0,24	GBP	710.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	530.340	0,35
EUR	346.000	Grifols SA 1.63% 15/02/2025	307.082	0,20	EUR	1.113.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	992.120	0,66
EUR	155.000	Kaixo Bondco Telecom SA 5.13% 30/09/2029	122.421	0,08	EUR	1.036.000	British American Tobacco plc - Perp FRN	766.459	0,51
EUR	904.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	788.395	0,53	EUR	1.375.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	1.027.768	0,69
EUR	298.000	Nortegas Energia Distribucion SA 2.07% 28/09/2027	265.988	0,18	GBP	548.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	564.996	0,38
		Total de España	2.613.875	1,75	GBP	509.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	435.531	0,29
					EUR	632.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	552.523	0,36
SUECIA					USD	875.446	Enquest plc 7.00% 15/10/2023	822.781	0,55
EUR	345.000	Heimstaden Bostad AB FRN 01/05/2170	204.092	0,14	EUR	1.074.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	1.023.742	0,68
					GBP	482.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	469.848	0,31

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)			
USD	728.000 HSBC Holdings plc FRN 11/08/2033	661.767	0,44	GBP	390.000 Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	380.271	0,25
USD	570.000 Imperial Brands Finance plc 3.50% 26/07/2026	527.285	0,35	GBP	384.172 Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	377.196	0,25
EUR	221.000 Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	189.474	0,13	GBP	620.000 Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	589.949	0,39
EUR	602.000 Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	516.125	0,34	EUR	1.405.000 Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	1.162.376	0,78
EUR	130.000 Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	107.366	0,07	GBP	216.000 Travis Perkins plc 3.75% 17/02/2026	211.342	0,14
EUR	362.000 Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	298.972	0,20	EUR	489.000 Victoria plc 3.63% 26/08/2026	360.162	0,24
GBP	514.000 Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	548.718	0,36	GBP	221.000 Virgin Media Secured Finance plc 4.25% 15/01/2030	184.581	0,12
EUR	301.000 International Game Technology plc 2.38% 15/04/2028	239.430	0,16	GBP	400.000 Virgin Money UK plc FRN 24/04/2026	402.841	0,27
EUR	450.000 International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	402.628	0,27	GBP	272.000 Vmed O2 UK Financing 4.00% 31/01/2029	235.625	0,16
GBP	315.000 Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	318.899	0,21	EUR	295.000 Vmed O2 UK Financing I plc 3.25% 31/01/2031	223.439	0,15
EUR	286.000 Jaguar Land Rover Automotive plc 4.50% 15/07/2028	186.849	0,12	EUR	432.000 Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	376.109	0,25
EUR	500.000 Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	391.786	0,26	USD	650.000 Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	632.403	0,42
GBP	445.000 Legal & General Group plc FRN 14/11/2048	427.366	0,29	EUR	483.000 Western Power Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	464.816	0,31
GBP	175.000 Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	160.884	0,11	GBP	978.000 Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	879.742	0,59
GBP	392.585 Mitchells & Butlers Finance plc 6.01% 15/12/2028	418.283	0,28		Total de Reino Unido	25.266.860	16,83
EUR	600.000 Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	475.508	0,32	ESTADOS UNIDOS			
EUR	1.030.000 Nationwide Building Society 3.25% 05/09/2029	964.054	0,64	USD	209.000 Amgen Inc. 4.20% 22/02/2052	168.368	0,11
EUR	602.000 NatWest Group plc FRN 14/09/2032	466.013	0,31	EUR	660.000 Ardagh Metal Packaging Finance LLC 2.00% 01/09/2028	505.925	0,34
GBP	239.000 NatWest Group plc - Perp FRN	204.866	0,14	EUR	190.000 Ardagh Metal Packaging Finance LLC 3.00% 01/09/2029	136.219	0,09
GBP	380.000 Ngg Finance plc FRN 18/06/2073	383.460	0,26	EUR	540.000 Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	412.690	0,28
EUR	2.087.000 NGG Finance plc FRN 05/09/2082	1.656.728	1,11	EUR	713.000 Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	544.903	0,36
EUR	375.000 Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	326.555	0,22	EUR	521.000 Bank of America Corp. FRN 24/05/2032	394.641	0,26
GBP	297.000 Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	289.392	0,19	EUR	889.000 Berkshire Hathaway Finance Corp 1.50% 18/03/2030	746.509	0,49
GBP	248.000 Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	228.050	0,15	USD	243.000 Boeing Company 5.93% 01/05/2060	213.620	0,14
GBP	165.000 Santander UK plc - Perp 10.06%	290.307	0,19	EUR	485.000 Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	375.942	0,25
EUR	481.000 Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	369.034	0,24				

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)					
EUR	480.000	Eli Lilly & Company 1.38% 14/09/2061	247.083	0,16	GBP	350.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	349.406	0,23
EUR	367.000	Fidelity National Information Services Inc 1.00% 03/12/2028	302.120	0,20	USD	404.000	T-Mobile USA Inc. 2.63% 15/02/2029	341.916	0,23
EUR	228.000	Fidelity National Information Services Inc 1.50% 21/05/2027	204.087	0,14	Total de Estados Unidos				
EUR	220.000	Fidelity National Information Services Inc 1.50% 21/05/2027	196.926	0,13	17.712.064 11,82				
GBP	319.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	327.957	0,22	ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)				
EUR	462.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	419.022	0,28	USD	443.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	426.155	0,28
EUR	804.000	General Motors Financial Company Inc. 0.60% 20/05/2027	654.976	0,44	Total de Islas Vírgenes (Británicas)				
USD	118.000	Goodman USA Finance Three 3.70% 15/03/2028	109.271	0,07	426.155 0,28				
EUR	700.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	564.122	0,38	Total de bonos				
EUR	395.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/03/2029	302.477	0,20	128.480.751 85,74				
EUR	478.000	IQVIA Inc. 2.88% 15/06/2028	390.963	0,27	Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
USD	560.000	JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	433.695	0,29	EGIPTO				
USD	1.627.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	1.286.765	0,87	EUR	450.000	Egypt (Govt of) 5.63% 16/04/2030	263.411	0,18
GBP	1.860.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	1.879.901	1,26	Total de Egipto				
USD	634.000	Lowe's Companies Inc. 5.80% 15/09/2062	596.973	0,39	263.411 0,18				
EUR	1.728.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	1.483.330	0,99	COSTA DE MARFIL				
EUR	2.160.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	1.913.154	1,28	EUR	250.000	Ivory Coast (Govt of) 5.25% 22/03/2030	183.742	0,12
USD	250.000	Occidental Petroleum Corp. 5.88% 01/09/2025	256.919	0,17	EUR	290.000	Ivory Coast (Govt of) 5.88% 17/10/2031	210.791	0,14
USD	220.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	226.816	0,15	Total de Costa de Marfil				
USD	152.000	Occidental Petroleum Corp. 8.00% 15/07/2025	165.156	0,11	394.533 0,26				
USD	145.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	159.853	0,11	SENEGAL				
USD	265.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	301.234	0,20	EUR	390.000	Senegal (Govt of) 4.75% 13/03/2028	316.303	0,21
EUR	513.000	Olympus Water USA 3.88% 01/10/2028	391.139	0,26	Total de Senegal				
EUR	214.000	Silgan Holdings Inc. 2.25% 01/06/2028	172.266	0,11	316.303 0,21				
EUR	530.000	Southern Company FRN 15/09/2081	372.706	0,25	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
EUR	190.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	163.014	0,11	974.247 0,65				
				Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa					
				129.454.998 86,39					

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 negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)						
Bonos				Bonos (continuación)						
AUSTRALIA				ITALIA						
USD	1.270.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	1.185.127	0,79	USD	400.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	336.693	0,22	
Total de Australia			1.185.127	0,79	Total de Italia			336.693	0,22	
PAÍSES BAJOS				PORTUGAL						
USD	467.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	474.274	0,32	EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	9.000	0,01	
Total de Países Bajos			474.274	0,32	Total de Portugal			9.000	0,01	
ESTADOS UNIDOS				REINO UNIDO						
USD	157.000	Occidental Petroleum Corp. 6.95% 01/07/2024	164.769	0,11	EUR	451.000	BCP V Modular Services Finance II plc 6.75% 30/11/2029	314.911	0,21	
USD	164.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	179.723	0,12	GBP	812.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	796.594	0,53	
USD	1.196.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	889.869	0,59	GBP	375.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	322.388	0,22	
Total de Estados Unidos			1.234.361	0,82	Total de Reino Unido			1.433.893	0,96	
Total de bonos			2.893.762	1,93	ESTADOS UNIDOS					
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente			2.893.762	1,93	USD	1.070.000	Stellantis Finance US Inc. 6.38% 12/09/2032	1.016.134	0,68	
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				Total de bonos				6.317.892	4,23	
Bonos				Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				6.317.892	4,23	
BERMUDAS				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios						
USD	833.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	816.635	0,54	Fondos					
Total de Bermudas			816.635	0,54	IRLANDA					
DINAMARCA				45.945				BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	4.504.951	3,01
USD	1.819.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	1.559.455	1,05	Total de Irlanda			4.504.951	3,01	
Total de Dinamarca			1.559.455	1,05	Total de fondos			4.504.951	3,01	
FRANCIA				Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				4.504.951	3,01	
USD	850.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	716.088	0,48	Valor total de las inversiones			143.171.603	95,56	
Total de Francia			716.088	0,48	(Coste total: 171.165.208 EUR)					
GIBRALTAR				* Diferencias menores debido al redondeo.						
EUR	510.000	888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027	429.994	0,29	** Título a su valor razonable.					
Total de Gibraltar			429.994	0,29						

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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	57.143	China Oil & Gas Group Limited 5.50% 25/01/2023	56.000	0,16	USD	200.000	Vale Overseas Limited 3.75% 08/07/2030	162.125	0,48	
USD	200.000	Ooredoo International Finance Limited 2.63% 08/04/2031	164.953	0,48	Total de Islas Caimán			3.643.850	10,68	
Total de Bermudas				220.953	0,64					
BRASIL				COLOMBIA						
USD	500.000	Light Servicos de Eletricidade SA 4.38% 18/06/2026	416.250	1,22	USD	500.000	Ecopetrol SA 4.63% 02/11/2031	351.025	1,03	
Total de Brasil				416.250	1,22	USD	500.000	Ecopetrol SA 6.88% 29/04/2030	422.187	1,24
				Total de Colombia				773.212	2,27	
CANADÁ				GUATEMALA						
USD	500.000	MEGlobal Canada ULCDL 5.00% 18/05/2025	487.007	1,43	USD	460.000	CT Trust 5.13% 03/02/2032	347.300	1,02	
Total de Canadá				487.007	1,43	Total de Guatemala			347.300	1,02
ISLAS CAIMÁN				HONG KONG						
USD	200.000	AAC Technologies Holdings Inc. 3.00% 27/11/2024	175.310	0,51	USD	800.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	791.518	2,32	
USD	200.000	Cifi Holdings Group Company Limited 6.00% 16/07/2025	45.000	0,13	USD	414.000	Lenovo Group Limited 6.54% 27/07/2032	386.055	1,13	
USD	200.000	CK Hutchison International 17 II Limited 3.25% 29/09/2027	185.483	0,54	USD	330.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	231.140	0,68	
USD	440.000	Country Garden Holdings Company Limited 3.13% 22/10/2025	143.242	0,42	Total de Hong Kong			1.408.713	4,13	
USD	600.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	534.300	1,57	INDIA					
USD	212.000	ENN Energy Holdings Limited 2.63% 17/09/2030	172.928	0,51	USD	550.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	417.207	1,22	
USD	400.000	Goodman HK Finance 3.00% 22/07/2030	329.662	0,97	USD	220.000	Adani Green Energy Limited 4.38% 08/09/2024	183.150	0,54	
USD	400.000	Meituan Inc. 3.05% 28/10/2030	268.000	0,78	USD	400.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	350.146	1,02	
USD	400.000	Melco Resorts Finance Limited 5.75% 21/07/2028	259.996	0,76	USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.20% 04/08/2027	176.336	0,52	
USD	200.000	Qnb Finance Limited 2.75% 12/02/2027	180.617	0,53	USD	200.000	Bharti Airtel Limited 4.38% 10/06/2025	193.213	0,57	
USD	200.000	QNB Finance Limited 2.75% 12/02/2027	180.617	0,53	USD	200.000	Indian Railway Finance Corp. Limited 3.57% 21/01/2032	160.384	0,47	
USD	400.000	Saudi Electricity Company 2.41% 17/09/2030	335.080	0,98	USD	200.000	JSW Steel Limited 5.95% 18/04/2024	193.465	0,56	
USD	200.000	Tencent Holdings Limited 2.88% 22/04/2031	162.683	0,48	USD	250.000	Reliance Industries Limited 3.67% 30/11/2027	229.986	0,68	
USD	200.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	180.436	0,53	USD	475.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	359.835	1,06	
USD	367.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp. 1.63% 24/09/2025	328.371	0,96	Total de India			2.263.722	6,64	

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	287.415	0,84	USD	200.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	178.279	0,52
USD	208.000	Saka Energi Indonesia Pt 4.45% 05/05/2024	192.090	0,56	USD	400.000	HTA Group Limited 7.00% 18/12/2025	350.240	1,03
USD	600.000	Sri Rejeki Isman TBK PT 7.25% 16/01/2025	42.000	0,12	USD	300.000	Network I2i Limited - Perp FRN	274.013	0,80
Total de Indonesia			521.505	1,52	Total de Mauricio			802.532	2,35
IRLANDA				MÉXICO					
USD	400.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	213.450	0,63	USD	400.000	America Movil SAB De CV 5.38% 04/04/2032	343.704	1,01
USD	200.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 3.05% 23/01/2025	104.000	0,30	USD	500.000	BBVA Bancomer SA FRN 13/09/2034	430.415	1,26
Total de Irlanda			317.450	0,93	USD	400.000	Braskem Idesa SAPI 6.99% 20/02/2032	267.250	0,78
ISLA DE MAN				USD 400.000 Cemex SAB de CV 5.20% 17/09/2030				347.897	1,02
USD	200.000	AngloGold Ashanti Holdings plc 3.75% 01/10/2030	156.779	0,46	USD	400.000	Cemex SAB de CV 7.38% 05/06/2027	398.923	1,17
USD	400.000	Gohl Capital Limited 4.25% 24/01/2027	337.507	0,99	USD	237.000	Gruma SAB de CV 4.88% 01/12/2024	234.749	0,69
Total de Isla de Man			494.286	1,45	USD	600.000	Petroleos Mexicanos 6.70% 16/02/2032	423.164	1,24
JERSEY - ISLAS DEL CANAL				Total de México				2.446.102	7,17
USD	200.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	155.087	0,45	MARRUECOS				
USD	440.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 3.25% 30/09/2040	322.024	0,95	USD	240.000	OCP SA 3.75% 23/06/2031	181.782	0,53
Total de Jersey - Islas del Canal			477.111	1,40	USD	557.000	OCP SA 6.88% 25/04/2044	455.520	1,34
KAZAJISTÁN				Total de Marruecos				637.302	1,87
USD	400.000	KazMunayGas National Company JSC 4.75% 24/04/2025	369.100	1,08	PAÍSES BAJOS				
Total de Kazajistán			369.100	1,08	USD	362.900	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	294.355	0,86
LUXEMBURGO				USD 230.000 Metinvest BV 8.50% 23/04/2026				107.859	0,32
USD	550.000	Hidrovias International Finance Sarl 4.95% 08/02/2031	425.356	1,25	USD	500.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	394.866	1,16
USD	250.000	Mhp Lux SA 0.00% 03/04/2026	125.720	0,37	USD	392.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 3.15% 01/10/2026	323.126	0,95
USD	500.000	Mhp SE 0.00% 10/05/2024	268.360	0,79	USD	250.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 4.75% 09/05/2027	212.328	0,62
USD	544.500	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	462.825	1,36	Total de Países Bajos			1.332.534	3,91
Total de Luxemburgo			1.282.261	3,77	PERÚ				
				USD 500.000 Auna SA 6.50% 20/11/2025				403.174	1,18

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)					
PERÚ (continuación)				SINGAPUR (continuación)					
USD	95.000	Volcan Cia Minera SA 4.38% 11/02/2026	79.168	0,23	USD	450.000	United Overseas Bank LT FRN 16/03/2031	395.335	1,16
Total de Perú			482.342	1,41	Total de Singapur			1.323.353	3,89
FILIPINAS				SUDÁFRICA					
USD	250.000	Globe Telecom Inc. 2.50% 23/07/2030	195.344	0,57	USD	200.000	Eskom Holdings 6.75% 06/08/2023	189.977	0,56
USD	200.000	International Container Terminal Services Inc 4.75% 17/06/2030	180.236	0,53	USD	250.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	222.335	0,65
USD	357.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	326.294	0,96	Total de Sudáfrica			412.312	1,21
USD	200.000	Pldt Inc. 2.50% 23/01/2031	164.157	0,48	TAILANDIA				
USD	430.000	Smc Global Power Holdings Corp. - Perp FRN	364.339	1,07	USD	700.000	Bangkok Bank pcl FRN 25/09/2034	576.396	1,69
Total de Filipinas			1.230.370	3,61	USD	200.000	GC Treasury Centre Company Limited 2.98% 18/03/2031	157.446	0,46
CATAR				TURQUÍA					
USD	410.000	Qatar Petroleum 2.25% 12/07/2031	329.220	0,97	USD	200.000	Akbank TAS 6.80% 06/02/2026	178.476	0,52
Total de Catar			329.220	0,97	USD	380.000	KOC Holding AS 6.50% 11/03/2025	357.136	1,04
REPÚBLICA DE COREA (SUR)				EMIRATOS ÁRABES UNIDOS					
USD	200.000	Kookmin Bank 4.50% 01/02/2029	188.243	0,55	USD	700.000	DP World Limited 6.85% 02/07/2037	710.591	2,08
USD	380.000	Sk Hynix Inc. 1.50% 19/01/2026	331.488	0,97	Total de Emiratos Árabes Unidos			710.591	2,08
Total de República de Corea (Sur)			519.731	1,52	REINO UNIDO				
ARABIA SAUDÍ				REINO UNIDO					
USD	400.000	Saudi Arabian Oil Company 2.25% 24/11/2030	324.452	0,95	USD	400.000	Endeavour Mining plc 5.00% 14/10/2026	318.684	0,93
USD	500.000	Saudi Arabian Oil Company 2.25% 24/11/2030	405.564	1,19	USD	300.000	Gazprom PJSC Via Gaz Finance plc 3.25% 25/02/2030	141.600	0,42
USD	400.000	Saudi Arabian Oil Company 3.50% 16/04/2029	362.681	1,06	Total de Reino Unido			460.284	1,35
USD	200.000	Saudi Arabian Oil Company 3.50% 16/04/2029	181.341	0,53	SINGAPUR				
Total de Arabia Saudí			1.274.038	3,73	USD	200.000	BOC Aviation Limited 2.63% 17/09/2030	162.114	0,48
SINGAPUR				SINGAPUR					
USD	600.000	DBS Group Holdings Limited FRN 11/12/2028	594.082	1,75	USD	200.000	SingTel Group Treasury Pte Limited 2.38% 28/08/2029	171.822	0,50

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)				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario							
Bonos (continuación)				Bonos							
REINO UNIDO (continuación)				LUXEMBURGO							
USD	450.000	Nak Naftogaz Ukraine Via Kondor Finance plc 7.63% 08/11/2026	97.997	0,29	USD	500.000	Altice Financing SA 5.00% 15/01/2028	386.363	1,13		
USD	200.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	130.075	0,38	Total de Luxemburgo			386.363	1,13		
Total de Reino Unido				688.356	2,02	Total de bonos				386.363	1,13
ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)				Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				386.363	1,13		
USD	460.000	Central American Bottling Corp. 5.25% 27/04/2029	397.038	1,16	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios						
USD	400.000	Contemporary Ruiding Development Limited 2.63% 17/09/2030	315.190	0,93	Fondos						
USD	400.000	Elect Global Investments Limited - Perp FRN	337.620	0,99	IRLANDA						
USD	450.000	FPC Resources Limited 4.38% 11/09/2027	431.239	1,26	516.082	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund		516.082	1,51		
USD	400.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	376.959	1,11	Total de Irlanda			516.082	1,51		
USD	511.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	449.602	1,33	Total de fondos				516.082	1,51	
USD	728.000	Jgsh Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	664.664	1,95	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				516.082	1,51	
USD	400.000	Studio City Finance Limited 5.00% 15/01/2029	186.564	0,55	Valor total de las inversiones				32.540.613	95,42	
USD	200.000	Studio City Finance Limited 6.00% 15/07/2025	115.131	0,34	(Coste total: 40.338.201 USD)						
USD	467.000	Tsmc Global Limited 0.75% 28/09/2025	411.638	1,21	<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>						
Total de Islas Virgenes (Británicas)				3.685.645	10,83						
Total de bonos				31.306.944	91,81						
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda											
SUDÁFRICA											
USD	400.000	South Africa (Govt of) 4.85% 30/09/2029	331.224	0,97							
Total de Sudáfrica				331.224	0,97						
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				331.224	0,97						
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				31.638.168	92,78						

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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)					
AZERBAIYÁN				INDONESIA (continuación)					
USD	200.000	Azerbaijan (Govt of) 3.50% 01/09/2032	160.991	0,59	USD	200.000	Saka Energi Indonesia Pt 4.45% 05/05/2024	184.702	0,68
Total de Azerbaiyán			160.991	0,59	Total de Indonesia			583.687	2,14
BERMUDAS				IRLANDA					
USD	200.000	Ooredoo International Finance Limited 2.63% 08/04/2031	164.953	0,61	USD	200.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	106.725	0,39
Total de Bermudas			164.953	0,61	Total de Irlanda			106.725	0,39
CANADÁ				ISLA DE MAN					
USD	316.000	MEGlobal Canada ULCDL 5.00% 18/05/2025	307.789	1,13	USD	200.000	AngloGold Ashanti Holdings plc 3.75% 01/10/2030	156.779	0,58
Total de Canadá			307.789	1,13	Total de Isla de Man			156.779	0,58
ISLAS CAIMÁN				JERSEY - ISLAS DEL CANAL					
USD	200.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	178.100	0,65	USD	253.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	196.185	0,72
Total de Islas Caimán			178.100	0,65	USD	267.729	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.94% 30/09/2040	204.662	0,76
Total de Jersey - Islas del Canal					400.847			1,48	
COLOMBIA				KAZAJISTÁN					
USD	391.000	Ecopetrol SA 6.88% 29/04/2030	330.150	1,21	USD	200.000	Kazmunaygas National Company Jsc 4.75% 19/04/2027	168.000	0,62
Total de Colombia			330.150	1,21	USD	600.000	KazMunayGas National Company JSC 5.38% 24/04/2030	477.605	1,76
Total de Kazajistán					645.605			2,38	
HONG KONG				LUXEMBURGO					
USD	200.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	197.879	0,73	USD	180.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	153.000	0,56
USD	274.000	Lenovo Group Limited 6.54% 27/07/2032	255.506	0,93	Total de Luxemburgo			153.000	0,56
USD	210.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	147.089	0,54					
Total de Hong Kong			600.474	2,20					
INDIA				MALASIA					
USD	200.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	151.712	0,56	USD	200.000	Petronas Capital Limited 3.50% 21/04/2030	181.169	0,67
USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	175.073	0,64	Total de Malasia			181.169	0,67
Total de India			326.785	1,20					
INDONESIA				MÉXICO					
USD	450.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.45% 15/05/2030	398.985	1,46	USD	450.000	Comision Federal de Electricidad 3.88% 26/07/2033	315.575	1,16
					USD	300.000	Petroleos Mexicanos 5.95% 28/01/2031	202.110	0,74

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)					
MÉXICO (continuación)				EMIRATOS ÁRABES UNIDOS (continuación)					
USD	200.000	Petroleos Mexicanos 6.38% 23/01/2045	111.278	0,41	USD	500.000	DP World Limited 6.85% 02/07/2037	507.565	1,86
USD	1.300.000	Petroleos Mexicanos 6.70% 16/02/2032	916.857	3,38	Total de Emiratos Árabes Unidos				
USD	200.000	Petroleos Mexicanos 7.69% 23/01/2050	122.892	0,45			669.513	2,45	
Total de México									
			1.668.712	6,14	REINO UNIDO				
PAÍSES BAJOS				ESTADOS UNIDOS					
USD	250.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	197.433	0,73	USD	204.000	Gazprom PJSC Via Gaz Finance plc 3.25% 25/02/2030	96.288	0,35
Total de Países Bajos					USD	230.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	149.586	0,55
			197.433	0,73	Total de Reino Unido				
FILIPINAS								245.874	0,90
USD	250.000	Smc Global Power Holdings Corp. - Perp FRN	211.825	0,78	ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)				
Total de Filipinas					USD	220.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	207.328	0,76
			211.825	0,78	USD	689.000	Jgsh Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	629.057	2,31
CATAR					USD	200.000	State Grid Overseas Investment 2016 Limited 1.63% 05/08/2030	160.497	0,59
USD	356.000	Qatar Petroleum 2.25% 12/07/2031	285.859	1,05	USD	265.000	Studio City Finance Limited 5.00% 15/01/2029	123.599	0,45
Total de Catar					Total de Islas Vírgenes (Británicas)				
			285.859	1,05				1.120.481	4,11
ARABIA SAUDÍ					Total de bonos				
USD	200.000	Saudi Arabian Oil Company 2.25% 24/11/2030	162.226	0,60				9.454.040	34,72
Total de Arabia Saudí					Valores respaldados por hipotecas y activos				
			162.226	0,60	LUXEMBURGO				
SUDÁFRICA					USD	180.000	Millicom International Cellular SA 5.13% 15/01/2028	149.410	0,55
USD	200.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	177.868	0,65	Total de Luxemburgo				
Total de Sudáfrica								149.410	0,55
			177.868	0,65	Total de valores respaldados por hipotecas y activos				
								149.410	0,55
TURQUÍA					Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
USD	200.000	Turk Telekomunikasyon AS 6.88% 28/02/2025	176.506	0,64	ANGOLA				
Total de Turquía					USD	200.000	Angola (Govt of) 8.00% 26/11/2029	150.814	0,55
			176.506	0,64					
EMIRATOS ÁRABES UNIDOS									
USD	200.000	Abu Dhabi Ports Company Pjsc 2.50% 06/05/2031	161.948	0,59					

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)							
ANGOLA (continuación)				COLOMBIA (continuación)							
USD	200.000	Angola (Govt of) 9.38% 08/05/2048	135.594	0,50	USD	350.000	Colombia (Govt of) 3.13% 15/04/2031	244.038	0,90		
Total de Angola			286.408	1,05	USD	223.000	Colombia (Govt of) 3.25% 22/04/2032	151.493	0,56		
					Total de Colombia			971.914	3,57		
ARGENTINA				CROACIA							
USD	1.850.000	Argentina (Govt of) FRN 09/07/2035	340.984	1,25	USD	200.000	Croatia (Govt of) 6.00% 26/01/2024	201.244	0,74		
USD	90.000	Argentina (Govt of) 1.50% 09/07/2046	16.787	0,06	Total de Croacia			201.244	0,74		
Total de Argentina			357.771	1,31							
BARÉIN				REPÚBLICA DOMINICANA							
USD	300.000	Bahrain (Govt of) 5.63% 18/05/2034	235.847	0,87	USD	200.000	Dominican Republic (Govt of) 4.88% 23/09/2032	151.035	0,55		
USD	333.000	CBB International Sukuk Programme Company 3.88% 18/05/2029	293.801	1,08	USD	222.000	Dominican Republic (Govt of) 5.88% 30/01/2060	147.353	0,54		
Total de Baréin			529.648	1,95	USD	151.000	Dominican Republic (Govt of) 6.40% 05/06/2049	109.536	0,40		
				USD				106.000	Dominican Republic (Govt of) 7.45% 30/04/2044	89.573	0,33
					Total de República Dominicana			497.497	1,82		
BIELORRUSIA				ECUADOR							
USD	200.000	Belarus (Govt of) 0.00% 28/02/2030	48.000	0,18	USD	192.950	Ecuador (Govt of) 1.50% 31/07/2040	57.885	0,21		
Total de Bielorrusia			48.000	0,18	USD	344.160	Ecuador (Govt of) 2.50% 31/07/2035	114.215	0,43		
				USD				230.000	Ecuador (Govt of) 5.50% 31/07/2030	109.825	0,40
					Total de Ecuador			281.925	1,04		
BRASIL				EGIPTO							
USD	433.000	Brazil (Govt of) 3.88% 12/06/2030	359.179	1,32	EUR	180.000	Egypt (Govt of) 5.63% 16/04/2030	103.220	0,38		
USD	200.000	Brazil (Govt of) 5.00% 27/01/2045	146.459	0,54	EUR	200.000	Egypt (Govt of) 6.38% 11/04/2031	114.896	0,42		
Total de Brasil			505.638	1,86	USD	250.000	Egypt (Govt of) 7.30% 30/09/2033	144.416	0,53		
				USD				250.000	Egypt (Govt of) 7.63% 29/05/2032	150.640	0,55
				USD				300.000	Egypt (Govt of) 7.90% 21/02/2048	157.600	0,58
					Total de Egipto			670.772	2,46		
CHILE				GHANA							
USD	200.000	Chile (Govt of) 3.50% 25/01/2050	136.106	0,50	USD	364.000	Ghana (Govt of) 8.88% 07/05/2042	136.108	0,50		
Total de Chile			136.106	0,50	Total de Ghana			136.108	0,50		
CHINA											
USD	200.000	China (Govt of) 1.95% 03/12/2024	190.657	0,70							
Total de China			190.657	0,70							
COLOMBIA											
USD	800.000	Colombia (Govt of) 3.00% 30/01/2030	576.383	2,11							

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)					
GUATEMALA				OMÁN					
USD	250.000	Guatemala (Govt of) 6.13% 01/06/2050	205.521	0,75	USD	200.000	Oman (Govt of) 6.25% 25/01/2031	187.101	0,69
		Total de Guatemala	205.521	0,75	USD	220.000	Oman (Govt of) 6.75% 17/01/2048	177.620	0,65
				Total de Omán					
				364.721					
				1,34					
HUNGRÍA				PAKISTÁN					
USD	200.000	Hungary (Govt of) 3.13% 21/09/2051	107.567	0,40	USD	200.000	Pakistan (Govt of) 6.88% 05/12/2027	76.929	0,28
		Total de Hungría	107.567	0,40	Total de Pakistán				
				76.929					
				0,28					
INDIA				PANAMÁ					
USD	400.000	Export-Import Bank of India 3.25% 15/01/2030	334.432	1,23	USD	200.000	Panama (Govt of) 2.25% 29/09/2032	141.396	0,52
		Total de India	334.432	1,23	USD	302.000	Panama (Govt of) 3.30% 19/01/2033	234.082	0,86
				Total de Panamá					
				507.425					
				1,86					
INDONESIA				PARAGUAY					
USD	400.000	Indonesia (Govt of) 3.70% 30/10/2049	289.898	1,06	USD	340.000	Paraguay (Govt of) 5.60% 13/03/2048	257.294	0,94
USD	200.000	Indonesia (Govt of) 4.30% 31/03/2052	154.231	0,57	USD	200.000	Paraguay (Govt of) 6.10% 11/08/2044	167.053	0,61
USD	350.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 18/07/2047	294.343	1,08	Total de Paraguay				
IDR	5.360.000.000	Indonesia (Govt of) 6.38% 15/04/2032	330.028	1,21	424.347				
USD	200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 2.30% 23/06/2025	187.299	0,69	1,55				
		Total de Indonesia	1.255.799	4,61					
COSTA DE MARFIL				PERÚ					
EUR	477.000	Ivory Coast (Govt of) 5.88% 17/10/2031	339.659	1,25	USD	132.000	Peru (Govt of) 3.00% 15/01/2034	99.674	0,37
		Total de Costa de Marfil	339.659	1,25	Total de Perú				
				99.674					
				0,37					
MÉXICO				FILIPINAS					
USD	650.000	Mexico (Govt of) 3.25% 16/04/2030	544.089	1,99	USD	339.000	Philippine (Govt of) 3.20% 06/07/2046	226.024	0,83
USD	300.000	Mexico (Govt of) 4.60% 10/02/2048	219.609	0,81	Total de Filipinas				
MXN	85.000	Mexico (Govt of) 8.50% 31/05/2029	398.776	1,46	226.024				
		Total de México	1.162.474	4,26	0,83				
				CATAR					
USD	450.000	Qatar (Govt of) 3.75% 16/04/2030	423.650	1,56	USD	500.000	Qatar (Govt of) 4.00% 14/03/2029	477.783	1,75
USD	500.000	Qatar (Govt of) 4.00% 14/03/2029	477.783	1,75	USD	200.000	Qatar (Govt of) 4.82% 14/03/2049	184.757	0,68
USD	200.000	Qatar (Govt of) 4.82% 14/03/2049	184.757	0,68	USD	200.000	Qatar (Govt of) 5.10% 23/04/2048	192.656	0,71
USD	200.000	Qatar (Govt of) 5.10% 23/04/2048	192.656	0,71	Total de Catar				
		Total de México	1.162.474	4,26	1.278.846				
				4,70					

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)				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Bonos					
RUMANÍA				LUXEMBURGO					
USD	252.000	Romania (Govt of) 3.00% 27/02/2027	213.115	0,78	USD	210.000	Hidroviias International Finance Sarl 4.95% 08/02/2031	162.409	0,60
USD	300.000	Romania (Govt of) 4.00% 14/02/2051	169.845	0,62	Total de Luxemburgo				
USD	246.000	Romania (Govt of) 5.25% 25/11/2027	223.487	0,82	162.409 0,60				
Total de Rumanía				606.447 2,22					
ARABIA SAUDÍ				VENEZUELA					
USD	300.000	Saudi (Govt of) 3.45% 02/02/2061	202.963	0,75	USD	1.999.683	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026	52.992	0,19
USD	500.000	Saudi (Govt of) 3.75% 21/01/2055	365.368	1,34	Total de Venezuela				
USD	285.000	Saudi (Govt) 4.50% 26/10/2046	240.015	0,88	52.992 0,19				
Total de Arabia Saudí				808.346 2,97					
SUDÁFRICA				Total de bonos					
USD	500.000	South Africa (Govt of) 5.75% 30/09/2049	321.854	1,18	215.401 0,79				
USD	212.000	South Africa (Govt of) 7.30% 20/04/2052	162.118	0,60	Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
Total de Sudáfrica				483.972 1,78					
TURQUÍA				VENEZUELA					
USD	430.000	Turkey (Govt of) 5.13% 17/02/2028	335.449	1,23	USD	2.004.400	Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024	160.352	0,59
USD	425.000	Turkey (Govt of) 6.00% 25/03/2027	358.508	1,32	Total de Venezuela				
USD	250.000	Turkey (Govt of) 6.88% 17/03/2036	181.924	0,67	160.352 0,59				
Total de Turquía				875.881 3,22					
UCRANIA				Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					
USD	518.000	Ukraine (Govt of) 0.00% 21/05/2031	97.114	0,36	160.352 0,59				
USD	560.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2026	118.005	0,43	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				
Total de Ucrania				375.753 1,38					
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				14.186.871 52,09					
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				23.790.321 87,36					
14.186.871 52,09				25.732.663 94,49					
23.790.321 87,36				25.732.663 94,49					
23.790.321 87,36				(Coste total: 35.595.574 USD)					

*Diferencias menores debido al redondeo.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

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

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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	285.714	China Oil & Gas Group Limited 5.50% 25/01/2023	279.998	0,44	USD	600.000	JSW Steel Limited 5.95% 18/04/2024	580.395	0,90
		Total de Bermudas	279.998	0,44	USD	700.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	530.283	0,83
BRASIL				Total de India					
USD	1.200.000	Light Servicos de Eletricidade SA 4.38% 18/06/2026	999.000	1,55				2.175.805	3,39
		Total de Brasil	999.000	1,55	INDONESIA				
CANADÁ				USD 1.600.000 Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 4.75% 15/05/2025				1.555.295	2,41
USD	1.650.000	MEGlobal Canada ULCDL 5.00% 18/05/2025	1.607.125	2,51	USD	700.000	Pertamina Persero PT 1.40% 09/02/2026	601.638	0,94
		Total de Canadá	1.607.125	2,51	USD	464.000	Saka Energi Indonesia Pt 4.45% 05/05/2024	428.509	0,67
ISLAS CAIMÁN				USD 1.200.000 Sri Rejeki Isman TBK PT 7.25% 16/01/2025				84.000	0,13
USD	600.000	Cifi Holdings Group Company Limited 6.00% 16/07/2025	135.000	0,21	Total de Indonesia				
USD	700.000	Country Garden Holdings Company Limited 3.13% 22/10/2025	227.885	0,35				2.669.442	4,15
USD	1.500.000	DP World Salaam - Perp FRN	1.462.725	2,28	IRLANDA				
USD	820.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	730.210	1,14	USD	400.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	213.450	0,33
USD	1.300.000	SA Global Sukuk Limited 1.60% 17/06/2026	1.154.506	1,80	USD	300.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 3.05% 23/01/2025	156.000	0,24
		Total de Islas Caimán	3.710.326	5,78	Total de Irlanda				
COLOMBIA								369.450	0,57
USD	500.000	Ecopetrol SA 5.88% 18/09/2023	496.788	0,77	JERSEY - ISLAS DEL CANAL				
		Total de Colombia	496.788	0,77	USD	1.248.828	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 1.75% 30/09/2027	1.140.336	1,77
HONG KONG				KAZAJISTÁN					
USD	380.000	Lenovo Group Limited 5.83% 27/01/2028	363.641	0,57	USD	1.500.000	KazMunayGas National Company JSC 4.75% 24/04/2025	1.384.125	2,15
USD	500.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	494.698	0,77	Total de Kazajistán				
		Total de Hong Kong	858.339	1,34				1.384.125	2,15
INDIA				LUXEMBURGO					
USD	700.000	Adani Green Energy Limited 4.38% 08/09/2024	582.750	0,91	USD	500.000	Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA 5.15% 11/02/2026	272.500	0,42
USD	500.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 5.38% 10/04/2024	482.377	0,75	USD	1.145.000	Millicom International Cellular SA 4.50% 27/04/2031	820.106	1,28
					USD	360.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	306.000	0,48
					Total de Luxemburgo				
								1.398.606	2,18

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				SUDÁFRICA					
USD	1.000.000	HTA Group Limited 7.00% 18/12/2025	875.600	1,36	USD	1.000.000	Eskom Holdings 6.75% 06/08/2023	949.887	1,47
		Total de Mauricio	875.600	1,36	USD	300.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	266.801	0,42
				Total de Sudáfrica					
				1.216.688					
				1,89					
MÉXICO				TURQUÍA					
USD	500.000	Cemex SAB de CV 5.20% 17/09/2030	434.872	0,68	USD	1.200.000	Turk Telekomunikasyon AS 6.88% 28/02/2025	1.059.037	1,65
USD	650.000	Cemex SAB de CV 7.38% 05/06/2027	648.249	1,01	Total de Turquía				
USD	1.200.000	Petroleos Mexicanos 4.25% 15/01/2025	1.106.700	1,72	1.059.037				
USD	800.000	Petroleos Mexicanos 6.49% 23/01/2027	669.980	1,04	1,65				
USD	800.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 16/10/2025	752.085	1,17	REINO UNIDO				
USD	2.600.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 04/08/2026	2.342.849	3,64	USD	860.000	Endeavour Mining plc 5.00% 14/10/2026	685.171	1,07
Total de México				5.954.735					
				9,26					
				1,07					
				0,07					
				0,61					
				Total de Reino Unido					
				1.118.950					
				1,75					
PAÍSES BAJOS				ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)					
USD	897.700	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	728.141	1,13	USD	1.000.000	Central American Bottling Corp. 5.25% 27/04/2029	863.125	1,34
USD	500.000	Metinvest BV 8.50% 23/04/2026	234.475	0,37	USD	400.000	Elect Global Investments Limited - Perp FRN	337.620	0,53
USD	1.000.000	Syngenta Finance NV 4.44% 24/04/2023	994.431	1,55	USD	1.000.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	973.264	1,51
Total de Países Bajos				1.957.047					
				3,05					
				0,99					
				1,51					
				0,99					
				0,96					
PERÚ				Total de Islas Vírgenes (Británicas)					
USD	1.000.000	Auna SA 6.50% 20/11/2025	806.347	1,26	3.424.244				
Total de Perú				806.347					
				1,26					
				5,33					
FILIPINAS				Total de bonos					
USD	693.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	633.395	0,99	34.910.384				
Total de Filipinas				633.395					
				0,99					
				54,35					
ARABIA SAUDÍ				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					
USD	350.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	339.063	0,53	ANGOLA				
USD	450.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	435.938	0,68	USD	1.050.000	Angola (Govt of) 9.50% 12/11/2025	985.779	1,53
Total de Arabia Saudí				775.001					
				1,21					
				Total de Angola					
				985.779					
				1,53					
				BRASIL					
USD	2.000.000	Brazil (Govt of) 2.88% 06/06/2025	1.880.273	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)					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					
BRASIL (continuación)				OMÁN (continuación)					
USD	400.000	Brazil (Govt of) 4.25% 07/01/2025	391.900	0,61	USD	1.700.000	Oman (Govt of) 4.75% 15/06/2026	1.588.896	2,47
Total de Brasil			2.272.173	3,54	Total de Omán			2.571.398	4,00
COLOMBIA				PAKISTÁN					
USD	1.300.000	Colombia (Govt of) 4.00% 26/02/2024	1.271.508	1,98	USD	500.000	Pakistan (Govt of) 6.00% 08/04/2026	196.598	0,31
Total de Colombia			1.271.508	1,98	USD	200.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 30/09/2025	80.769	0,13
Total de Pakistán						277.367	0,44		
COSTA RICA				PANAMÁ					
USD	300.000	Costa Rica (Govt of) 4.38% 30/04/2025	290.199	0,45	USD	1.350.000	Panama (Govt of) 3.75% 16/03/2025	1.305.057	2,03
Total de Costa Rica			290.199	0,45	Total de Panamá			1.305.057	2,03
REPÚBLICA DOMINICANA				CATAR					
USD	1.000.000	Dominican Republic (Govt of) 5.50% 27/01/2025	975.275	1,52	USD	2.700.000	Qatar (Govt of) 3.25% 02/06/2026	2.567.792	4,00
USD	1.000.000	Dominican Republic (Govt of) 6.85% 29/01/2026	979.013	1,52	Total de Catar			2.567.792	4,00
Total de República Dominicana			1.954.288	3,04					
EGIPTO				RUMANÍA					
USD	700.000	Egypt (Govt of) 3.88% 16/02/2026	508.629	0,79	USD	646.000	Romania (Govt of) 3.00% 27/02/2027	546.318	0,85
USD	400.000	Egypt (Govt of) 5.25% 06/10/2025	313.262	0,49	Total de Rumanía			546.318	0,85
USD	1.300.000	Egypt (Govt of) 5.88% 11/06/2025	1.028.788	1,60					
Total de Egipto			1.850.679	2,88	SUDÁFRICA				
GHANA				SRI LANKA					
USD	700.000	Ghana (Govt of) 6.38% 11/02/2027	283.267	0,44	USD	860.000	Sri Lanka (Govt of) 5.75% 18/04/2023	222.283	0,35
Total de Ghana			283.267	0,44	Total de Sri Lanka			222.283	0,35
NIGERIA				TURQUÍA					
USD	550.000	Nigeria (Govt of) 7.63% 21/11/2025	478.211	0,74	USD	1.200.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama As 7.25% 24/02/2027	1.157.958	1,80
Total de Nigeria			478.211	0,74	USD	900.000	Turkey (Govt of) 4.75% 26/01/2026	767.149	1,19
OMÁN									
USD	1.000.000	Oman (Govt of) 4.40% 01/06/2024	982.502	1,53					

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)				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Fondos				
TURQUÍA (continuación)				IRLANDA				
USD	1.100.000	Turkey (Govt of) 4.88% 09/10/2026	905.677	1,41	2.009.528	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.009.528	3,13
USD	1.300.000	Turkey (Govt of) 5.60% 14/11/2024	1.222.494	1,90	Total de Irlanda			
USD	400.000	Turkey (Govt of) 7.38% 05/02/2025	383.600	0,60	2.009.528 3,13			
Total de Turquía			4.436.878	6,90	Total de fondos			
UCRANIA			2.009.528 3,13					
USD	2.534.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2026	533.971	0,83	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Total de Ucrania			533.971	0,83	2.009.528 3,13			
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			22.417.451	34,89	Valor total de las inversiones			
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			57.327.835	89,24	59.537.179 92,69			
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				(Coste total: 73.016.227 USD)				
Bonos				<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>				
VENEZUELA								
USD	3.288.783	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 16/05/2024	87.153	0,14				
USD	491.751	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026	13.031	0,02				
Total de Venezuela			100.184	0,16				
Total de bonos			100.184	0,16				
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda								
VENEZUELA								
USD	1.245.400	Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024	99.632	0,16				
Total de Venezuela			99.632	0,16				
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			99.632	0,16				
Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			199.816	0,32				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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				POLONIA						
USD	437.000	Bombardier Inc. 7.88% 15/04/2027	401.395	0,27	USD	350.000	Canpack SA 3.88% 15/11/2029	275.141	0,19	
USD	316.000	Nova Chemicals Corp. 4.25% 15/05/2029	247.273	0,17	Total de Polonia					
Total de Canadá				648.668	0,44	275.141				
FRANCIA				ESPAÑA						
USD	504.000	Altice France SA 5.13% 15/07/2029	378.082	0,26	USD	147.000	Grifols Escrow Issuer SA 4.75% 15/10/2028	114.088	0,08	
USD	311.000	Altice France SA 5.50% 15/01/2028	247.053	0,17	Total de España					
USD	303.000	Altice France SA 8.13% 01/02/2027	271.185	0,18	114.088					
Total de Francia				896.320	0,61	0,08				
ALEMANIA				REINO UNIDO						
USD	384.000	Iho Verwaltungs GmbH 6.38% 15/05/2029	331.680	0,22	USD	308.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 3.38% 15/01/2026	257.487	0,17	
USD	261.000	IHO Verwaltungs GmbH 4.75% 15/09/2026	222.916	0,15	USD	237.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.50% 15/05/2029	203.228	0,14	
Total de Alemania				554.596	0,37	Total de Reino Unido				
LIBERIA				ESTADOS UNIDOS						
USD	515.000	Royal Caribbean Cruises Limited 3.70% 15/03/2028	335.394	0,23	USD	191.000	American Axle & Manufacturing Inc. 6.50% 01/04/2027	162.543	0,11	
USD	402.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.50% 01/04/2028	283.159	0,19	USD	549.000	Apache Corp. 4.75% 15/04/2043	411.750	0,28	
Total de Liberia				618.553	0,42	USD	275.000	Apache Corp. 5.25% 01/02/2042	226.899	0,15
LUXEMBURGO				PAÍSES BAJOS						
USD	486.000	Herens Holdco Sarl 4.75% 15/05/2028	396.799	0,27	USD	427.000	Trivium Packaging Finance BV 5.50% 15/08/2026	385.400	0,26	
Total de Luxemburgo				396.799	0,27	USD	88.000	Trivium Packaging Finance BV 8.50% 15/08/2027	78.320	0,05
USD	178.000	Ziggo Bond Company BV 5.13% 28/02/2030	127.493	0,09	USD	159.000	Firstenergy Corp. 5.60% 15/07/2047	134.745	0,09	
USD	171.000	Ziggo Bond Company BV 6.00% 15/01/2027	144.485	0,10	USD	140.000	FirstEnergy Corp. 7.38% 15/11/2031	153.929	0,10	
USD	738.000	Ziggo BV 4.88% 15/01/2030	586.629	0,40	USD	328.000	Ford Motor Company 3.25% 12/02/2032	236.706	0,16	
Total de Países Bajos				1.322.327	0,90	Total de Estados Unidos				

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	622.000 Ford Motor Credit Company 4.39% 08/01/2026	565.091	0,38	USD	189.000 OneMain Finance Corp. 6.88% 15/03/2025	178.104	0,12
USD	380.000 Ford Motor Credit Company 5.13% 16/06/2025	359.047	0,24	USD	220.000 PG&E Corp. 5.00% 01/07/2028	191.038	0,13
USD	385.000 Ford Motor Credit Company LLC 2.70% 10/08/2026	320.037	0,22	USD	471.000 Primo Water Holdings Inc. 4.38% 30/04/2029	388.679	0,26
USD	257.000 Ford Motor Credit Company LLC 2.90% 16/02/2028	203.175	0,14	USD	310.000 Radian Group Inc. 4.88% 15/03/2027	275.449	0,19
USD	402.000 Ford Motor Credit Company LLC 3.38% 13/11/2025	355.485	0,24	USD	291.000 Radian Group Inc. 6.63% 15/03/2025	284.022	0,19
USD	771.000 Ford Motor Credit Company LLC 3.66% 08/09/2024	725.222	0,49	USD	174.000 SM Energy Company 6.75% 15/09/2026	167.235	0,11
USD	378.000 Ford Motor Credit Company LLC 4.00% 13/11/2030	294.695	0,20	USD	894.000 Southwestern Energy Company 4.75% 01/02/2032	751.707	0,51
USD	244.000 Ford Motor Credit Company LLC 4.95% 28/05/2027	218.287	0,15	USD	193.000 Southwestern Energy Company 5.95% 23/01/2025	188.822	0,13
USD	165.000 Ford Motor Credit Company LLC 5.11% 03/05/2029	144.015	0,10	USD	230.000 Spectrum Brands Inc. 5.75% 15/07/2025	218.669	0,15
USD	160.000 Goodyear Tire & Rubber Company 5.00% 15/07/2029	131.100	0,09	USD	182.000 Sprint Capital Corp. 8.75% 15/03/2032	211.166	0,14
USD	429.000 HB Fuller Company 4.25% 15/10/2028	361.497	0,24	USD	57.000 Tenet Healthcare Corp. 4.25% 01/06/2029	47.275	0,03
USD	254.000 Lumen Technologies Inc 7.50% 01/04/2024	264.016	0,18	USD	422.000 Transdigm Inc. 6.38% 15/06/2026	398.790	0,27
USD	300.000 Mgc Investment Corp. 5.25% 15/08/2028	268.202	0,18	USD	333.000 TransDigm Inc. 5.50% 15/11/2027	290.702	0,20
USD	391.000 Navient Corp. 6.75% 25/06/2025	366.656	0,25	USD	351.000 United Airlines Inc. 4.63% 15/04/2029	291.769	0,20
USD	156.000 NRG Energy Inc. 5.75% 15/01/2028	145.043	0,10	USD	75.000 United Rentals North America Inc. 5.50% 15/05/2027	72.450	0,05
USD	222.000 Nustar Logistics LP 5.75% 01/10/2025	205.882	0,14	USD	171.000 Western Midstream Operating LP 4.30% 01/02/2030	145.766	0,10
USD	151.000 NuStar Logistics LP 5.63% 28/04/2027	132.428	0,09	USD	331.000 Western Midstream Operating LP 4.65% 01/07/2026	309.324	0,21
USD	578.000 NuStar Logistics LP 6.00% 01/06/2026	531.038	0,36	USD	373.000 Yum! Brands Inc. 5.38% 01/04/2032	331.649	0,22
USD	646.000 Occidental Petroleum Corp. 6.13% 01/01/2031	637.925	0,43	Total de Estados Unidos		15.328.102	10,39
USD	156.000 Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	157.560	0,11	Total de bonos		20.615.309	13,98
USD	417.000 Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	421.170	0,29	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		20.615.309	13,98
USD	163.000 Occidental Petroleum Corp. 7.50% 01/05/2031	170.539	0,12				
USD	24.000 Onemain Finance Corp. 4.00% 15/09/2030	16.901	0,01				
USD	288.000 OneMain Finance Corp. 5.63% 15/03/2023	287.799	0,20				
USD	216.000 OneMain Finance Corp. 6.13% 15/03/2024	208.388	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				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
CANADÁ				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	80.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc. 5.75% 15/04/2025	79.352	0,05	USD	523.000	Cheniere Energy Partners LP 3.25% 31/01/2032	401.991	0,27
USD	164.000	Bausch Health Cos Inc. 6.13% 01/02/2027	113.947	0,08	USD	247.000	Cheniere Energy Partners LP 4.00% 01/03/2031	207.480	0,14
Total de Canadá		193.299	0,13	USD	169.000	Cheniere Energy Partners LP 4.50% 01/10/2029	149.354	0,10	
FRANCIA				USD	230.000	Cinemark USA Inc. 5.88% 15/03/2026	193.988	0,13	
USD	484.000	Altice France SA 5.50% 15/10/2029	367.649	0,25	USD	75.000	Cnx Resources Corp. 7.38% 15/01/2031	73.660	0,05
Total de Francia		367.649	0,25	USD	658.000	Crownrock LP 5.63% 15/10/2025	630.361	0,43	
LUXEMBURGO				USD	145.000	Darling Ingredients Inc. 6.00% 15/06/2030	138.475	0,09	
USD	284.000	Altice France Holding SA 6.00% 15/02/2028	183.665	0,12	USD	189.000	Delek Logistics Partners LP 6.75% 15/05/2025	179.635	0,12
Total de Luxemburgo		183.665	0,12	USD	317.000	DISH DBS Corp. 5.13% 01/06/2029	186.634	0,13	
PAÍSES BAJOS				USD	332.000	DISH DBS Corp. 7.75% 01/07/2026	255.018	0,17	
USD	266.000	Sensata Technologies Bv 5.88% 01/09/2030	249.551	0,17	USD	348.000	DT Midstream Inc. 4.38% 15/06/2031	287.655	0,19
Total de Países Bajos		249.551	0,17	USD	118.000	EQM Midstream Partner LP 7.50% 01/06/2027	112.710	0,08	
SUPRANACIONAL				USD	141.000	EQM Midstream Partner LP 7.50% 01/06/2030	133.874	0,09	
USD	456.000	Ardagh Metal Packaging Finance LLC 6.00% 15/06/2027	432.634	0,29	USD	79.000	Frontier Communications Holdings LLC 5.00% 01/05/2028	67.850	0,05
Total de supranacional		432.634	0,29	USD	152.000	Hanesbrands Inc. 4.63% 15/05/2024	145.258	0,10	
ESTADOS UNIDOS				USD	755.000	HP Inc. 4.75% 01/03/2029	759.815	0,52	
USD	291.000	Assuredpartners Inc. 7.00% 15/08/2025	272.058	0,18	USD	642.757	iHeartCommunications Inc. 8.38% 01/05/2027	541.523	0,37
USD	207.000	Boyd Gaming Corp. 4.75% 01/12/2027	183.705	0,12	USD	129.000	Lithia Motors Inc. 4.38% 15/01/2031	105.703	0,07
USD	1.015.000	Callon Petroleum Company 6.38% 01/07/2026	917.143	0,62	USD	418.000	Matador Resources Company 5.88% 15/09/2026	403.893	0,27
USD	60.000	CCO Holdings LLC 4.50% 15/08/2030	47.736	0,03	USD	854.496	Mileage Plus Holdings LLC 6.50% 20/06/2027	837.940	0,57
USD	188.000	CCO Holdings LLC 4.50% 01/05/2032	143.383	0,10	USD	67.000	Mozart Debt Merger Sub Inc. 3.88% 01/04/2029	53.759	0,04
USD	428.000	CCO Holdings LLC 4.75% 01/02/2032	333.656	0,23	USD	102.000	NCR Corp. 5.13% 15/04/2029	77.580	0,05
USD	272.000	Cedar Fair LP Canada's Wonderland Company 6.50% 01/10/2028	253.359	0,17	USD	119.000	Newell Brands Inc. 6.38% 15/09/2027	117.956	0,08
USD	221.000	Centene Corp. 3.38% 15/02/2030	181.248	0,12	USD	167.000	Newell Brands Inc. 6.63% 15/09/2029	163.472	0,11
USD	537.000	Cheniere Energy Inc. 4.63% 15/10/2028	492.942	0,33	USD	329.000	NFP Corp. 7.50% 01/10/2030	312.550	0,21
					USD	129.000	NRG Energy Inc. 5.25% 15/06/2029	113.748	0,08
					USD	85.000	Occidental Petroleum Corp. 6.20% 15/03/2040	82.522	0,06

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)				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				BERMUDAS (continuación)					
USD	695.000	Occidental Petroleum Corp. 6.45% 15/09/2036	691.959	0,47	USD	246.000	NCL Corp. Limited 5.88% 15/03/2026	189.420	0,13
USD	47.000	Occidental Petroleum Corp. 6.60% 15/03/2046	48.058	0,03	USD	74.000	NCL Corp. Limited 7.75% 15/02/2029	55.894	0,04
USD	167.000	Olympus Water USA 6.25% 01/10/2029	114.604	0,08	USD	126.000	NCL Finance Limited 6.13% 15/03/2028	91.980	0,06
USD	119.000	Picard Midco Inc. 6.50% 31/03/2029	101.448	0,07	Total de Bermudas				
USD	149.000	Pilgrim's Pride Corp. 5.88% 30/09/2027	144.996	0,10	495.975 0,34				
USD	153.000	Scotts Miracle-Gro 4.00% 01/04/2031	108.095	0,08	CANADÁ				
USD	206.000	Southwestern Energy Company 5.38% 01/02/2029	187.600	0,13	USD	570.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc. 3.88% 15/01/2028	497.088	0,35
USD	199.000	Spectrum Brands Inc. 5.00% 01/10/2029	158.746	0,11	USD	286.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc. 4.00% 15/10/2030	225.425	0,15
USD	442.000	Sunoco LP Sunoco Finance Corp. 5.88% 15/03/2028	404.772	0,27	USD	164.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc. 4.38% 15/01/2028	141.988	0,10
USD	320.000	Taylor Morrison Communities Inc. 5.75% 15/01/2028	281.330	0,19	USD	425.000	Air Canada 3.88% 15/08/2026	365.500	0,25
USD	107.000	Tempur Sealy International 3.88% 15/10/2031	78.511	0,05	USD	161.000	Bausch Health Cos Inc. 4.88% 01/06/2028	103.998	0,07
USD	203.000	Tenet Healthcare Corp. 4.38% 15/01/2030	168.871	0,11	USD	395.000	Bausch Health Cos Inc. 5.25% 30/01/2030	148.619	0,10
USD	233.000	Tenet Healthcare Corp. 6.13% 15/06/2030	214.360	0,15	USD	376.000	Bausch Health Cos Inc. 5.50% 01/11/2025	298.920	0,20
USD	619.000	Transmontaigne Partners LP 6.13% 15/02/2026	524.603	0,36	USD	166.000	Clarios Global LP 6.75% 15/05/2025	162.936	0,11
USD	307.000	Univision Communications Inc. 7.38% 30/06/2030	292.751	0,20	USD	390.000	GFL Environmental Inc. 3.75% 01/08/2025	361.555	0,24
USD	317.000	USA Compression Partners LP 6.88% 01/04/2026	292.036	0,20	USD	127.000	GFL Environmental Inc. 4.25% 01/06/2025	119.314	0,08
USD	209.000	USI Inc. 6.88% 01/05/2025	201.658	0,14	USD	150.000	GFL Environmental Inc. 5.13% 15/12/2026	140.250	0,10
Total de Estados Unidos			13.574.032	9,21	USD	918.000	Hudbay Minerals Inc. 4.50% 01/04/2026	764.353	0,53
Total de bonos			15.000.830	10,17	USD	346.000	Hudbay Minerals Inc. 6.13% 01/04/2029	279.994	0,19
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente			15.000.830	10,17	USD	268.000	Nova Chemicals Corp. 5.25% 01/06/2027	229.272	0,16
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				Total de Canadá					
Bonos				4.870.583 3,33					
BERMUDAS				ISLAS CAIMÁN					
USD	182.000	Nabors Industries Limited 7.25% 15/01/2026	158.681	0,11	USD	601.627	Hawaiian Brand Intellectual Property Limited 5.75% 20/01/2026	532.064	0,36

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*			
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)						
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)						
ISLAS CAIMÁN (continuación)				LUXEMBURGO (continuación)						
USD	458.123	Transocean Sentry Limited 5.38% 15/05/2023	442.389	0,30	USD	331.000	Fage International 5.63% 15/08/2026	292.733	0,20	
		Total de Islas Caimán	974.453	0,66	USD	440.000	Ion Trading Technologies Sarl 5.75% 15/05/2028	358.325	0,24	
						Total de Luxemburgo	1.716.860	1,16		
FRANCIA				PAÍSES BAJOS						
USD	702.000	Constellium SE 3.75% 15/04/2029	512.991	0,35	USD	187.000	Clear Channel International BV 6.63% 01/08/2025	174.144	0,12	
USD	578.000	Constellium SE 5.63% 15/06/2028	481.569	0,33	USD	193.000	Constellium NV 5.88% 15/02/2026	177.319	0,12	
USD	600.000	Iliad Holdings SAS 6.50% 15/10/2026	524.251	0,36	USD	798.000	VZ Secured Financing BV 5.00% 15/01/2032	610.470	0,41	
USD	679.000	Iliad Holdings SAS 7.00% 15/10/2028	581.819	0,39			Total de Países Bajos	961.933	0,65	
		Total de Francia	2.100.630	1,43						
ALEMANIA				PANAMÁ						
USD	363.000	TK Elevator Holdco GmbH 7.63% 15/07/2028	304.920	0,21	USD	649.000	Carnival Corp. 4.00% 01/08/2028	524.067	0,36	
		Total de Alemania	304.920	0,21	USD	760.000	Carnival Corp. 5.75% 01/03/2027	531.999	0,35	
					USD	740.000	Carnival Corp. 6.00% 01/05/2029	503.200	0,34	
						Total de Panamá	1.559.266	1,05		
IRLANDA				SUPRANACIONAL						
USD	504.000	James Hardie International Finance Dac 5.00% 15/01/2028	456.435	0,31	USD	50.000	Ardagh Metal Packaging Finance plc 5.25% 30/04/2025	47.029	0,03	
		Total de Irlanda	456.435	0,31	USD	207.000	Clarios Global LP 6.25% 15/05/2026	197.814	0,13	
					USD	501.000	Clarios Global LP 8.50% 15/05/2027	479.041	0,33	
LIBERIA						Total de supranacional	723.884	0,49		
USD	306.000	Royal Caribbean Cruises Limited 4.25% 01/07/2026	226.884	0,15	REINO UNIDO					
USD	179.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.38% 15/07/2027	133.189	0,09	USD	215.000	International Game Technology plc 4.13% 15/04/2026	196.525	0,13	
USD	223.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.50% 31/08/2026	171.292	0,12	USD	392.000	International Game Technology plc P.P. 144A 6.50% 15/02/2025	392.000	0,27	
USD	186.000	Royal Caribbean Cruises Limited 9.13% 15/06/2023	189.321	0,13	USD	337.000	Virgin Media Finance plc 5.00% 15/07/2030	249.591	0,17	
USD	102.000	Royal Caribbean Cruises Limited 11.50% 01/06/2025	108.503	0,07	USD	282.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.50% 15/08/2030	221.974	0,15	
		Total de Liberia	829.189	0,56	USD	788.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.25% 31/01/2031	599.865	0,41	
LUXEMBURGO						USD	128.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.75% 15/07/2031	99.891	0,07
USD	327.000	Altice France Holding SA 10.50% 15/05/2027	257.024	0,17			Total de Reino Unido	1.759.846	1,20	
USD	424.000	Axalta Coating Systems LLC 4.75% 15/06/2027	379.096	0,26						
USD	477.000	Camelot Finance SA 4.50% 01/11/2026	429.682	0,29						

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*		
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	354.000	Acadia Healthcare Company Inc. 5.00% 15/04/2029	315.530	0,21	USD	174.000	ASP Unifrax Holdings Inc 5.25% 30/09/2028	134.198	0,09
USD	76.000	Acadia Healthcare Company Inc. 5.50% 01/07/2028	69.498	0,05	USD	405.000	Assuredpartners Inc. 5.63% 15/01/2029	317.925	0,22
USD	96.000	AdaptHealth LLC 4.63% 01/08/2029	77.580	0,05	USD	690.000	AthenaHealth Group Inc. 6.50% 15/02/2030	546.279	0,37
USD	720.000	AdaptHealth LLC 5.13% 01/03/2030	594.791	0,40	USD	539.000	Avantor Funding Inc. 3.88% 01/11/2029	440.633	0,30
USD	118.000	AG Issuer LLC 6.25% 01/03/2028	103.276	0,07	USD	229.000	Avantor Funding Inc. 4.63% 15/07/2028	204.444	0,14
USD	290.000	AG Ttmt Escrow Issuer LLC 8.63% 30/09/2027	274.246	0,19	USD	279.000	Avient Corp. 7.13% 01/08/2030	258.424	0,18
USD	578.000	Albertsons Companies Inc. 3.25% 15/03/2026	508.756	0,34	USD	180.000	Axalta Coating Systems LLC 3.38% 15/02/2029	141.016	0,10
USD	317.000	Albertsons Companies Inc. 5.88% 15/02/2028	293.027	0,20	USD	370.000	Bath & Body Works Inc. 6.63% 01/10/2030	322.594	0,22
USD	141.000	Albertsons Companies Inc. 7.50% 15/03/2026	142.763	0,10	USD	298.000	Beacon Roofing Supply Inc. 4.13% 15/05/2029	243.025	0,16
USD	353.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 4.25% 15/10/2027	304.693	0,21	USD	306.000	Beacon Roofing Supply Inc. 4.50% 15/11/2026	280.949	0,19
USD	268.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 5.88% 01/11/2029	219.892	0,15	USD	492.000	Black Knight Infoserv LLC 3.63% 01/09/2028	422.825	0,29
USD	692.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 6.75% 15/10/2027	601.487	0,41	USD	497.000	Blackstone Mortgage Trust Inc. 3.75% 15/01/2027	417.414	0,28
USD	1.141.121	American Airlines Inc. 5.50% 20/04/2026	1.074.079	0,73	USD	234.000	Boxer Parent Company Inc. 7.13% 02/10/2025	229.803	0,16
USD	481.110	American Airlines Inc. 5.75% 20/04/2029	420.370	0,28	USD	275.000	Boyd Gaming Corp. 4.75% 15/06/2031	223.355	0,16
USD	412.000	American Airlines Inc. 11.75% 15/07/2025	431.313	0,29	USD	674.000	BroadStreet Partners Inc. 5.88% 15/04/2029	535.156	0,36
USD	619.000	American Builders & Contractors Supply Company Inc. 4.00% 15/01/2028	547.040	0,36	USD	291.000	BWX Technologies Inc. 4.13% 30/06/2028	254.625	0,17
USD	121.000	APX Group Inc. 6.75% 15/02/2027	113.778	0,08	USD	756.000	Caesars Entertainment Inc. 4.63% 15/10/2029	583.873	0,40
USD	174.000	Aramark Services Inc. 5.00% 01/02/2028	155.199	0,11	USD	615.000	Caesars Entertainment Inc. 6.25% 01/07/2025	593.858	0,40
USD	87.000	Aramark Services Inc. 6.38% 01/05/2025	85.423	0,06	USD	486.000	Caesars Entertainment Inc. 8.13% 01/07/2027	464.997	0,32
USD	609.000	Arches Buyer Inc. 4.25% 01/06/2028	475.781	0,32	USD	419.000	Caesars Resort Collection LLC 5.75% 01/07/2025	404.859	0,27
USD	439.000	Arches Buyer Inc. 6.13% 01/12/2028	340.891	0,23	USD	150.000	Callon Petroleum Company 7.50% 15/06/2030	131.711	0,09
USD	257.000	Archrock Partners LP Archrock Partners Finance Corp. 6.25% 01/04/2028	226.222	0,15	USD	204.000	Catalent Pharma Solutions 3.13% 15/02/2029	160.523	0,11
USD	739.000	Ardagh Metal Packaging Finance LLC 4.00% 01/09/2029	543.318	0,37	USD	343.000	CCO Holdings LCC 5.13% 01/05/2027	309.986	0,21
USD	477.000	Asbury Automotive Group Inc 5.00% 15/02/2032	369.675	0,25	USD	983.000	CCO Holdings LLC 4.25% 01/02/2031	756.479	0,50
USD	165.000	Asbury Automotive Group Inc. 4.63% 15/11/2029	132.102	0,09	USD	862.000	CCO Holdings LLC 4.75% 01/03/2030	699.370	0,47
					USD	733.000	CCO Holdings LLC 5.00% 01/02/2028	638.627	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*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)			
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)			
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
USD	488.000 CD&R Smokey Buyer Inc. 6.75% 15/07/2025	448.009	0,30	USD	317.000 Cnx Resources Corp. 6.00% 15/01/2029	291.800	0,20
USD	244.000 Cedar Fair LP Canada's Wonderland Company 5.50% 01/05/2025	235.321	0,16	USD	41.000 Cnx Resources Corp. 7.25% 14/03/2027	40.018	0,03
USD	313.000 Cengage Learning Inc. 9.50% 15/06/2024	293.829	0,20	USD	498.000 Colgate Energy Partners III Llc 5.88% 01/07/2029	445.872	0,30
USD	171.000 Change Healthcare Holdings LLC 5.75% 01/03/2025	170.252	0,12	USD	198.000 CommScope Technologies LLC P.P. 144A 6.00% 15/06/2025	176.037	0,12
USD	159.000 Charles River Laboratories International Inc. 3.75% 15/03/2029	132.801	0,09	USD	212.000 Comstock Resources Inc. 6.75% 01/03/2029	196.876	0,13
USD	52.000 Charles River Laboratories International Inc. 4.00% 15/03/2031	42.551	0,03	USD	525.000 Condor Merger Sub Inc. 7.38% 15/02/2030	430.219	0,29
USD	161.000 Charles River Laboratories International Inc. 4.25% 01/05/2028	141.398	0,10	USD	274.000 CrownRock LP 5.00% 01/05/2029	244.148	0,17
USD	304.000 Cheever Escrow Issuer LLC 7.13% 01/10/2027	274.360	0,19	USD	304.000 CSC Holdings LLC 3.38% 15/02/2031	215.080	0,15
USD	806.000 CHS - Community Health Systems 5.25% 15/05/2030	561.354	0,38	USD	420.000 CSC Holdings LLC 4.13% 01/12/2030	317.436	0,22
USD	123.000 CHS - Community Health Systems 5.63% 15/03/2027	95.633	0,06	USD	319.000 CSC Holdings LLC 4.63% 01/12/2030	217.319	0,15
USD	275.000 CHS - Community Health Systems 6.88% 15/04/2029	136.415	0,09	USD	330.000 CSC Holdings LLC 5.00% 15/11/2031	216.274	0,15
USD	167.000 CHS - Community Health Systems 8.00% 15/03/2026	144.326	0,10	USD	207.000 CSC Holdings LLC 5.38% 01/02/2028	181.125	0,12
USD	247.000 Cinemark USA Inc. 5.25% 15/07/2028	190.036	0,13	USD	614.000 CSC Holdings LLC 6.50% 01/02/2029	543.467	0,37
USD	314.000 Cinemark USA Inc. 8.75% 01/05/2025	319.490	0,22	USD	633.000 DirectTV Holdings LLC 5.88% 15/08/2027	545.767	0,37
USD	372.000 Clarivate Science Holdings Corp. 3.88% 01/07/2028	307.570	0,21	USD	742.000 DISH DBS Corp. 5.75% 01/12/2028	563.326	0,38
USD	648.000 Clarivate Science Holdings Corp. 4.88% 01/07/2029	510.299	0,35	USD	377.000 DT Midstream Inc. 4.13% 15/06/2029	319.950	0,22
USD	386.000 Clear Channel Outdoor Holdings Inc. 7.50% 01/06/2029	281.298	0,19	USD	509.000 Element Solutions Inc. 3.88% 01/09/2028	410.483	0,28
USD	638.000 Clear Channel Worldwide Holdings Inc. 5.13% 15/08/2027	546.664	0,37	USD	330.000 Endeavor Energy Resources LP 5.75% 30/01/2028	314.282	0,21
USD	647.000 Clear Channel Worldwide Holdings Inc. 7.75% 15/04/2028	484.441	0,33	USD	578.000 Entegris Escrow Corp. 5.95% 15/06/2030	523.957	0,36
USD	465.000 Clearway Energy Operating LLC 3.75% 15/02/2031	370.478	0,25	USD	304.000 EQM Midstream Partner LP 4.50% 15/01/2029	247.367	0,17
USD	173.000 Clearway Energy Operating LLC 3.75% 15/01/2032	134.764	0,09	USD	900.000 EQM Midstream Partner LP 4.75% 15/01/2031	714.950	0,48
USD	319.000 Clearway Energy Operating LLC 4.75% 15/03/2028	286.013	0,19	USD	369.000 EQM Midstream Partner LP 6.00% 01/07/2025	342.958	0,23
USD	462.000 CNX Midstream Partners LP 4.75% 15/04/2030	362.670	0,25	USD	143.000 EQM Midstream Partner LP 6.50% 01/07/2027	133.128	0,09
				USD	319.000 Fair Isaac Corp. 4.00% 15/06/2028	274.641	0,19
				USD	358.000 Fertitta Entertainment LLC 6.75% 15/01/2030	272.528	0,18
				USD	345.000 Frontier Communications Holdings LLC 8.75% 15/05/2030	346.214	0,23

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*		
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	202.000	Gartner Inc. 3.63% 15/06/2029	168.491	0,11	USD	603.000	IQVIA Inc. 5.00% 15/05/2027	563.164	0,38
USD	345.000	Gartner Inc. 4.50% 01/07/2028	308.818	0,21	USD	344.000	Irb Holding Corp. 7.00% 15/06/2025	342.690	0,23
USD	546.000	Gates Global LLC 6.25% 15/01/2026	508.344	0,34	USD	219.000	Iris Holdings Inc. 8.75% 15/02/2026	194.249	0,13
USD	838.000	GoTo Group Inc. 5.50% 01/09/2027	520.817	0,35	USD	215.000	Iron Mountain Inc. 4.88% 15/09/2027	193.633	0,13
USD	376.000	Group 1 Automotive Inc. 4.00% 15/08/2028	303.710	0,21	USD	237.000	Iron Mountain Inc. 5.00% 15/07/2028	204.980	0,14
USD	82.000	GTCR AP Finance Inc. 8.00% 15/05/2027	75.989	0,05	USD	299.000	Iron Mountain Inc. 5.25% 15/03/2028	262.747	0,18
USD	649.000	H&E Equipment Services Inc. 3.88% 15/12/2028	515.728	0,35	USD	255.000	ITT Holdings LLC 6.50% 01/08/2029	198.263	0,13
USD	387.000	HealthEquity Inc. 4.50% 01/10/2029	327.640	0,22	USD	568.000	Kaiser Aluminum Corp. 4.50% 01/06/2031	418.617	0,28
USD	486.000	Helios Software Holdings Inc. 4.63% 01/05/2028	366.323	0,25	USD	161.000	Kaiser Aluminum Corp. 4.63% 01/03/2028	131.819	0,09
USD	381.000	Herc Holdings Inc. 5.50% 15/07/2027	343.615	0,23	USD	846.000	Kar Auction Services Inc. 5.13% 01/06/2025	817.447	0,55
USD	377.000	Hightower Holding LLC 6.75% 15/04/2029	309.611	0,21	USD	200.000	Ladder Capital Finance Holdings LLP 4.25% 01/02/2027	163.121	0,11
USD	373.000	Hilcorp Energy I LP 5.75% 01/02/2029	330.038	0,22	USD	926.000	Ladder Capital Finance Holdings LLP 4.75% 15/06/2029	694.198	0,48
USD	152.000	Hilcorp Energy I LP 6.00% 15/04/2030	133.971	0,09	USD	652.000	Ladder Capital Finance Holdings LLP 5.25% 01/10/2025	599.734	0,41
USD	197.000	Hilcorp Energy I LP 6.25% 01/11/2028	181.786	0,12	USD	238.000	Lamb Weston Holding Inc. 4.13% 31/01/2030	201.800	0,14
USD	237.000	Hilcorp Energy I LP 6.25% 15/04/2032	210.203	0,14	USD	178.000	Lamb Weston Holding Inc. 4.38% 31/01/2032	148.267	0,10
USD	113.000	Hilton Domestic Operating Company Inc. 5.38% 01/05/2025	110.832	0,08	USD	133.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC 4.25% 01/07/2029	107.231	0,07
USD	125.000	Hilton Domestic Operating Company Inc. 5.75% 01/05/2028	117.626	0,07	USD	174.000	Live Nation Entertainment Inc. 3.75% 15/01/2028	148.118	0,10
USD	372.000	Holly Energy Partners Corp. 5.00% 01/02/2028	328.755	0,22	USD	367.000	Live Nation Entertainment Inc. 4.75% 15/10/2027	322.043	0,22
USD	188.000	Holly Energy Partners LP 6.38% 15/04/2027	179.775	0,12	USD	474.000	Live Nation Entertainment Inc. 6.50% 15/05/2027	457.409	0,31
USD	480.000	HUB International Limited 5.63% 01/12/2029	401.400	0,27	USD	317.000	Madison IAQ LLC 4.13% 30/06/2028	257.436	0,17
USD	737.000	HUB International Limited 7.00% 01/05/2026	699.228	0,47	USD	597.000	Madison IAQ LLC 5.88% 30/06/2029	417.154	0,29
USD	538.000	IAA Inc. 5.50% 15/06/2027	491.598	0,33	USD	115.000	Match Group Holdings II LLC 3.63% 01/10/2031	87.041	0,06
USD	391.000	iHeartCommunications 4.75% 15/01/2028	327.251	0,22	USD	463.000	Match Group Holdings II LLC 4.63% 01/06/2028	405.125	0,27
USD	212.000	iHeartCommunications Inc. 5.25% 15/08/2027	181.728	0,12	USD	221.000	Mattel Inc. 5.88% 15/12/2027	212.392	0,14
USD	342.000	Illuminate Buyer LLC 9.00% 01/07/2028	285.857	0,19	USD	294.000	Mauser Packaging Solutions Holding Company 5.50% 15/04/2024	278.976	0,19
USD	359.000	Ingevity Corp. 3.88% 01/11/2028	296.854	0,20					
USD	446.000	Innophos Holdings Inc. 9.38% 15/02/2028	429.832	0,29					
USD	171.000	Interface Inc. 5.50% 01/12/2028	146.846	0,10					

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*
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)			
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)			
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
USD	245.000 Medline Borrower LP 5.25% 01/10/2029	185.281	0,12	USD	447.000 Pilgrim's Pride Corp. 3.50% 01/03/2032	338.830	0,23
USD	416.000 Meritage Homes Corp. 3.88% 15/04/2029	331.239	0,22	USD	90.000 Pilgrim's Pride Corp. 4.25% 15/04/2031	72.900	0,05
USD	214.000 Midwest Gaming Borrower LLC 4.88% 01/05/2029	176.213	0,12	USD	836.000 Post Holdings Inc. 4.63% 15/04/2030	687.609	0,46
USD	175.000 NCR Corp 5.75% 01/09/2027	159.830	0,11	USD	340.000 Post Holdings Inc. 5.75% 01/03/2027	325.426	0,22
USD	120.000 NCR Corp 6.13% 01/09/2029	105.108	0,07	USD	740.000 Provident Funding Associates LP 6.38% 15/06/2025	673.200	0,46
USD	759.000 NCR Corp. 5.00% 01/10/2028	600.094	0,41	USD	446.000 Radiate Holco LLC 4.50% 15/09/2026	367.671	0,25
USD	452.000 NextEra Energy Operating Partners 4.50% 15/09/2027	412.499	0,28	USD	714.000 Radiate Holco LLC 6.50% 15/09/2028	499.507	0,34
USD	153.000 NextEra Energy Operating Partners LP 4.25% 15/07/2024	147.747	0,10	USD	358.000 Resideo Funding Inc. 4.00% 01/09/2029	289.436	0,20
USD	488.000 NFP Corp. 4.88% 15/08/2028	415.844	0,28	USD	230.000 RLJ Lodging Trust LP 3.75% 01/07/2026	196.487	0,13
USD	1.038.000 NFP Corp. 6.88% 15/08/2028	810.288	0,56	USD	219.000 RLJ Lodging Trust LP 4.00% 15/09/2029	172.575	0,12
USD	268.000 Nielsen Finance LLC 4.50% 15/07/2029	268.905	0,18	USD	436.000 Roblox Corp. 3.88% 01/05/2030	355.120	0,24
USD	336.000 Nielsen Finance LLC 4.75% 15/07/2031	330.946	0,22	USD	330.000 Rocket Mortgage LLC 3.63% 01/03/2029	255.222	0,17
USD	327.000 Nielsen Finance LLC 5.88% 01/10/2030	327.701	0,22	USD	299.000 Rocket Mortgage LLC 3.88% 01/03/2031	219.702	0,15
USD	287.000 Novelis Corp. 3.25% 15/11/2026	241.798	0,16	USD	906.000 Rocket Mortgage LLC 4.00% 15/10/2033	626.961	0,42
USD	688.000 Novelis Corp. 4.75% 30/01/2030	566.863	0,38	USD	137.000 Sabre Gbl Inc. 9.25% 15/04/2025	131.336	0,09
USD	260.000 NRG Energy Inc. 3.38% 15/02/2029	210.600	0,14	USD	301.000 Sabre GBL Inc. 7.38% 01/09/2025	271.721	0,18
USD	460.000 NRG Energy Inc. 3.63% 15/02/2031	359.232	0,24	USD	679.000 Scientific Games Holdings LP 6.63% 01/03/2030	543.200	0,37
USD	484.000 Olympus Water USA 4.25% 01/10/2028	372.680	0,25	USD	164.000 Scientific Games International Inc. 7.00% 15/05/2028	154.759	0,10
USD	480.000 Organon & Company 4.13% 30/04/2028	411.000	0,28	USD	166.000 Scientific Games International Inc. 7.25% 15/11/2029	155.218	0,11
USD	585.000 Organon & Company 5.13% 30/04/2031	480.797	0,33	USD	847.000 Select Medical Corp. 6.25% 15/08/2026	797.149	0,54
USD	196.000 Outfront Media Capital LLC 4.25% 15/01/2029	154.448	0,10	USD	173.000 Shea Homes LP Shea Homes Funding Corp. 4.75% 15/02/2028	140.992	0,10
USD	398.000 Outfront Media Capital LLC 4.63% 15/03/2030	311.434	0,21	USD	362.000 Shift4 Payments LLC 4.63% 01/11/2026	329.464	0,22
USD	85.000 Owens & Minor Inc. 4.50% 31/03/2029	67.714	0,05	USD	235.000 Simmons Food Inc. 4.63% 01/03/2029	192.553	0,13
USD	309.000 Owens & Minor Inc. 6.63% 01/04/2030	272.693	0,18	USD	259.000 Sirius XM Radio Inc. 4.00% 15/07/2028	220.199	0,15
USD	273.000 Park Intermediate Holdings LLC 4.88% 15/05/2029	221.642	0,15	USD	174.000 Sirius XM Radio Inc. 5.50% 01/07/2029	157.095	0,11
USD	395.000 Park Intermediate Holdings LLC 5.88% 01/10/2028	345.625	0,23	USD	400.000 Six Flags Entertainment Corp. 4.88% 31/07/2024	381.500	0,26
USD	77.000 Park Intermediate Holdings LLC 7.50% 01/06/2025	76.478	0,05				
USD	474.000 PetSmart Inc. 4.75% 15/02/2028	408.220	0,28				
USD	408.000 PetSmart Inc. 7.75% 15/02/2029	364.672	0,25				

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*		
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	136.000	Six Flags Theme Parks Inc. 7.00% 01/07/2025	136.990	0,09	USD	162.000	US Foods Inc. 4.63% 01/06/2030	135.675	0,09
USD	24.000	Spectrum Brands Inc. 5.50% 15/07/2030	18.914	0,01	USD	498.000	US Foods Inc. 4.75% 15/02/2029	426.599	0,28
USD	238.000	SRS Distribution Inc. 4.63% 01/07/2028	204.980	0,14	USD	220.000	US Foods Inc. 6.25% 15/04/2025	217.216	0,15
USD	433.000	SRS Distribution Inc. 6.00% 01/12/2029	345.328	0,23	USD	481.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC 3.88% 15/08/2029	407.046	0,28
USD	520.000	SRS Distribution Inc. 6.13% 01/07/2029	420.016	0,27	USD	440.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC 3.88% 01/11/2033	349.160	0,24
USD	234.000	Staples Inc. 7.50% 15/04/2026	196.707	0,13	USD	833.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC 4.13% 15/08/2031	691.469	0,47
USD	235.000	Stevens Holding Company Inc. 6.13% 01/10/2026	230.106	0,16	USD	452.000	Verscend Escrow Corp. 9.75% 15/08/2026	437.273	0,31
USD	418.000	Surgery Center Holdings Inc. 6.75% 01/07/2025	389.263	0,26	USD	485.000	Vici Properties LP 4.63% 15/06/2025	457.219	0,31
USD	240.000	Taylor Morrison Communities Inc. 5.88% 15/06/2027	223.950	0,15	USD	260.000	Vici Properties LP 5.75% 01/02/2027	245.480	0,17
USD	88.000	Teleflex Inc. 4.25% 01/06/2028	76.760	0,05	USD	420.000	Vistra Operations Company LLC 5.63% 15/02/2027	393.750	0,27
USD	215.000	Tempo Acquisition LLC 5.75% 01/06/2025	210.319	0,14	USD	801.000	Waste Pro USA Inc. 5.50% 15/02/2026	705.705	0,48
USD	415.000	Tenet Healthcare Corp 4.88% 01/01/2026	385.541	0,26	USD	344.000	Wesco Distribution Inc. 7.13% 15/06/2025	343.355	0,23
USD	505.000	Tenet Healthcare Corp 5.13% 01/11/2027	455.131	0,31	USD	1.032.000	Wesco Distribution Inc. 7.25% 15/06/2028	1.020.413	0,70
USD	736.000	Tenet Healthcare Corp 6.25% 01/02/2027	691.455	0,47	USD	504.000	White Cap Buyer LLC 6.88% 15/10/2028	416.435	0,28
USD	150.000	Tenet Healthcare Corp. 4.63% 01/09/2024	145.300	0,10	USD	603.000	WR Grace Holdings LLC 4.88% 15/06/2027	519.151	0,35
USD	115.000	Tenet Healthcare Corp. 4.63% 15/06/2028	101.015	0,07	USD	151.000	WR Grace Holdings LLC 5.63% 01/10/2024	147.326	0,10
USD	541.000	Tenet Healthcare Corp. 6.13% 01/10/2028	479.313	0,32	USD	929.000	WR Grace Holdings LLC 5.63% 15/08/2029	702.690	0,47
USD	748.000	Tenneco Inc. 7.88% 15/01/2029	741.044	0,51	USD	428.000	Zayo Group Holdings Inc 4.00% 01/03/2027	346.868	0,24
USD	179.000	Terraform Power Operating LLC 4.75% 15/01/2030	151.812	0,11	USD	690.000	ZoomInfo Technologies LLC 3.88% 01/02/2029	567.283	0,37
USD	192.000	Terraform Power Operating LLC 5.00% 31/01/2028	169.878	0,12	Total de Estados Unidos			85.883.580	58,14
USD	534.000	TK Elevator US Newco Inc. 5.25% 15/07/2027	454.568	0,30	Total de bonos			102.637.554	69,53
USD	569.000	Transdigm Inc. 8.00% 15/12/2025	577.182	0,39	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			102.637.554	69,53
USD	1.426.000	TransDigm Inc. 6.25% 15/03/2026	1.385.003	0,94	Valor total de las inversiones			138.253.693	93,68
USD	1.387.000	Uber Technologies Inc. 4.50% 15/08/2029	1.165.940	0,80	(Coste total: 161.186.881 USD)				
USD	86.000	Uber Technologies Inc. 6.25% 15/01/2028	80.088	0,05	<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>				
USD	482.000	United Airlines Inc. 4.38% 15/04/2026	431.525	0,29					
USD	279.000	Univision Communications Inc. 4.50% 01/05/2029	228.724	0,15					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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				HONG KONG					
USD	200.000	Competition Team Technologies Limited 3.75% 12/03/2024	196.308	0,49	USD	400.000	Bank of East Asia Limited FRN 29/05/2030	372.260	0,94
		Total de Bahamas	196.308	0,49	USD	200.000	Glp China Holdings 2.95% 29/03/2026	156.582	0,39
					USD	650.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	643.108	1,61
ISLAS CAIMÁN					USD	485.000	Lenovo Group Limited 6.54% 27/07/2032	452.263	1,14
USD	250.000	AAC Technologies Holdings Inc. 3.00% 27/11/2024	219.138	0,55	USD	500.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	350.212	0,88
USD	250.000	Alibaba Group Holding Limited 4.50% 28/11/2034	211.629	0,53			Total de Hong Kong	1.974.425	4,96
USD	500.000	China Mengniu Dairy Company 1.88% 17/06/2025	457.416	1,15	INDIA				
USD	600.000	Cifi Holdings Group Company Limited 6.00% 16/07/2025	135.000	0,34	USD	600.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	455.135	1,14
USD	600.000	CK Hutchison International 17 II Limited 3.25% 29/09/2027	556.450	1,40	USD	280.000	Adani Green Energy Limited 4.38% 08/09/2024	233.100	0,59
USD	460.000	Country Garden Holdings Company Limited 3.13% 22/10/2025	149.753	0,38	USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	175.073	0,44
USD	200.000	Country Garden Holdings Company Limited 5.40% 27/05/2025	66.876	0,17	USD	400.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	336.277	0,84
USD	500.000	ENN Energy Holdings Limited 2.63% 17/09/2030	407.851	1,02	USD	300.000	Adani Ports and SEZ Limited 3.10% 02/02/2031	219.689	0,55
USD	400.000	Goodman HK Finance 3.00% 22/07/2030	329.662	0,83	USD	800.000	Adani Transmission Limited 4.00% 03/08/2026	725.186	1,82
USD	500.000	HPHT Finance 19 Limited 2.88% 05/11/2024	478.120	1,20	USD	226.000	GMR Hyderabad International Airport 4.75% 02/02/2026	203.205	0,51
USD	1.000.000	Logan Group Company Limited 0.00% 06/07/2026	167.602	0,42	USD	500.000	Indian Railway Finance Corp. Limited 3.57% 21/01/2032	400.960	1,01
USD	400.000	Longfor Properties Company 4.50% 16/01/2028	300.527	0,76	USD	500.000	Ongc Videsh Limited 4.63% 15/07/2024	492.449	1,24
USD	800.000	Meituan Inc. 3.05% 28/10/2030	535.999	1,35	USD	500.000	Reliance Industries Limited 3.67% 30/11/2027	459.971	1,15
USD	500.000	Melco Resorts Finance 4.88% 06/06/2025	373.475	0,94	USD	690.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	522.707	1,31
USD	250.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Limited 2.75% 13/05/2030	212.788	0,53			Total de India	4.223.752	10,60
USD	270.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Limited 3.75% 25/02/2029	250.848	0,63	INDONESIA				
USD	200.000	Sunac China Holdings Limited 6.50% 09/07/2023	29.278	0,07	USD	400.000	Pertamina Persero PT 5.63% 20/05/2043	339.312	0,85
USD	400.000	Tencent Holdings Limited 2.88% 22/04/2031	325.367	0,82	USD	1.000.000	Perusahaan Listrik Negara Pt 5.25% 24/10/2042	767.999	1,93
USD	600.000	Times China Holdings Limited 6.75% 16/07/2023	125.250	0,31	USD	200.000	Perusahaan Listrik Negara Pt 6.25% 25/01/2049	165.184	0,41
USD	467.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp. 1.63% 24/09/2025	417.845	1,05	USD	279.000	Saka Energi Indonesia Pt 4.45% 05/05/2024	257.660	0,65
		Total de Islas Caimán	5.750.874	14,45					

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*	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 (continuación)				REPÚBLICA DE COREA (SUR)					
USD	400.000	Sri Rejeki Isman TBK PT 7.25% 16/01/2025	28.000	0,07	USD	500.000	Shinhan Financial Group Company Limited - Perp FRN	497.169	1,25
		Total de Indonesia	1.558.155	3,91	USD	500.000	Sk Hynix Inc. 1.50% 19/01/2026	436.169	1,10
						Total de República de Corea (Sur)	933.338	2,35	
ISLA DE MAN				SINGAPUR					
USD	400.000	Gohl Capital Limited 4.25% 24/01/2027	337.507	0,85	USD	300.000	ABJA Investment Company 5.45% 24/01/2028	277.515	0,70
		Total de Isla de Man	337.507	0,85	USD	400.000	BOC Aviation Limited 2.63% 17/09/2030	324.229	0,81
MALASIA									
USD	200.000	Axiata Bhd 4.36% 24/03/2026	196.022	0,49	USD	550.000	DBS Group Holdings Limited FRN 11/12/2028	544.576	1,37
USD	500.000	Petronas Capital Limited 3.50% 21/04/2030	452.922	1,14	USD	700.000	SingTel Group Treasury Pte Limited 1.88% 10/06/2030	568.473	1,42
USD	400.000	TNB Global Ventures Capital Bhd 4.85% 01/11/2028	387.387	0,97	USD	550.000	United Overseas Bank LT FRN 16/03/2031	483.187	1,21
		Total de Malasia	1.036.331	2,60			Total de Singapur	2.197.980	5,51
MAURICIO				TAILANDIA					
USD	400.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	356.558	0,90	USD	800.000	Bangkok Bank plc FRN 25/09/2034	658.740	1,65
USD	469.000	Network I2i Limited - Perp FRN	428.373	1,08	USD	200.000	GC Treasury Centre Company Limited 2.98% 18/03/2031	157.446	0,40
		Total de Mauricio	784.931	1,98	USD	270.000	GC Treasury Centre Company Limited 4.30% 18/03/2051	191.756	0,48
					USD	400.000	Kasikornbank plc FRN 02/10/2031	348.693	0,88
						Total de Tailandia	1.356.635	3,41	
PAÍSES BAJOS				REINO UNIDO					
USD	534.800	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	433.786	1,09	USD	1.000.000	HSBC Holdings plc FRN 23/09/2168	961.426	2,42
USD	250.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	197.433	0,50	USD	600.000	Standard Chartered plc FRN 26/01/2169	534.183	1,34
USD	500.000	Royal Capital BV - Perp FRN	467.719	1,18	USD	400.000	Vedanta Resources plc 6.13% 09/08/2024	233.480	0,59
		Total de Países Bajos	1.098.938	2,77			Total de Reino Unido	1.729.089	4,35
FILIPINAS				ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)					
USD	400.000	Globe Telecom Inc. 2.50% 23/07/2030	312.550	0,79	USD	500.000	CMHI Finance BVI Company - Perp FRN	491.282	1,24
USD	520.000	Globe Telecom Inc. - Perp FRN	459.063	1,15	USD	500.000	CNPC Global Capital Limited 1.35% 23/06/2025	456.274	1,15
USD	200.000	International Container Terminal Services Inc 4.75% 17/06/2030	180.236	0,45	USD	450.000	Contemporary Ruiding Development Limited 2.63% 17/09/2030	354.589	0,89
USD	714.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	652.588	1,64					
USD	670.000	Smc Global Power Holdings Corp. - Perp FRN	567.691	1,43					
USD	400.000	Smc Global Power Holdings Corp. - Perp FRN	358.700	0,90					
		Total de Filipinas	2.530.828	6,36					

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 (continuación)						
ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS) (continuación)				PAKISTÁN						
USD	600.000	Elect Global Investments Limited - Perp FRN	506.430	1,28	USD	350.000	Pakistan (Govt of) 6.00% 08/04/2026	137.619	0,35	
USD	750.000	FPC Resources Limited 4.38% 11/09/2027	718.732	1,80	USD	200.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 30/09/2025	80.769	0,20	
USD	511.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	449.603	1,13	Total de Pakistán			218.388	0,55	
USD	500.000	Hongkong Electric Finance Limited 1.88% 27/08/2030	390.603	0,98	FILIPINAS					
USD	1.000.000	Jgsh Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	913.000	2,29	USD	1.000.000	Philippine (Govt of) 3.00% 01/02/2028	910.021	2,29	
USD	600.000	Nan Fung Treasury Limited 5.00% 05/09/2028	559.045	1,41	USD	400.000	Philippine (Govt of) 3.75% 14/01/2029	373.120	0,94	
USD	750.000	State Grid Overseas Investment 2016 Limited 1.63% 05/08/2030	601.864	1,51	Total de Filipinas			1.283.141	3,23	
USD	500.000	Studio City Finance Limited 5.00% 15/01/2029	233.205	0,59	SRI LANKA					
USD	700.000	Studio City Finance Limited 6.00% 15/07/2025	402.958	1,00	USD	420.000	Sri Lanka (Govt of) 5.75% 18/04/2023	108.557	0,27	
USD	850.000	Tsmc Global Limited 0.75% 28/09/2025	749.233	1,88	Total de Sri Lanka			108.557	0,27	
USD	400.000	Yongda Investment Limited 2.25% 16/06/2025	368.269	0,93	ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)					
Total de Islas Vírgenes (Británicas)			7.195.087	18,08	USD	500.000	Talent Yield International Limited 3.13% 06/05/2031	422.767	1,06	
Total de bonos			32.904.178	82,67	Total de Islas Vírgenes (Británicas)			422.767	1,06	
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				4.430.738	11,13	
INDIA				Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				37.334.916	93,80	
USD	400.000	Export-Import Bank of India 3.25% 15/01/2030	334.432	0,84	Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario					
Total de India			334.432	0,84	Bonos					
INDONESIA				ISLAS CAIMÁN						
USD	800.000	Indonesia (Govt of) 3.40% 18/09/2029	706.914	1,78	USD	450.000	Sunac China Holdings Limited 8.35% 19/04/2023	64.688	0,16	
USD	1.000.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 11/02/2029	960.118	2,40	Total de Islas Caimán			64.688	0,16	
USD	200.000	Indonesia (Govt of) 6.63% 17/02/2037	209.122	0,53	Total de bonos				64.688	0,16
USD	200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 2.30% 23/06/2025	187.299	0,47	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				64.688	0,16
Total de Indonesia			2.063.453	5,18	Valor total de las inversiones			37.399.604	93,96	
(Coste total: 47.506.070 USD)										

* Diferencias menores debido al redondeo.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios						
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				Fondos						
ALEMANIA				IRLANDA						
EUR	1.400.000	Germany (Govt of) 0.00% 17/05/2023	1.387.920	4,26	17.236	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	1.689.953	5,17		
Total de Alemania			1.387.920	4,26	Total de Irlanda			1.689.953	5,17	
REINO UNIDO				LUXEMBURGO						
GBP	600.000	United Kingdom Gilt 0.38% 22/10/2030	510.753	1,56	112.743	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities XU**	2.402.267	7,35		
GBP	575.000	United Kingdom Gilt 1.25% 22/07/2027	568.444	1,74	254.142	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond 4E**	2.369.314	7,25		
GBP	459.000	United Kingdom Gilt 1.25% 31/07/2051	287.434	0,88	17.828	Threadneedle Lux - European High Yield Bond 4E**	175.381	0,54		
GBP	1.175.000	United Kingdom Gilt 4.25% 07/06/2032	1.360.308	4,16	28.966	Threadneedle Lux - European Short-Term High Yield Bond XE**	2.836.039	8,68		
Total de Reino Unido			2.726.939	8,34	40.306	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds XU**	403.400	1,23		
ESTADOS UNIDOS				Total de Luxemburgo						
USD	508.000	United States Treasury N/B 2.88% 15/05/2032	479.134	1,47	125.343	Threadneedle Lux - Global Focus XU**	2.462.176	7,54		
USD	111.000	United States Treasury N/B 3.00% 15/08/2052	97.779	0,30	305.372	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities XE**	3.131.127	9,59		
USD	542.000	United States Treasury N/B 3.38% 15/08/2042	500.915	1,53	57.542	Threadneedle Lux - Pan European Smaller Companies 4E**	533.721	1,63		
Total de Estados Unidos			1.077.828	3,30	Total de Luxemburgo			14.313.425	43,81	
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				5.192.687	15,90	Total de fondos			16.003.378	48,98
Instrumentos estructurados - Materias primas				Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios						
IRLANDA				Otros organismos de inversión colectiva						
61	Invesco Physical Gold Etc 0.00%	10.065	0,03	Fondos						
Total de Irlanda			10.065	0,03	REINO UNIDO					
Total de instrumentos estructurados - Materias primas				10.065	0,03	GBP	104.314	CT European Select Fund***	201.582	0,62
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				5.202.752	15,93	EUR	67.108	CT American Fund***	481.336	1,47
						GBP	449.955	CT Asia Fund***	986.214	3,02
						GBP	75.143	CT European Fund***	143.943	0,44

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	1.011.972 CT Japan Fund***	2.075.290	6,35
EUR	339.911 CT Emerging Market Local Fund***	854.672	2,62
GBP	1.548.159 CT Sterling Short-Dated Corporate Bond Fund***	1.808.565	5,54
	Total de Reino Unido	6.551.602	20,06
	Total de fondos	6.551.602	20,06
	Total de otros organismos de inversión colectiva	6.551.602	20,06
	Valor total de las inversiones	27.757.732	84,97

(Coste total: 26.990.116 EUR)

* Diferencias menores debido al redondeo.

** Consulte la nota 18.

*** Fondo de parte vinculada.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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)					
REINO UNIDO				ALEMANIA					
GBP	498.000	United Kingdom Gilt 1.25% 31/07/2051	305.510	0,90	1.301	Adidas AG	151.515	0,44	
Total de Reino Unido			305.510	0,90	Total de Alemania			151.515	0,44
ESTADOS UNIDOS				HONG KONG					
USD	1.600.000	United States Treasury N/B 1.88% 15/02/2032	1.355.125	3,97	20.200	AIA Group Limited	168.421	0,49	
USD	3.000.000	United States Treasury N/B 2.88% 15/05/2032	2.771.953	8,12	Total de Hong Kong			168.421	0,49
USD	121.000	United States Treasury N/B 3.00% 15/08/2052	104.419	0,31	INDIA				
USD	775.200	United States Treasury N/B 3.38% 15/08/2042	701.859	2,06	8.136	HDFC Bank Limited - ADR	475.305	1,39	
Total de Estados Unidos			4.933.356	14,46	Total de India			475.305	1,39
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				5.238.866	15,36	INDONESIA			
Renta variable				IRLANDA					
CANADÁ				JAPÓN					
	2.506	Nutrien Limited	210.103	0,62	800	Keyence Corp.	264.741	0,78	
Total de Canadá			210.103	0,62	5.100	Recruit Holdings Company Limited	146.610	0,43	
ISLAS CAIMÁN				PAÍSES BAJOS					
	1.567	Sea Limited	87.830	0,26	1.524	Koninklijke DSM NV	175.351	0,51	
Total de Islas Caimán			87.830	0,26	Total de Países Bajos			175.351	0,51
DINAMARCA				NORUEGA					
	4.596	Novo-Nordisk A/S	461.059	1,36	9.933	Equinor ASA	326.412	0,96	
	3.280	Orsted A/S	262.533	0,77	Total de Noruega			326.412	0,96
	11.070	Tryg A/S	228.841	0,67	REPÚBLICA DE COREA (SUR)				
Total de Dinamarca			952.433	2,80	7.769	Samsung Electronics Company Limited	288.345	0,85	
FRANCIA				REPÚBLICA DE COREA (SUR)					
	1.197	Essilor International SA	164.580	0,48	590	Samsung Sdi Company Limited	225.163	0,66	
	740	L'Oreal SA	239.412	0,70	Total de República de Corea (Sur)			513.508	1,51
	301	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	179.992	0,53					
	2.877	Schneider Electric SE	329.590	0,97					
	11.734	TotalEnergies SE	554.932	1,62					
Total de Francia			1.468.506	4,30					

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)				Renta variable (continuación)				
SINGAPUR				ESTADOS UNIDOS (continuación)				
14.700	DBS Group Holdings Limited	342.068	1,00	3.439	NextEra Energy Inc.	269.652	0,79	
	Total de Singapur	342.068	1,00	2.032	Nvidia Corp.	246.664	0,72	
SUIZA				2.272	Paypal Holdings Inc.	195.551	0,57	
3.804	Nestle SA - Reg	413.850	1,21	3.254	Qualcomm Inc.	367.637	1,08	
1.048	Roche Holding AG	344.400	1,01	515	S&P Global Inc.	157.255	0,46	
	Total de Suiza	758.250	2,22	1.548	Stryker Corp.	313.532	0,92	
TAIWÁN				719	Svb Financial Group	241.426	0,71	
40.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	531.669	1,55	700	Thermo Fisher Scientific Inc.	355.033	1,03	
	Total de Taiwán	531.669	1,55	5.151	T-Mobile USA Inc.	691.110	2,03	
REINO UNIDO				2.992	Trimble Navigation Limited	162.376	0,48	
7.689	Anglo American plc	234.794	0,69	7.478	Uber Technologies Inc.	198.167	0,58	
7.049	Diageo plc	298.818	0,88	1.484	Union Pacific Corp.	289.113	0,85	
7.229	SSE plc	123.265	0,36	3.491	Walt Disney Company	329.306	0,97	
	Total de Reino Unido	656.877	1,93	Total de Estados Unidos		13.195.327	38,71	
ESTADOS UNIDOS				Total de renta variable		21.298.501	62,46	
2.441	Abbott Laboratories	236.191	0,69	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				
857	Adobe Systems Inc.	235.846	0,69			26.537.367	77,82	
9.425	Alphabet Inc. - A	901.501	2,64	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
8.947	Amazon.com Inc.	1.011.011	2,97	Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
1.615	American Tower Corp.	346.740	1,02	ESTADOS UNIDOS				
1.765	Autodesk Inc.	329.702	0,97	USD	815.000	United States Treasury Bill 0.00% 08/12/2022	810.526	2,38
2.182	Centene Corp.	169.781	0,50	USD	1.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 16/02/2023	986.375	2,89
952	Cooper Companies Inc.	251.233	0,74	Total de Estados Unidos		1.796.901	5,27	
1.109	Deere & Company	370.284	1,09	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
2.365	Doximity Inc.	71.470	0,21			1.796.901	5,27	
1.853	Ecolab Inc.	267.610	0,79	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
2.877	Electronic Arts Inc.	332.898	0,98			1.796.901	5,27	
503	Elevance Health Inc.	228.483	0,67					
1.372	Eli Lilly & Company	443.636	1,30					
414	Equinix Inc.	235.500	0,69					
1.901	First Republic Bank	248.176	0,73					
5.024	General Motors Company	161.220	0,47					
2.276	IntercontinentalExchange Inc.	205.637	0,60					
1.147	Intuit Inc.	444.257	1,30					
4.002	JPMorgan Chase & Company	418.209	1,23					
864	Lam Research Corp.	316.224	0,93					
2.344	Mastercard Inc. - A	666.493	1,95					
224	Mercadolibre Inc.	185.423	0,54					
5.586	Microsoft Corp.	1.300.980	3,82					

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*
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
LUXEMBURGO			
124.564	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio XU**	2.600.130	7,63
	Total de Luxemburgo	2.600.130	7,63
	Total de fondos	2.600.130	7,63
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	2.600.130	7,63
Otros organismos de inversión colectiva			
Fondos			
REINO UNIDO			
USD	30.595 CT Emerging Market Local Fund***	75.103	0,22
	Total de Reino Unido	75.103	0,22
	Total de fondos	75.103	0,22
	Total de otros organismos de inversión colectiva	75.103	0,22
	Valor total de las inversiones	31.009.501	90,94
	(Coste total: 30.645.983 USD)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

** Consulte la nota 18.

*** Fondo de parte vinculada.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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	APA Infrastructure Limited 0.75% 15/03/2029	76.782	0,08	EUR	100.000	Teollisuuden Voima Oyj 2.63% 31/03/2027	89.006	0,09		
USD	77.000	Ausgrid Finance Pty Limited 4.35% 01/08/2028	71.426	0,07	Total de Finlandia			334.281	0,33		
Total de Australia				148.208	0,15	FRANCIA					
BÉLGICA				EUR 100.000 Solvay SA FRN 02/03/2169 82.410 0,08							
EUR 200.000 Solvay SA Perp FRN 189.633 0,20				Total de Bélgica							
Total de Bélgica				272.043	0,28	EUR 100.000 Altice France SA 2.50% 15/01/2025 87.542 0,09					
BERMUDAS				EUR 100.000 Altice France SA 4.00% 15/07/2029 74.584 0,07							
USD	100.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	85.973	0,08	EUR 100.000 Altice France SA 4.13% 15/01/2029 75.018 0,07						
Total de Bermudas				85.973	0,08	EUR 104.000 Altice France SA 4.25% 15/10/2029 77.566 0,08					
CANADÁ				EUR 100.000 Altice France SA 5.88% 01/02/2027 85.048 0,08							
EUR	172.000	Primo Water Holdings Inc. 3.88% 31/10/2028	139.419	0,15	EUR 100.000 BPCE SA 0.25% 14/01/2031 71.656 0,07						
Total de Canadá				139.419	0,15	EUR 192.000 CAB Selas 3.38% 01/02/2028 144.615 0,14					
ISLAS CAIMÁN				EUR 100.000 Casino Guichard Perrachon SA 5.25% 15/04/2027 47.979 0,05							
GBP	212.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	190.932	0,19	EUR 107.000 Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026 54.970 0,05						
Total de Islas Caimán				190.932	0,19	EUR 200.000 Casino Guichard-Perrachon SA 4.50% 07/03/2024 131.934 0,13					
REPÚBLICA CHECA				EUR 114.000 Constellium SE 3.13% 15/07/2029 80.597 0,08							
EUR	100.000	Allwyn International AS 4.13% 20/11/2024	93.824	0,09	EUR 100.000 Crown European Holdings SA 2.88% 01/02/2026 90.229 0,09						
Total de República Checa				93.824	0,09	EUR 200.000 Electricite de France SA - Perp FRN 138.103 0,14					
DINAMARCA				EUR 200.000 Electricite de France SA - Perp FRN 150.526 0,15							
EUR	100.000	Danske Bank AS 0.63% 26/05/2025	91.130	0,09	EUR 200.000 Electricite de France SA - Perp FRN 171.369 0,17						
Total de Dinamarca				91.130	0,09	EUR 100.000 Electricite de France SA - Perp FRN 91.406 0,09					
FINLANDIA				GBP 200.000 Electricite de France SA - Perp FRN 168.605 0,17							
EUR	100.000	Nordea Bank Abp 0.50% 14/05/2027	85.586	0,08	EUR 100.000 Elior Group SA 3.75% 15/07/2026 75.361 0,07						
EUR	100.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	81.428	0,08	EUR 100.000 Elis SA 1.00% 03/04/2025 87.722 0,09						
EUR	100.000	Teollisuuden Voima Oyj 1.38% 23/06/2028	78.261	0,08	EUR 100.000 Elis SA 4.13% 24/05/2027 90.540 0,09						
				EUR 100.000 Emeric SASU 3.38% 31/03/2028 79.252 0,08							
				EUR 400.000 Faurecia SE 2.38% 15/06/2027 289.009 0,28							
				EUR 187.000 Faurecia SE 2.75% 15/02/2027 141.206 0,14							
				EUR 100.000 Faurecia SE 3.75% 15/06/2028 74.392 0,07							
				EUR 205.000 Getlink SE 3.50% 30/10/2025 184.054 0,18							
				EUR 317.000 Iliad Holdings SAS 5.13% 15/10/2026 281.190 0,28							
				EUR 100.000 Iliad Holdings SAS 5.63% 15/10/2028 84.419 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)					
FRANCIA (continuación)				ALEMANIA (continuación)					
EUR	100.000	Iliad SA 0.75% 11/02/2024	92.411	0,10	EUR	100.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	81.683	0,08
EUR	182.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	161.253	0,16	EUR	110.000	HT Troplast AG 9.25% 15/07/2025	95.629	0,09
EUR	160.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	140.894	0,14	EUR	100.000	Infineon Technologies AG - Perp FRN	89.819	0,10
EUR	163.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	159.767	0,15	EUR	200.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	129.503	0,13
EUR	100.000	Renault SA 2.38% 25/05/2026	82.109	0,08	EUR	115.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	89.226	0,09
EUR	100.000	Renault SA 2.50% 02/06/2027	78.209	0,08	EUR	126.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	99.955	0,10
EUR	100.000	Rexel SA 2.13% 15/06/2028	76.594	0,08	EUR	191.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	150.806	0,15
EUR	100.000	Spie SA 3.13% 22/03/2024	96.075	0,09	EUR	100.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	89.029	0,09
EUR	200.000	Valeo 1.00% 03/08/2028	150.046	0,15	EUR	150.000	Schaeffler AG 2.88% 26/03/2027	126.068	0,12
EUR	100.000	Veolia Environnement SA - Perp FRN	84.802	0,08	EUR	100.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	80.294	0,08
EUR	200.000	Verallia SA 1.63% 14/05/2028	155.510	0,15	EUR	100.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	80.294	0,08
EUR	100.000	Verallia SA 1.88% 10/11/2031	67.334	0,07	EUR	329.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 2.00% 15/07/2025	283.241	0,27
	Total de Francia		4.473.896	4,41	EUR	94.000	Thyssenkrupp AG 2.50% 25/02/2025	83.005	0,08
					EUR	210.000	Thyssenkrupp AG 2.88% 22/02/2024	193.284	0,19
ALEMANIA				IRLANDA					
EUR	100.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	80.289	0,08	EUR	100.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	88.504	0,09
EUR	100.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	67.792	0,07	EUR	276.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	239.635	0,24
EUR	100.000	Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032	96.367	0,09	GBP	185.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III 4.88% 15/07/2028	154.663	0,15
EUR	100.000	Bayer AG 1.13% 06/01/2030	77.947	0,08			Total de Irlanda	482.802	0,48
EUR	100.000	Bayer AG FRN 25/03/2082	84.883	0,08	EUR	100.000	ZF Finance GmbH 3.75% 21/09/2028	76.524	0,08
EUR	130.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	104.666	0,10			Total de Alemania	3.515.941	3,47
EUR	101.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	81.523	0,08	ISLA DE MAN				
EUR	100.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	89.320	0,09	EUR	142.000	Playtech plc 4.25% 07/03/2026	126.445	0,13
EUR	100.000	Commerzbank AG FRN 21/03/2028	95.165	0,09			Total de Isla de Man	126.445	0,13
EUR	46.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	42.382	0,04	ITALIA				
USD	150.000	Deutsche Bank AG FRN 28/05/2032	107.806	0,11	EUR	113.000	Atlantia SpA 1.88% 13/07/2027	89.325	0,09
EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	175.800	0,17					
EUR	300.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	230.185	0,23					
EUR	100.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	82.583	0,08					
EUR	100.000	Douglas GmbH 6.00% 08/04/2026	75.221	0,07					
EUR	111.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	90.668	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)					
ITALIA (continuación)				JERSEY - ISLAS DEL CANAL (continuación)					
EUR	206.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.63% 25/01/2028	159.953	0,16	EUR	100.000	Kane Bidco Limited 5.00% 13/11/2026	82.670	0,08
EUR	100.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 01/02/2027	82.224	0,08	Total de Jersey - Islas del Canal				
EUR	100.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 04/11/2025	88.525	0,09	LUXEMBURGO				
EUR	300.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	227.299	0,23	EUR	100.000	Adler Group SA 2.75% 13/11/2026	49.899	0,05
EUR	200.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 15/01/2030	147.334	0,14	EUR	200.000	Adler Group SA 3.25% 05/08/2025	108.241	0,11
EUR	199.000	Autostrade per l'Italia SpA 4.38% 16/09/2025	190.074	0,19	EUR	130.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	112.328	0,11
EUR	170.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	135.299	0,13	EUR	100.000	Altice Financing SA 4.25% 15/08/2029	76.192	0,07
EUR	149.000	Fis Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	122.222	0,12	EUR	137.000	Altice Finco SA 4.75% 15/01/2028	98.217	0,10
EUR	100.000	Gamma Bidco SpA 6.25% 15/07/2025	90.657	0,08	EUR	164.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	122.358	0,12
EUR	100.000	Intesa Sanpaolo SpA FRN 12/07/2029	95.855	0,09	GBP	120.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	96.910	0,10
EUR	107.000	Leonardo SpA 2.38% 08/01/2026	96.708	0,09	GBP	140.000	B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	133.249	0,13
EUR	100.000	Lottomatica SpA 9.75% 30/09/2027	98.300	0,10	EUR	100.000	Becton Dickinson Euro Finance Sar1 1.34% 13/08/2041	59.303	0,06
EUR	293.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	245.962	0,23	EUR	141.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	110.381	0,11
EUR	120.000	Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	108.706	0,11	EUR	121.000	Cirsa Finance International Sar1 4.75% 22/05/2025	106.230	0,10
EUR	150.000	Telecom Italia SpA 3.63% 25/05/2026	135.198	0,13	EUR	95.107	Cirsa Finance International Sar1 6.25% 20/12/2023	91.100	0,09
	Total de Italia		2.113.641	2,06	GBP	100.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	87.455	0,09
JAPÓN				JERSEY - ISLAS DEL CANAL					
USD	200.000	Central Nippon Expressway Company Limited 0.89% 10/12/2025	175.775	0,17	EUR	100.000	Grand City Properties SA 0.13% 11/01/2028	72.903	0,07
USD	200.000	Japan Finance Organization for Municipalities 0.63% 02/09/2025	178.053	0,17	EUR	150.000	Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	136.547	0,13
EUR	100.000	Softbank Group Corp. 3.13% 19/09/2025	84.596	0,08	EUR	384.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	283.674	0,27
EUR	100.000	Softbank Group Corp. 4.00% 19/09/2029	70.029	0,07	EUR	198.000	Lincoln Financing Sar1 3.63% 01/04/2024	188.486	0,18
EUR	100.000	SoftBank Group Corp. 2.88% 06/01/2027	75.493	0,07	EUR	140.000	Loarre Investments Sar1 6.50% 15/05/2029	130.471	0,13
	Total de Japón		583.946	0,56	EUR	100.000	Matterhorn Telecom SA 4.00% 15/11/2027	86.081	0,08
EUR	259.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	233.040	0,22	EUR	100.000	P3 Group Sar1 1.63% 26/01/2029	72.779	0,07
					EUR	100.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sar1 5.63% 15/12/2026	92.567	0,09
					EUR	100.000	Selp Finance Sar1 3.75% 10/08/2027	90.552	0,08
					EUR	44.000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/01/2033	44.713	0,04

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)				PAÍSES BAJOS (continuación)					
EUR	200.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	164.421	0,16	EUR	100.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	75.309	0,07
		Total de Luxemburgo	2.615.057	2,54	EUR	300.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	278.463	0,27
					EUR	100.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	97.149	0,10
					EUR	287.000	TenneT Holding BV - Perp FRN	254.855	0,24
					EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.75% 09/05/2027	82.540	0,08
					EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.38% 09/05/2030	77.202	0,08
					EUR	200.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	184.797	0,17
					EUR	100.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	79.705	0,08
					EUR	100.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	88.423	0,09
					EUR	100.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	74.724	0,07
					EUR	100.000	Universal Music Group NV 3.75% 30/06/2032	91.659	0,09
					EUR	100.000	Volkswagen International Finance NV 3.25% 18/11/2030	89.420	0,09
					EUR	100.000	VZ Secured Financing BV 3.50% 15/01/2032	70.497	0,07
					EUR	100.000	VZ Vendor Financing II BV 2.88% 15/01/2029	69.820	0,07
					EUR	200.000	ZF Europe Finance BV 2.00% 23/02/2026	163.679	0,16
					EUR	100.000	ZF Europe Finance BV 3.00% 23/10/2029	70.833	0,07
							Total de Países Bajos	3.882.230	3,79
							NORUEGA		
					EUR	100.000	DNB Bank ASA FRN 21/09/2027	95.987	0,09
					USD	244.000	Kommunalbanken AS 0.38% 11/09/2025	217.286	0,22
							Total de Noruega	313.273	0,31
							PANAMÁ		
					EUR	101.000	Carnival Corp. 7.63% 01/03/2026	77.389	0,08
							Total de Panamá	77.389	0,08
					EUR	100.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	78.753	0,08
					EUR	100.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	77.996	0,08
					EUR	100.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	75.309	0,07

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)					
PORTUGAL				SUECIA (continuación)					
EUR	100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 14/03/2082	76.655	0,08	EUR	135.000	Intrum AB 3.50% 15/07/2026	106.470	0,10
					EUR	100.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	87.166	0,09
		Total de Portugal	76.655	0,08	EUR	100.000	Intrum Justitia AB 3.13% 15/07/2024	89.716	0,09
RUMANÍA					EUR	100.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	78.515	0,08
EUR	100.000	RCS & RDS SA 2.50% 05/02/2025	86.098	0,08	EUR	100.000	Sagax AB 2.25% 13/03/2025	91.115	0,09
EUR	100.000	RCS & RDS SA 3.25% 05/02/2028	75.274	0,07	EUR	110.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB - Perp FRN	45.775	0,04
		Total de Rumanía	161.372	0,15	EUR	199.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	159.050	0,16
ESPAÑA					EUR	100.000	Verisure Holding AB 3.88% 15/07/2026	84.438	0,08
EUR	100.000	Banco de Sabadell SA FRN 24/03/2026	90.713	0,09	EUR	100.000	Verisure Holding AB 9.25% 15/10/2027	99.371	0,10
EUR	100.000	Banco de Sabadell SA FRN 08/09/2026	96.324	0,09	EUR	155.000	Verisure Midholding A 5.25% 15/02/2029	112.255	0,11
EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.00% 15/09/2027	78.178	0,08			Total de Suecia	1.277.252	1,26
EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.25% 15/01/2029	72.887	0,07	SUIZA				
EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.50% 08/06/2028	76.945	0,08	EUR	100.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	58.760	0,06
EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 2.00% 15/02/2033	64.150	0,06			Total de Suiza	58.760	0,06
EUR	200.000	Cellnex Finance Company SA 2.25% 12/04/2026	176.983	0,17	REINO UNIDO				
EUR	144.000	Grifols Escrow Issuer SA 3.88% 15/10/2028	104.628	0,11	EUR	100.000	Anglo American Capital plc 4.75% 21/09/2032	94.820	0,09
EUR	100.000	Grifols SA 1.63% 15/02/2025	86.946	0,09	GBP	100.000	Barclays plc 3.25% 12/02/2027	94.072	0,09
EUR	200.000	Grifols SA 2.25% 15/11/2027	152.947	0,15	EUR	103.000	BCP V Modular Services Finance II plc 4.75% 30/11/2028	81.500	0,08
EUR	100.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	86.063	0,08	GBP	167.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	122.203	0,12
EUR	100.000	International Consolidated Airlines Group SA 2.75% 25/03/2025	82.058	0,08	EUR	142.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	124.002	0,12
EUR	100.000	Kaixo Bondco Telecom SA 5.13% 30/09/2029	77.374	0,08	USD	94.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	87.244	0,09
EUR	372.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	317.825	0,31	EUR	100.000	British American Tobacco plc - Perp FRN	72.477	0,07
		Total de España	1.564.021	1,54	GBP	75.000	Broadgate Financing plc 5.00% 05/10/2031	76.397	0,07
SUECIA					EUR	100.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	73.226	0,07
EUR	162.000	Heimstaden Bostad AB FRN 01/05/2169	93.884	0,09	GBP	100.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN	101.003	0,10
EUR	150.000	Heimstaden Bostad AB FRN 01/05/2170	86.930	0,09	GBP	167.000	Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	171.642	0,17
EUR	200.000	Heimstaden Bostad AB - Perp FRN	142.567	0,14	GBP	137.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	114.840	0,11
					EUR	155.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	129.382	0,13

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)				REINO UNIDO (continuación)			
EUR	109.000 EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	93.354	0,09	GBP	100.000 Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	95.521	0,09
USD	166.342 Enquest plc 7.00% 15/10/2023	153.154	0,15	GBP	92.570 Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	90.646	0,09
EUR	19.000 HBOS plc FRN 18/03/2030	17.742	0,02	EUR	100.000 Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	81.048	0,08
GBP	39.000 HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	37.243	0,04	EUR	200.000 Victoria plc 3.63% 26/08/2026	144.307	0,14
GBP	100.000 HSBC Holdings plc FRN 24/07/2027	90.123	0,09	GBP	311.000 Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	276.114	0,28
EUR	123.000 Ineos Finance plc 2.88% 01/05/2026	101.205	0,10	EUR	122.000 Vmed O2 UK Financing I plc 3.25% 31/01/2031	90.525	0,09
EUR	186.000 Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	156.222	0,15	EUR	100.000 Vodafone Group plc FRN 03/01/2079	94.647	0,09
EUR	100.000 Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	80.908	0,08	GBP	255.000 Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	244.926	0,24
EUR	119.000 Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	96.281	0,09	USD	231.000 Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	220.173	0,22
GBP	100.000 Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	104.582	0,10	EUR	100.000 Western Power Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	94.277	0,09
EUR	100.000 International Game Technology plc 2.38% 15/04/2028	77.926	0,08	GBP	164.000 Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	144.521	0,14
EUR	290.000 International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	254.191	0,24		Total de Reino Unido	5.863.011	5,76
GBP	187.000 Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	185.462	0,18		ESTADOS UNIDOS		
EUR	100.000 Jaguar Land Rover Automotive plc 2.20% 15/01/2024	87.302	0,09	USD	63.000 AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	50.863	0,05
EUR	136.000 Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	117.860	0,12	USD	32.000 AbbVie Inc. 4.88% 14/11/2048	28.327	0,03
EUR	100.000 Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	76.763	0,08	USD	22.000 AEP Texas Inc. 3.45% 15/05/2051	15.274	0,01
GBP	200.000 Jerrold Finco plc 5.25% 15/01/2027	168.601	0,16	USD	32.000 Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	28.037	0,03
GBP	200.000 Ladbrokes Group Finance plc 5.13% 08/09/2023	220.357	0,21	USD	35.000 Amgen Inc. 3.15% 21/02/2040	25.297	0,02
GBP	201.000 Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	181.027	0,18	USD	12.000 Amgen Inc. 4.20% 22/02/2052	9.470	0,01
EUR	100.000 National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	70.704	0,07	USD	10.000 Amgen Inc. 4.88% 01/03/2053	8.847	0,01
EUR	100.000 Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	77.639	0,08	USD	148.000 Anheuser-Busch Companies LLC 4.70% 01/02/2036	133.637	0,13
EUR	200.000 Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	170.618	0,17	USD	50.000 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 4.35% 01/06/2040	42.354	0,04
GBP	100.000 Premier Foods Finance plc 3.50% 15/10/2026	89.484	0,09	USD	40.000 Apple Inc. 2.65% 11/05/2050	26.585	0,03
GBP	15.000 Santander UK plc - Perp 10.06%	25.855	0,03	EUR	219.000 Ardagh Metal Packaging Finance LLC 2.00% 01/09/2028	164.459	0,15
EUR	171.000 Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	128.525	0,13	USD	119.000 AT&T Inc. 3.50% 15/09/2053	79.570	0,08
EUR	100.000 Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	80.370	0,08	USD	91.000 AT&T Inc. 4.90% 15/08/2037	80.840	0,08
				EUR	258.000 Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	230.500	0,23
				USD	30.000 Bank of America Corp. FRN 21/07/2032	22.443	0,02
				USD	53.000 Bank of America Corp. FRN 13/02/2031	41.938	0,04

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	136.000	Bank of America Corp. FRN 29/04/2031	107.883	0,11	EUR	100.000	Ford Motor Credit Company LLC 1.36% 07/02/2025	86.948	0,09
USD	66.000	Bank of America Corp. FRN 11/03/2032	51.477	0,05	EUR	196.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.33% 25/11/2025	168.806	0,17
USD	30.000	Bank of America Corp. FRN 04/02/2033	23.562	0,02	EUR	100.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	85.599	0,08
USD	42.000	Bank of America Corp. FRN 23/07/2030	35.452	0,03	GBP	100.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	100.716	0,10
USD	95.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 3.85% 15/03/2052	72.935	0,07	EUR	200.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	187.612	0,17
USD	16.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 4.25% 15/01/2049	13.317	0,01	GBP	200.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	200.018	0,19
USD	25.000	Boeing Company 3.95% 01/08/2059	15.629	0,02	USD	19.000	Georgia Power Company 3.70% 30/01/2050	13.742	0,01
USD	30.000	Boeing Company 5.93% 01/05/2060	25.836	0,03	USD	15.000	Georgia Power Company 5.13% 15/05/2052	13.625	0,01
USD	15.000	Bristol-Myers Squibb Company 3.70% 15/03/2052	11.552	0,01	USD	26.000	Goodman USA Finance Three 3.70% 15/03/2028	23.587	0,02
USD	12.000	Broadcom Inc. 4.15% 15/11/2030	10.396	0,01	USD	20.000	HCA Inc. 5.88% 01/02/2029	19.489	0,02
EUR	200.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	151.873	0,15	USD	36.000	Intel Corp. 4.75% 25/03/2050	31.088	0,03
USD	18.000	Charter Communications Operating LLC 3.90% 01/06/2052	11.183	0,01	EUR	200.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	157.898	0,16
USD	40.000	Charter Communications Operating LLC 3.95% 30/06/2062	23.903	0,02	EUR	116.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/03/2029	87.021	0,09
USD	150.000	Citigroup Inc. FRN 31/03/2031	134.962	0,13	EUR	100.000	IQVIA Inc. 2.88% 15/06/2028	80.127	0,08
USD	17.000	Commonwealth Edison Company 4.00% 01/03/2049	13.623	0,01	USD	40.000	JPMorgan Chase & Company FRN 04/02/2032	29.589	0,03
USD	15.000	Consolidated Edison Company of New York Inc. 3.95% 01/04/2050	11.616	0,01	USD	64.000	JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	48.557	0,05
USD	21.000	CSX Corp. 3.80% 15/04/2050	15.849	0,02	USD	199.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	154.184	0,14
USD	30.000	Emera USA Finance LP 4.75% 15/06/2046	23.490	0,02	USD	33.000	JPMorgan Chase & Company FRN 25/01/2033	25.897	0,03
USD	53.000	Enterprise Products Operating LLC 4.45% 15/02/2043	42.742	0,04	USD	45.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2041	31.381	0,03
USD	94.000	Eversource Energy 2.55% 15/03/2031	75.239	0,07	USD	78.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	63.517	0,06
USD	27.000	Eversource Energy 3.38% 01/03/2032	22.819	0,02	GBP	100.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	99.013	0,10
USD	25.000	Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	17.417	0,02	USD	10.000	Kraft Heinz Foods Company 4.38% 01/06/2046	7.860	0,01
USD	31.000	Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	21.597	0,02	USD	47.000	Lowe's Companies Inc. 5.80% 15/09/2062	43.354	0,04
USD	20.000	Federal Home Loan Banks 5.50% 15/07/2036	22.663	0,02	USD	25.000	Microsoft Corp. 4.10% 06/02/2037	23.155	0,02
EUR	100.000	Fidelity National Information Services Inc 1.50% 21/05/2027	87.690	0,09	EUR	203.000	Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	187.931	0,18
					EUR	100.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	84.094	0,08
					USD	25.000	Nisource Inc. 4.38% 15/05/2047	19.925	0,02
					USD	115.000	Nisource Inc. 4.80% 15/02/2044	96.663	0,09
					USD	14.000	Nisource Inc. 5.00% 15/06/2052	12.243	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)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	45.000	Occidental Petroleum Corp. 5.88% 01/09/2025	45.304	0,04	USD	50.000	T-Mobile USA Inc. 3.40% 15/10/2052	33.202	0,03
USD	28.000	Occidental Petroleum Corp. 6.38% 01/09/2028	28.107	0,03	USD	17.000	T-Mobile USA Inc. 5.80% 15/09/2062	15.857	0,02
USD	56.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	56.560	0,06	USD	34.000	UnitedHealth Group Inc. 4.95% 15/05/2062	30.640	0,03
USD	45.000	Occidental Petroleum Corp. 8.00% 15/07/2025	47.900	0,05	USD	101.000	Verizon Communications Inc. 4.40% 01/11/2034	89.012	0,09
USD	30.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	32.400	0,03	USD	50.000	Williams Partners LP 4.85% 01/03/2048	41.670	0,04
USD	65.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	72.384	0,07			Total de Estados Unidos	5.552.418	5,42
EUR	100.000	Olympus Water USA 3.88% 01/10/2028	74.694	0,07			Total de bonos	34.580.098	33,93
USD	44.000	Oracle Corp. 2.88% 25/03/2031	34.568	0,03	Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
USD	29.000	Oracle Corp. 3.60% 01/04/2040	19.684	0,02	AUSTRALIA				
USD	29.000	Oracle Corp. 3.65% 25/03/2041	19.763	0,02	AUD	32.000	Australia (Govt of) 1.00% 21/12/2030	16.465	0,02
USD	78.000	Pacific Gas and Electric Company 4.95% 01/07/2050	57.689	0,06			Total de Australia	16.465	0,02
USD	20.000	Piedmont Natural Gas Company Inc. 3.35% 01/06/2050	13.324	0,02	AUSTRIA				
USD	39.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	32.502	0,03	EUR	5.000	Austria (Govt of) 0.85% 30/06/2120	2.118	0,00
USD	39.000	Plains All American Pipeline LP 4.70% 15/06/2044	28.041	0,03			Total de Austria	2.118	0
USD	33.000	PPL Electric Utilities Corp 4.15% 15/06/2048	27.308	0,03	BÉLGICA				
USD	40.000	Relx Capital Inc. 3.50% 16/03/2023	39.740	0,04	EUR	55.000	Kingdom of Belgium (Govt of) 0.90% 22/06/2029	48.772	0,05
USD	28.000	Relx Capital Inc. 4.75% 20/05/2032	26.242	0,03	EUR	18.000	Kingdom of Belgium (Govt of) 1.70% 22/06/2050	13.104	0,01
USD	30.000	San Diego Gas & Electric Company 3.32% 15/04/2050	21.084	0,02			Total de Bélgica	61.876	0,06
USD	37.000	San Diego Gas & Electric Company 4.15% 15/05/2048	30.008	0,03	CANADÁ				
EUR	100.000	Silgan Holdings Inc. 2.25% 01/06/2028	78.860	0,08	CAD	52.000	Canada (Govt of) 2.75% 01/12/2048	35.264	0,03
EUR	129.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	119.209	0,12	CAD	265.000	Canada Housing Trust No 1 1.10% 15/03/2031	158.076	0,16
USD	22.000	Southern California Edison Company 4.13% 01/03/2048	16.415	0,02	USD	80.000	Province of Ontario 1.13% 07/10/2030	62.325	0,06
EUR	121.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	101.702	0,10			Total de Canadá	255.665	0,25
GBP	50.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	48.899	0,05	FRANCIA				
USD	23.000	T-Mobile USA Inc. 2.63% 15/02/2029	19.069	0,02	EUR	100.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/02/2028	84.974	0,08
USD	42.000	T-Mobile USA Inc. 2.88% 15/02/2031	33.796	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)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					
FRANCIA (continuación)				MÉXICO					
USD	200.000	Caisse D'amortissement de la Dette Sociale 0.38% 23/09/2025	177.312	0,17	USD	2.000.000	Mexico (Govt of) 5.75% 12/10/2110	1.558.729	1,53
USD	200.000	Caisse D'amortissement de la Dette Sociale 1.00% 21/10/2030	155.910	0,15	Total de México			1.558.729	1,53
USD	200.000	Caisse D'amortissement de la Dette Sociale 1.38% 20/01/2031	161.129	0,16	ESPAÑA				
EUR	64.000	France (Govt of) 0.00% 25/02/2027	56.868	0,06	EUR	45.000	Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2027	39.094	0,04
EUR	62.720	France (Govt of) 0.50% 25/06/2044	37.489	0,04	EUR	9.000	Spain (Govt of) 0.10% 30/04/2031	6.855	0,01
EUR	74.014	France (Govt of) 1.25% 25/05/2034	61.010	0,06	EUR	28.000	Spain (Govt of) 1.00% 30/07/2042	17.745	0,02
EUR	18.000	France (Govt Of) 0.75% 25/05/2053	9.798	0,01	EUR	19.000	Spain (Govt of) 1.45% 31/10/2071	9.216	0,01
EUR	100.000	Unedic Asseo 0.25% 16/07/2035	68.414	0,07	EUR	18.000	Spain (Govt of) 2.90% 31/10/2046	15.736	0,02
Total de Francia			812.904	0,80	Total de España			88.646	0,10
ALEMANIA				SUPRANACIONAL					
EUR	126.000	Germany (Govt of) 0.00% 09/10/2026	114.488	0,11	USD	80.000	Asian Development Bank 0.75% 08/10/2030	61.561	0,06
EUR	318.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2030	266.519	0,26	USD	25.000	European Investment Bank 0.63% 21/10/2027	21.015	0,02
EUR	16.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/05/2036	11.637	0,01	USD	25.000	European Investment Bank 1.63% 13/05/2031	20.907	0,02
Total de Alemania			392.644	0,38	EUR	8.000	European Union 0.10% 04/10/2040	4.613	0,00
ITALIA				ITALIA					
USD	200.000	Italy (Govt of) 1.25% 17/02/2026	172.353	0,17	USD	40.000	Inter-American Development Bank 1.13% 13/01/2031	31.986	0,03
EUR	30.000	Italy (Govt of) 2.45% 01/09/2033	24.231	0,02	EUR	18.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.20% 21/01/2061	7.400	0,01
EUR	61.000	Italy (Govt of) 4.00% 30/04/2035	57.197	0,06	USD	135.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 11/03/2025	123.865	0,12
Total de Italia			253.781	0,25	USD	80.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.88% 14/05/2030	63.075	0,06
JAPÓN				JAPÓN					
JPY	14.900.000	Japan (Govt of) Forty Year Bond 0.40% 20/03/2056	75.443	0,07	USD	100.000	International Bank for Reconstruction & Development 1.88% 27/10/2026	91.187	0,09
JPY	1.800.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.40% 20/03/2050	9.842	0,01	AUD	70.000	International Finance Corp. 1.50% 15/04/2035	30.091	0,03
JPY	7.600.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.60% 20/09/2050	43.496	0,04	USD	200.000	New Development Bank 0.63% 29/09/2025	176.838	0,18
JPY	5.850.000	Japan (Govt of) Twenty Year Bond 0.50% 20/12/2041	37.040	0,04	Total de supranacional			632.538	0,62
Total de Japón			165.821	0,16					

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)							
REINO UNIDO				ESTADOS UNIDOS (continuación)							
GBP	98.000	United Kingdom Gilt 0.88% 31/07/2033	78.029	0,08	USD	20.000	United States Treasury N/B 2.88% 15/05/2032	18.480	0,02		
GBP	27.000	United Kingdom Gilt 1.00% 31/01/2032	22.769	0,02	USD	364.200	United States Treasury N/B 3.00% 15/08/2052	314.293	0,31		
GBP	3.000	United Kingdom Gilt 1.13% 31/01/2039	2.142	0,00	USD	2.300.000	United States Treasury N/B 3.13% 31/08/2029	2.182.483	2,14		
GBP	1.503.679	United Kingdom Gilt 1.25% 31/07/2051	922.468	0,91	USD	43.000	United States Treasury N/B 3.25% 30/06/2029	41.095	0,04		
GBP	170.500	United Kingdom Gilt 1.75% 07/09/2037	138.908	0,14	USD	820.000	United States Treasury N/B 3.38% 15/08/2042	742.420	0,73		
Total de Reino Unido			1.164.316	1,15	Total de Estados Unidos			8.152.174	7,99		
ESTADOS UNIDOS				Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda							
USD	97.000	United States Treasury N/B 0.50% 31/10/2027	81.215	0,08	13.557.677						
USD	50.000	United States Treasury N/B 0.63% 15/08/2030	39.164	0,04	13,31						
USD	108.000	United States Treasury N/B 0.75% 31/01/2028	90.956	0,09	Renta variable						
USD	145.000	United States Treasury N/B 1.00% 31/07/2028	122.174	0,12	AUSTRALIA						
USD	508.100	United States Treasury N/B 1.13% 15/08/2040	315.141	0,31	13.174	Australia & New Zealand Banking Group Limited	193.121	0,19			
USD	78.000	United States Treasury N/B 1.25% 15/05/2050	43.802	0,04	2.150	Carsales.Com Limited	26.002	0,03			
USD	122.000	United States Treasury N/B 1.38% 15/11/2040	78.928	0,08	16.361	Coles Group Limited	172.832	0,17			
USD	144.700	United States Treasury N/B 1.38% 15/08/2050	84.062	0,08	61.603	Deterra Royalties Limited	158.431	0,16			
USD	931.300	United States Treasury N/B 1.88% 15/02/2032	788.767	0,77	25.337	Dexus Property Group	125.762	0,12			
USD	78.600	United States Treasury N/B 1.88% 15/02/2051	52.165	0,05	17.198	Graincorp Limited	86.248	0,08			
USD	3.000	United States Treasury N/B 1.88% 15/11/2051	1.989	0,00	2.030	Macquarie Group Limited	199.354	0,20			
USD	21.000	United States Treasury N/B 2.00% 15/02/2050	14.472	0,01	6.492	Oz Minerals Limited	107.607	0,11			
USD	370.000	United States Treasury N/B 2.38% 31/01/2023	368.497	0,36	23.269	Santos Limited	106.072	0,10			
USD	460.000	United States Treasury N/B 2.38% 31/03/2029	416.516	0,41	32.395	Transurban Group	257.022	0,25			
USD	260.000	United States Treasury N/B 2.50% 31/03/2027	242.958	0,24	Total de Australia			1.432.451	1,41		
USD	2.300.000	United States Treasury N/B 2.75% 15/08/2032	2.102.703	2,06	BÉLGICA						
USD	10.600	United States Treasury N/B 2.88% 30/04/2029	9.894	0,01	1.644	KBC Group NV	78.369	0,08			
								983	Melexis NV	67.410	0,07
								Total de Bélgica		145.779	0,15
								CANADÁ			
								470	Canadian National Railway Company	51.028	0,05
								1.662	Suncor Energy Inc.	47.052	0,05
								Total de Canadá		98.080	0,10
								ISLAS CAIMÁN			
								39.000	China Mengniu Dairy Company Limited	154.760	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)			
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)			
ISLAS CAIMÁN (continuación)				ALEMANIA (continuación)			
60.000	China Resources Land Limited	236.181	0,23	712	Daimler Truck Holding AG	16.287	0,02
8.300	JD.com Inc.	209.987	0,21	6.471	Deutsche Telekom AG - Reg	110.887	0,11
13.855	NetEase Inc.	209.151	0,21	395	Dr Ing hc F Porsche AG	31.924	0,03
400	Netease.com - ADR	30.240	0,03	2.780	E.ON SE	21.504	0,02
	Total de Islas Caimán	840.319	0,83	1.038	Evonik Industries AG	17.541	0,02
				647	Mercedes-Benz Group AG - Reg	33.181	0,03
CHINA				836	SAP SE	68.893	0,07
127.200	Baoshan Iron & Steel Company Limited - A	93.850	0,09	1.457	Siemens AG - Reg	144.448	0,14
281.000	China Construction Bank Corp.	162.517	0,16	1.299	Siemens Healthineers AG	56.349	0,06
25.500	China Merchants Bank Company Limited - H	118.568	0,12		Total de Alemania	596.530	0,59
30.100	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	139.245	0,14	HONG KONG			
39.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	194.754	0,19	38.600	AIA Group Limited	321.834	0,32
4.700	Wuliangye Yibin Company Limited - A	111.567	0,11	57.500	Boc Hong Kong Holdings Limited	191.547	0,19
	Total de China	820.501	0,81	34.000	Galaxy Entertainment Group Limited	200.970	0,20
DINAMARCA				3.800	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	130.509	0,13
4.661	Tryg A/S	96.353	0,09	20.000	Sun Hung Kai Properties Limited	221.276	0,22
	Total de Dinamarca	96.353	0,09	62.000	Xinyi Glass Holdings Limited	90.198	0,09
FINLANDIA					Total de Hong Kong	1.156.334	1,15
1.664	Upm-Kymmene Oyj	53.110	0,05	INDIA			
	Total de Finlandia	53.110	0,05	45.909	Embassy Office Parks REIT	195.162	0,19
FRANCIA				9.393	HDFC Bank Limited	164.107	0,16
742	Air Liquide SA	85.454	0,08	20.664	Hindalco Industries Limited	99.200	0,10
5.614	AXA SA	123.607	0,12	8.330	Tech Mahindra Limited	103.273	0,10
1.781	BNP Paribas	76.080	0,07		Total de India	561.742	0,55
901	Compagnie de Saint-Gobain	32.703	0,03	INDONESIA			
730	Edenred	33.869	0,03	751.321	Bank Rakyat Indonesia	221.533	0,22
227	Louis Vuitton Moët Hennessy SE	135.741	0,13	713.200	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	208.888	0,21
628	Pernod-Ricard SA	116.184	0,11		Total de Indonesia	430.421	0,43
1.327	Sanofi	101.920	0,10	IRLANDA			
990	Schneider Electric SE	113.415	0,11	10.680	Bank of Ireland Group plc	68.907	0,07
3.580	TotalEnergies SE	169.308	0,17	3.241	CRH plc	104.998	0,11
1.270	Vinci SA	103.476	0,10	5.566	Eaton Corp. plc	742.282	0,73
	Total de Francia	1.091.757	1,05	1.908	Experian plc	56.677	0,06
ALEMANIA				161	Linde plc	43.404	0,04
1.563	Brenntag AG	95.516	0,09	588	Medtronic Inc.	47.481	0,05

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)			
IRLANDA (continuación)				REPÚBLICA DE COREA (SUR) (continuación)			
3.150	Trinseo plc	57.708	0,06	4.992	SK Telecom Company Limited	177.252	0,17
	Total de Irlanda	1.121.457	1,12		Total de República de Corea (Sur)	1.025.698	1,01
ISLA DE MAN				SINGAPUR			
35.942	Strix Group plc	49.350	0,05	108.300	Capitamall Trust	144.913	0,14
	Total de Isla de Man	49.350	0,05	8.800	Jardine Cycle & Carriage Limited	207.229	0,20
ITALIA				57.900	Keppel Corp. Limited	280.441	0,28
16.216	Enel SpA	67.102	0,07	12.200	United Overseas Bank Limited	222.421	0,22
9.279	Nexi SpA	75.830	0,07		Total de Singapur	855.004	0,84
	Total de Italia	142.932	0,14	ESPAÑA			
JAPÓN				8.447	Iberdrola SA	79.292	0,08
500	Rohm Company Limited	32.678	0,03	6.329	Inditex SA	131.940	0,13
100	Tokyo Electron Limited	24.664	0,02		Total de España	211.232	0,21
10.400	Z Holdings Corp.	27.318	0,03	SUECIA			
	Total de Japón	84.660	0,08	2.789	Atlas Copco AB	23.438	0,02
JERSEY - ISLAS DEL CANAL				4.649	Sandvik AB	63.906	0,06
9.187	WPP plc	76.916	0,08		Total de Suecia	87.344	0,08
	Total de Jersey - Islas del Canal	76.916	0,08	SUIZA			
PAÍSES BAJOS				467	Nestle SA - Reg	50.807	0,05
483	Akzo Nobel NV	27.595	0,03	503	Novartis AG - Reg	38.600	0,04
433	ASM International NV	99.154	0,10	99	Partners Group Holding AG - Reg	80.930	0,08
678	BE Semiconductor Industries	29.617	0,03	3.430	TE Connectivity Limited	378.534	0,37
530	Koninklijke DSM NV	60.982	0,06		Total de Suiza	548.871	0,54
604	Relx plc	14.828	0,01	TAIWÁN			
	Total de Países Bajos	232.176	0,23	27.850	Chailease Holding Company Limited	160.087	0,16
NORUEGA				34.000	Chroma ATE Inc.	192.762	0,19
1.315	Equinor ASA	43.213	0,04	151.000	CTBC Financial Holding Company Limited	94.408	0,09
	Total de Noruega	43.213	0,04	5.000	MediaTek Inc.	86.774	0,09
REPÚBLICA DE COREA (SUR)				51.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	677.878	0,67
10.623	Hanon Systems	61.776	0,06		Total de Taiwán	1.211.909	1,20
4.139	KB Financial Group Inc.	126.424	0,12	TAILANDIA			
2.768	Kia Corp.	139.107	0,14	11.100	PTT Exploration & Production plc	47.231	0,05
5.511	Kt Corp.	139.441	0,14				
1.572	Samsung Electronics Company Limited	58.344	0,06				
9.864	Samsung Electronics Company Limited Pfd	323.354	0,32				

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)			
TAILANDIA (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
476.800	Thai Beverage plc	199.373	0,20	4.596	DuPont de Nemours Inc.	231.638	0,23
97.905	Thai Oil plc	133.022	0,13	8.137	Ebay Inc.	299.523	0,29
	Total de Tailandia	379.626	0,38	4.233	Edison International	239.503	0,24
				120	Elevance Health Inc.	54.509	0,06
REINO UNIDO				3.545	Eli Lilly & Company	1.146.275	1,12
11.082	3i Group plc	135.213	0,13	5.275	Equity Lifestyle Properties Inc.	331.481	0,33
7.261	Allfunds Group plc	53.883	0,05	5.302	Exxon Mobil Corp.	462.918	0,45
4.259	Anglo American plc	130.054	0,12	448	Fidelity National Information Services Inc.	33.855	0,03
752	Astrazeneca plc	83.476	0,08	1.553	General Motors Company	49.836	0,05
23.634	BT Group plc	32.015	0,03	3.135	Home Depot Inc.	865.072	0,85
760	Diageo plc	32.218	0,03	162	IBM Corp.	19.247	0,02
9.982	Easyjet plc	33.028	0,03	676	IntercontinentalExchange Inc.	61.077	0,06
1.960	GSK Plc	28.570	0,03	5.406	Johnson & Johnson	883.123	0,86
4.122	Haleon plc	12.849	0,01	2.515	JPMorgan Chase & Company	262.818	0,26
8.174	lbstock plc	14.983	0,01	2.439	KLA Corp.	738.115	0,71
390	London Stock Exchange Group plc	33.209	0,03	7.747	Kontoor Brands Inc.	260.377	0,26
1.673	Persimmon plc	23.111	0,02	4.095	Lamb Weston Holding Inc.	316.871	0,31
1.978	Reckitt Benckiser Group plc	131.953	0,13	233	Marsh & McLennan Companies Inc.	34.785	0,03
2.696	SSE plc	45.971	0,05	901	Mastercard Inc. - A	256.190	0,25
6.204	St James's Place plc	71.748	0,07	194	McDonald's Corp.	44.764	0,04
1.435.982	Supermarket Income Reit plc	1.715.196	1,68	7.750	Merck & Company Inc.	667.430	0,66
1.100.000	Target Healthcare REIT plc	1.123.556	1,10	9.065	Metlife Inc.	550.970	0,55
49.606	Vodafone Group plc	55.995	0,05	7.486	Microsoft Corp.	1.743.490	1,71
	Total de Reino Unido	3.757.028	3,65	5.514	Moelis & Company - A	186.428	0,18
				6.878	Morgan Stanley	543.431	0,52
ESTADOS UNIDOS				4.447	NextEra Energy Inc.	348.689	0,34
149	AbbVie Inc.	19.997	0,02	3.537	Northern Trust Corp.	302.626	0,29
6.595	American Electric Power Company Inc.	570.139	0,55	21.174	Nortonlifelock Inc.	426.444	0,41
84	American Tower Corp.	18.035	0,02	4.961	PepsiCo Inc.	809.933	0,80
258	Analog Devices Inc.	35.950	0,04	8.480	Philip Morris International Inc.	703.925	0,69
2.768	Apple Inc.	382.538	0,38	339	PNC Financial Services Group Inc.	50.653	0,05
11.856	AT&T Inc.	181.871	0,18	6.403	Procter & Gamble Company	808.379	0,80
2.555	Automatic Data Processing Inc.	577.916	0,58	5.527	Prologis Inc.	561.543	0,55
578	BlackRock Inc.	318.062	0,32	174	Qualcomm Inc.	19.659	0,02
9.178	Bristol-Myers Squibb Company	652.464	0,64	361	Quest Diagnostics Inc.	44.291	0,04
1.750	Broadcom Inc.	777.018	0,75	6.738	Raytheon Technologies Corp.	551.573	0,54
3.207	Caterpillar Inc.	526.205	0,52	887	SBA Communications	252.485	0,25
12.887	Cisco Systems Inc.	515.480	0,51	5.463	Starbucks Corp.	460.312	0,45
2.234	CME Group Inc.	395.708	0,40	1.022	State Street Corp.	62.148	0,06
758	Coca Cola Company	42.463	0,04	9.504	Store Capital Corp.	297.760	0,29
13.161	Comcast Corp.	386.012	0,38	2.986	Target Corp.	443.093	0,43
13.844	Conocophillips	1.416.794	1,40	3.503	Texas Instruments Inc.	542.194	0,53
348	Crown Castle International Corp.	50.303	0,05	7.304	Tjx Companies Inc.	453.724	0,45
4.662	Darling Ingredients Inc.	308.391	0,30	10.510	Truist Financial Corp.	457.606	0,44
				3.342	Union Pacific Corp.	651.088	0,64

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 negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)							
Renta variable (continuación)				Bonos (continuación)							
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)							
4.276	United Parcel Service Inc.	690.745	0,68	USD	75.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.27% 15/05/2047	61.254	0,06			
3.476	Valero Energy Corp.	371.411	0,36	USD	30.000	Verizon Communications Inc. 2.36% 15/03/2032	23.166	0,02			
12.100	Verizon Communications Inc.	459.438	0,45	USD	119.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	86.739	0,09			
3.118	Virtu Financial Inc.	64.761	0,06	USD	50.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.39% 15/03/2062	36.358	0,04			
4.237	Voya Financial Inc.	256.339	0,25								
2.867	Warner Bros Discovery Inc.	32.971	0,03								
53	WW Grainger Inc.	25.927	0,03								
6.820	Xcel Energy Inc.	436.480	0,43								
	Total de Estados Unidos	28.045.269	27,51			Total de Estados Unidos	506.613	0,52			
	Total de renta variable	45.196.062	44,37			Total de bonos	646.670	0,65			
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	93.333.837	91,61			Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					
	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente					CHINA					
	Bonos					CNY	470.000	China (Govt of) 2.85% 04/06/2027	66.824	0,07	
	AUSTRALIA					CNY	2.550.000	China (Govt of) 3.02% 27/05/2031	365.020	0,36	
USD	137.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	125.243	0,12			Total de China	431.844	0,43		
	Total de Australia	125.243	0,12			ESTADOS UNIDOS					
	PAÍSES BAJOS					USD	139.000	Federal National Mortgage Association 5.63% 15/07/2037	155.408	0,15	
USD	15.000	E.ON International Finance BV 6.65% 30/04/2038	14.814	0,01			Total de Estados Unidos	155.408	0,15		
	Total de Países Bajos	14.814	0,01			Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda	587.252	0,58			
	ESTADOS UNIDOS					Bonos - convertibles					
USD	48.000	Atlantic City Electric 2.30% 15/03/2031	39.050	0,04			CANADÁ				
USD	67.000	Broadcom Inc. 4.93% 15/05/2037	55.668	0,05			USD	129.000	Air Canada 4.00% 01/07/2025	136.340	0,13
USD	119.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	98.244	0,10			Total de Canadá	136.340	0,13		
USD	34.000	HCA Inc. 3.63% 15/03/2032	27.542	0,03			Total de bonos - convertibles	136.340	0,13		
USD	8.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.63% 30/09/2059	5.487	0,01			Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente	1.370.262	1,36		
USD	45.000	Occidental Petroleum Corp. 6.95% 01/07/2024	46.266	0,05							
USD	25.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	26.839	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*		
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
AUSTRALIA				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	35.000	APA Infrastructure Limited 4.25% 15/07/2027	32.457	0,03	USD	25.000	Guardian Life Insurance Company of America 4.85% 24/01/2077	20.559	0,02
Total de Australia			32.457	0,03	USD	47.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	37.301	0,04
BERMUDAS				USD	35.000	Metropolitan Edison Company 4.30% 15/01/2029	32.714	0,03	
USD	100.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	93.350	0,09	USD	156.000	Metropolitan Life Global Funding I 1.55% 07/01/2031	117.582	0,12
Total de Bermudas			93.350	0,09	USD	17.000	New York Life Insurance Company 4.45% 04/04/2069	13.713	0,01
CANADÁ				USD	86.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.45% 30/03/2051	59.651	0,06	
CAD	50.000	Rogers Communications Inc. 3.65% 31/03/2027	34.041	0,03	USD	18.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.85% 30/09/2047	13.637	0,01
Total de Canadá			34.041	0,03	USD	11.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.90% 15/09/2044	9.739	0,01
GIBRALTAR				Total de Estados Unidos					
EUR	130.000	888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027	107.376	0,11	372.845			0,37	
Total de Gibraltar			107.376	0,11	Total de bonos				
PORTUGAL				1.203.018					
EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	8.817	0,01	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				
Total de Portugal			8.817	0,01	1.203.018				
REINO UNIDO				Otros organismos de inversión colectiva					
EUR	100.000	BCP V Modular Services Finance II plc 6.75% 30/11/2029	68.404	0,07	Fondos				
GBP	135.000	Bellis Acquisition Company 3.25% 16/02/2026	114.086	0,11	REINO UNIDO				
GBP	205.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	197.018	0,19	USD	66.280	CT Emerging Market Local Fund***	162.699	0,16
GBP	100.000	Pinewood Finance Company Limited 3.63% 15/11/2027	90.403	0,09	Total de Reino Unido			162.699	0,16
GBP	100.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	84.221	0,08	Total de fondos				
Total de Reino Unido			554.132	0,54	162.699				0,16
ESTADOS UNIDOS				Total de otros organismos de inversión colectiva					
USD	21.000	American Transmission Systems Inc. 2.65% 15/01/2032	16.500	0,02	Valor total de las inversiones				
USD	45.000	Broadcom Inc. 2.45% 15/02/2031	33.988	0,03	96.069.816				
USD	19.000	Goodman US Finance Five LLC 4.63% 04/05/2032	17.461	0,02	(Coste total: 112.638.461 USD)				

* Diferencias menores debido al redondeo.

** Título a su valor razonable.

*** Fondo de parte vinculada.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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				CHIPRE			
20.622	Azul SA	56.122	1,23	1.129	Ozon Holdings plc**	0	0,00
37.567	B3 SA Brasil Bolsa Balcao	90.638	1,98	545	Tcs Group Holding plc - Reg**	0	0,00
22.888	Itau Unibanco Holding SA - ADR	118.331	2,59	Total de Chipre			
11.131	Localiza Rent a Car	125.718	2,75	0			
1.396	Weg SA	8.295	0,18	0,00			
Total de Brasil		399.104	8,73	HONG KONG			
ISLAS CAIMÁN				INDIA			
2.281	Afya Limited	30.930	0,68	2.063	Apollo Hospitals Enterprise Limited	111.156	2,43
4.800	Alibaba Group Holding Limited	47.664	1,04	530	Bajaj Finance Limited	47.791	1,05
1.363	Dlocal Limited	27.969	0,61	1.910	HDFC Bank Limited - ADR	111.582	2,44
2.764	JD.com Inc. - ADR	139.029	3,04	3.526	Hdfc Standard Life Insurance	22.991	0,50
3.636	JD.com Inc.	91.990	2,01	4.399	ICICI Bank Limited - ADR	92.247	2,02
1.946	KE Holdings Inc.	34.094	0,75	4.701	Infosys Technologies Limited - ADR	79.776	1,74
10.088	Kingdee International Software Group Company Limited	13.211	0,29	2.697	Reliance Industries Limited	78.826	1,72
10.900	Meituan Inc.	229.944	5,03	Total de India			
6.221	NU Holdings Limited	27.372	0,60	544.369			
3.731	Pagseguro Digital Limited	49.361	1,08	11,90			
323	Sea Limited	18.104	0,40	INDONESIA			
3.900	Shenzhen International Group Holdings Limited	30.480	0,67	286.200	Bank Central Asia Tbk Pt	160.695	3,52
7.100	Tencent Holdings Limited	240.951	5,28	781.536	Bank Rakyat Indonesia	230.443	5,04
12.500	Wuxi Biologics Cayman Inc.	75.479	1,65	66.900	Bank Tabungan Pensiunan Nasional Syariah Tbk Pt	11.994	0,26
2.583	Xp Inc. - A	49.103	1,07	Total de Indonesia			
Total de Islas Caimán		1.105.681	24,20	403.132			
CHINA				8,82			
1.138	Bafang Electric Suzhou Company Limited	18.750	0,41	KAZAJISTÁN			
551	Beijing Kingsoft Office Software Inc.	15.543	0,34	625	JSC Kaspi.kz.	36.250	0,79
800	Contemporary Amperex Technology Company Limited - A	44.986	0,98	Total de Kazajistán			
15.200	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	70.316	1,54	36.250			
11.300	Midea Group Company Limited - A	78.158	1,71	0,79			
2.400	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited	100.657	2,20	LUXEMBURGO			
5.940	WuXi AppTec Company Limited - H	48.012	1,05	424	Globant SA	79.322	1,74
Total de China		376.422	8,23	Total de Luxemburgo			
				79.322			
				1,74			
				MÉXICO			
				10.905	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	70.135	1,53

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			
MÉXICO (continuación)				BRASIL			
21.245	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	74.837	1,64	34	Localiza Rent A Car SA Right	69	0,00
Total de México		144.972	3,17	Total de Brasil		69	0,00
REPÚBLICA DE COREA (SUR)				Total de derechos			
1.291	Hana Financial Group Inc.	31.989	0,70	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
64	Samsung Biologics Company Limited	36.100	0,79	4.447.498 97,32			
602	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	47.127	1,03	Valor total de las inversiones			
5.697	Samsung Electronics Company Limited	211.443	4,63	4.447.498 97,32			
189	Samsung Sdi Company Limited	72.128	1,58	(Coste total: 6.154.943 USD)			
1.440	SK hynix Inc.	83.640	1,83	<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>			
Total de República de Corea (Sur)		482.427	10,56	<i>** Título a su valor razonable.</i>			
SUDÁFRICA							
807	Capitec Bank Holdings Limited	69.733	1,53				
Total de Sudáfrica		69.733	1,53				
TAIWÁN							
7.000	Delta Electronics Inc.	55.781	1,22				
2.000	MediaTek Inc.	34.710	0,76				
4.953	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited - ADR	339.578	7,43				
Total de Taiwán		430.069	9,41				
TAILANDIA							
12.200	Kasikornbank pcl	46.575	1,02				
67.300	Muangthai Capital pcl	64.677	1,42				
Total de Tailandia		111.252	2,44				
ESTADOS UNIDOS							
126	Mercadolibre Inc.	104.300	2,28				
Total de Estados Unidos		104.300	2,28				
ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)							
12.165	Fix Price Group Limited**	0	0,00				
Total de Islas Virgenes (Británicas)		0	0				
Total de renta variable		4.447.429	97,32				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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 (continuación)			
124.419	DSV A/S	14.687.860	0,88	334.636	Nestle SA - Reg	36.406.220	2,18
363.516	Novo-Nordisk A/S	36.467.015	2,18		Total de Suiza	89.700.350	5,37
904.064	Tryg A/S	18.688.994	1,12				
	Total de Dinamarca	69.843.869	4,18				
FRANCIA				TAIWÁN			
137.022	L'Oreal SA	44.330.647	2,65	2.727.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	36.246.559	2,17
73.689	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	44.064.427	2,63		Total de Taiwán	36.246.559	2,17
107.724	Pernod-Ricard SA	19.929.684	1,19				
175.934	Schneider Electric SE	20.155.047	1,21				
	Total de Francia	128.479.805	7,68	REINO UNIDO			
HONG KONG				387.828	Anglo American plc	11.842.866	0,71
1.197.500	Techtronic Industries Company	11.570.881	0,69	251.592	Linde plc	68.815.012	4,11
	Total de Hong Kong	11.570.881	0,69	378.025	Reckitt Benckiser Group plc	25.218.081	1,51
INDIA				955.792	SSE plc	16.297.671	0,97
1.605.967	ICICI Bank Limited	17.016.351	1,02		Total de Reino Unido	122.173.630	7,30
1.111.107	Kotak Mahindra Bank Limited	24.846.137	1,49	ESTADOS UNIDOS			
	Total de India	41.862.488	2,51	421.705	Advanced Micro Devices Inc.	26.719.229	1,60
INDONESIA				599.783	Alphabet Inc. - A	57.369.244	3,43
19.571.300	Bank Central Asia Tbk Pt	10.988.864	0,66	512.633	Amazon.com Inc.	57.927.529	3,46
	Total de Indonesia	10.988.864	0,66	185.078	American Electric Power Company Inc.	15.999.993	0,96
IRLANDA				48.557	Cintas Corp.	18.849.342	1,13
175.161	Trane Technologies plc	25.365.064	1,52	658.735	Coca Cola Company	36.902.334	2,21
	Total de Irlanda	25.365.064	1,52	510.568	Conocophillips	52.251.529	3,12
JAPÓN				202.688	Edwards Lifesciences Corp.	16.748.109	1,00
132.512	Keyence Corp.	43.851.763	2,62	88.722	Elevance Health Inc.	40.301.081	2,41
1.189.000	Recruit Holdings Company Limited	34.180.303	2,04	150.206	Eli Lilly & Company	48.569.110	2,90
	Total de Japón	78.032.066	4,66	169.066	Hilton Worldwide Holdings Inc.	20.392.741	1,22
SINGAPUR				331.602	IntercontinentalExchange Inc.	29.960.240	1,79
1.133.400	DBS Group Holdings Limited	26.374.134	1,57	212.248	Intuit Inc.	82.207.895	4,92
	Total de Singapur	26.374.134	1,57	136.581	Lam Research Corp.	49.988.645	2,99
SUIZA				209.691	Marsh & McLennan Companies Inc.	31.304.770	1,87
107.865	Lonza Group AG - Reg	53.294.130	3,19	318.656	Mastercard Inc. - A	90.606.647	5,42
				582.200	Microsoft Corp.	135.594.379	8,10
				299.414	Nutrien Limited	24.965.139	1,49
				139.325	Nvidia Corp.	16.912.662	1,01
				161.664	Qualcomm Inc.	18.264.799	1,09
				54.373	S&P Global Inc.	16.602.796	0,99
				95.597	Stryker Corp.	19.362.217	1,16
				140.034	Thermo Fisher Scientific Inc.	71.023.844	4,25
				266.351	T-Mobile USA Inc.	35.736.314	2,14

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)			
81.408	Union Pacific Corp.	15.859.907	0,95
	Total de Estados Unidos	1.030.420.495	61,61
	Total de renta variable	1.671.058.205	99,92
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	1.671.058.205	99,92
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
16.653.234	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	16.653.234	1,00
	Total de Irlanda	16.653.234	1,00
	Total de fondos	16.653.234	1,00
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	16.653.234	1,00
	Valor total de las inversiones	1.687.711.439	100,92

(Coste total: 1.836.894.097 USD)

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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)			
1.152.633	Azul SA	3.136.848	1,07	95.800	China International Travel Service Corp. Limited - A	2.664.038	0,91
1.794.079	B3 SA Brasil Bolsa Balcao	4.328.592	1,48	29.900	Contemporary Amperex Technology Company Limited - A	1.681.350	0,57
498.792	Banco BTG Pactual SA	2.287.920	0,78	689.700	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	3.190.602	1,09
1.023.543	Itau Unibanco Holding SA - ADR	5.291.717	1,81	490.000	Midea Group Company Limited - A	3.389.166	1,16
494.112	Localiza Rent a Car	5.580.719	1,91	104.400	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited	4.378.581	1,50
1.140.249	Petro Rio SA	5.803.641	1,99	58.000	Silergy Corp.	769.094	0,26
95.081	Weg SA	564.982	0,19	228.432	WuXi AppTec Company Limited - H	1.846.392	0,63
	Total de Brasil	26.994.419	9,23	141.200	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	487.227	0,17
CANADÁ				Total de China			
105.390	Parex Resources Inc.	1.547.045	0,53			20.111.388	6,88
	Total de Canadá	1.547.045	0,53	CHIPRE			
ISLAS CAIMÁN				31.029	Ozon Holdings plc**	0	0,00
55.606	Afya Limited	754.017	0,26	12.232	Tcs Group Holding plc - Reg**	0	0,00
72.602	Dlocal Limited	1.489.793	0,51	Total de Chipre			
254.265	Full Truck Alliance Company Limited	1.665.436	0,57			0	0,00
167.331	JD.com Inc. - ADR	8.416.749	2,88	HONG KONG			
111.157	JD.com Inc.	2.812.234	0,96	341.600	AIA Group Limited	2.848.150	0,97
129.776	KE Holdings Inc.	2.273.676	0,78	62.800	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	2.156.825	0,74
788.000	Kingdee International Software Group Company Limited	1.031.941	0,35	206.000	Techtronic Industries Company	1.990.481	0,68
483.500	Kuaishou Technology	3.138.167	1,07	Total de Hong Kong			
616.000	Li Ning Company Limited	4.716.181	1,61			6.995.456	2,39
629.900	Meituan Inc.	13.288.234	4,54	INDIA			
85.100	NetEase Inc.	1.284.645	0,44	88.534	Apollo Hospitals Enterprise Limited	4.770.278	1,63
50.774	Netease.com - ADR	3.838.514	1,31	22.408	Bajaj Finance Limited	2.020.553	0,69
378.515	NU Holdings Limited	1.665.466	0,57	114.385	Balkrishna Industries Limited	2.648.450	0,91
177.708	Pagseguro Digital Limited	2.351.077	0,80	453.019	Cholamandalam Investment and Finance Company Limited	4.077.262	1,39
59.125	Pinduoduo Inc.	3.700.043	1,26	73.553	Eicher Motors Limited	3.319.543	1,13
19.497	Sea Limited	1.092.807	0,37	102.143	HDFC Bank Limited - ADR	5.967.194	2,04
313.600	Shenzhou International Group Holdings Limited	2.450.902	0,84	223.052	Hdfc Standard Life Insurance	1.454.364	0,50
392.600	Tencent Holdings Limited	13.323.546	4,55	427.851	ICICI Bank Limited - ADR	8.972.035	3,07
687.500	Wuxi Biologics Cayman Inc.	4.151.322	1,42	163.968	Infosys Technologies Limited - ADR	2.782.537	0,95
146.566	Xp Inc. - A	2.786.220	0,95	170.625	Reliance Industries Limited	4.986.909	1,70
	Total de Islas Caimán	76.230.970	26,04	Total de India			
CHINA						40.999.125	14,01
47.383	Bafang Electric Suzhou Company Limited	780.682	0,27				
32.764	Beijing Kingsoft Office Software Inc.	924.256	0,32				

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				REPÚBLICA DE COREA (SUR) (continuación)			
7.524.000	Astra International Tbk Pt	3.273.420	1,12	38.613	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	3.022.762	1,03
17.390.500	Bank Central Asia Tbk Pt	9.764.392	3,33	343.457	Samsung Electronics Company Limited	12.747.330	4,36
37.056.466	Bank Rakyat Indonesia	10.926.407	3,72	7.720	Samsung Sdi Company Limited	2.946.200	1,01
14.153.500	Bank Tabungan Pensiunan Nasional Syariah Tbk Pt	2.537.427	0,87	89.680	SK hynix Inc.	5.208.935	1,78
	Total de Indonesia	26.501.646	9,04		Total de República de Corea (Sur)	27.493.961	9,40
KAZAJISTÁN				SUDÁFRICA			
19.671	JSC Kaspi.kz.	1.140.918	0,39	29.987	Capitec Bank Holdings Limited	2.591.191	0,89
	Total de Kazajistán	1.140.918	0,39		Total de Sudáfrica	2.591.191	0,89
LUXEMBURGO				TAIWÁN			
26.793	Globant SA	5.012.434	1,72	56.000	Asmedia Technology Inc.	1.171.184	0,40
	Total de Luxemburgo	5.012.434	1,72	116.000	MediaTek Inc.	2.013.162	0,69
MALASIA				TAILANDIA			
1.129.400	Public Bank Bhd	1.030.272	0,35	307.683	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited - ADR	21.094.747	7,21
	Total de Malasia	1.030.272	0,35	519.493	Unimicron Technology Corp.	1.922.590	0,66
MÉXICO				ESTADOS UNIDOS			
570.521	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	3.669.290	1,25	149.922	Coupang Inc.	2.499.200	0,85
1.005.258	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	3.541.110	1,21	8.371	Mercadolibre Inc.	6.929.346	2,37
	Total de México	7.210.400	2,46		Total de Estados Unidos	9.428.546	3,22
PAÍSES BAJOS				ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)			
33.179	Yandex NV - A**	0	0,00	223.974	Fix Price Group Limited**	0	0,00
	Total de Países Bajos	0	0,00		Total de Islas Vírgenes (Británicas)	0	0,00
FILIPINAS				Total de renta variable			
2.174.600	Ayala Land Inc.	847.605	0,29			288.225.383	98,51
	Total de Filipinas	847.605	0,29				
POLONIA							
34.230	Dino Polska SA	2.093.026	0,72				
	Total de Polonia	2.093.026	0,72				
REPÚBLICA DE COREA (SUR)							
82.518	Hana Financial Group Inc.	2.044.642	0,70				
2.702	Samsung Biologics Company Limited	1.524.092	0,52				

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			
BRASIL			
1.515	Localiza Rent A Car SA Right	3.081	0,00
	Total de Brasil	3.081	0,00
	Total de derechos	3.081	0,00
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	288.228.464	98,51
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	288.228.464	98,51
(Coste total: 347.282.225 USD)			

* Diferencias menores debido al redondeo.

** Título a su valor razonable.

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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				IRLANDA			
114.507	Carsales.Com Limited	1.384.835	0,95	36.091	CRH plc	1.169.241	0,81
Total de Australia		1.384.835	0,95	100.895	Experian plc	2.997.060	2,06
CANADÁ				8.544	Linde plc	2.303.377	1,59
23.861	Canadian National Railway Company	2.590.580	1,79	30.886	Medtronic Inc.	2.494.045	1,72
87.953	Suncor Energy Inc.	2.489.992	1,72	Total de Irlanda		8.963.723	6,18
Total de Canadá		5.080.572	3,51	JAPÓN			
ISLAS CAIMÁN				25.500	Rohm Company Limited	1.666.586	1,15
20.487	Netease.com - ADR	1.548.817	1,07	2.700	Tokyo Electron Limited	665.930	0,46
Total de Islas Caimán		1.548.817	1,07	543.400	Z Holdings Corp.	1.427.342	0,98
CHINA				Total de Japón		3.759.858	2,59
363.792	Ping An Insurance Group Company of China Limited	1.816.664	1,25	PAÍSES BAJOS			
Total de China		1.816.664	1,25	25.285	Akzo Nobel NV	1.444.613	0,99
DINAMARCA				31.051	Relx plc	762.303	0,53
101.302	Tryg A/S	2.094.135	1,45	Total de Países Bajos		2.206.916	1,52
Total de Dinamarca		2.094.135	1,45	NORUEGA			
FRANCIA				56.796	Equinor ASA	1.866.396	1,29
35.394	BNP Paribas	1.511.948	1,04	Total de Noruega		1.866.396	1,29
2.971	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	1.776.594	1,22	REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
9.562	Schneider Electric SE	1.095.425	0,76	86.399	Samsung Electronics Company Limited	3.206.680	2,20
58.179	TotalEnergies SE	2.751.437	1,89	Total de República de Corea (Sur)		3.206.680	2,20
Total de Francia		7.135.404	4,91	ESPAÑA			
ALEMANIA				88.332	Inditex SA	1.841.453	1,27
157.154	Deutsche Telekom AG - Reg	2.692.996	1,85	Total de España		1.841.453	1,27
154.260	E.ON SE	1.193.250	0,82	SUECIA			
57.307	Evonik Industries AG	968.429	0,67	53.065	Sandvik AB	729.446	0,50
21.770	SAP SE	1.794.026	1,24	Total de Suecia		729.446	0,50
29.367	Siemens AG - Reg	2.911.461	2,01	SUIZA			
Total de Alemania		9.560.162	6,59	26.455	Novartis AG - Reg	2.030.120	1,40
HONG KONG				Total de Suiza		2.030.120	1,40
247.400	AIA Group Limited	2.062.741	1,42	TAIWÁN			
39.900	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	1.370.339	0,94	51.000	MediaTek Inc.	885.097	0,61
Total de Hong Kong		3.433.080	2,36				

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)			
TAIWÁN (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
194.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	2.578.596	1,77	47.818	Truist Financial Corp.	2.081.996	1,44
				9.532	United Parcel Service Inc.	1.539.799	1,06
				13.491	Valero Energy Corp.	1.441.513	0,99
				2.828	WW Grainger Inc.	1.383.429	0,95
				47.284	Xcel Energy Inc.	3.026.176	2,09
	Total de Taiwán	3.463.693	2,38		Total de Estados Unidos	68.476.367	47,22
REINO UNIDO				Total de renta variable			
111.793	3i Group plc	1.364.004	0,94			141.664.967	97,65
102.288	Anglo American plc	3.123.506	2,15	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
1.251.097	BT Group plc	1.694.774	1,17			141.664.967	97,65
38.991	Diageo plc	1.652.887	1,14	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
111.543	GSK Plc	1.625.923	1,12	Fondos			
227.550	Haleon plc	709.334	0,49	IRLANDA			
43.415	Reckitt Benckiser Group plc	2.896.218	2,00	1.262.252	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	1.262.252	0,87
	Total de Reino Unido	13.066.646	9,01		Total de Irlanda	1.262.252	0,87
ESTADOS UNIDOS				Total de fondos			
7.644	AbbVie Inc.	1.025.901	0,71	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
33.296	American Electric Power Company Inc.	2.878.439	1,98			1.262.252	0,87
4.585	American Tower Corp.	984.400	0,68	Valor total de las inversiones			
13.590	Analog Devices Inc.	1.893.631	1,31			142.927.219	98,52
5.109	Automatic Data Processing Inc.	1.155.605	0,80	(Coste total: 164.985.198 USD)			
43.602	Bristol-Myers Squibb Company	3.099.666	2,14	<i>*Diferencias menores debido al redondeo.</i>			
39.764	Coca Cola Company	2.227.579	1,54				
18.041	Crown Castle International Corp.	2.607.826	1,80				
49.801	Ebay Inc.	1.833.175	1,27				
6.301	Elevance Health Inc.	2.862.166	1,97				
10.547	Eli Lilly & Company	3.410.373	2,34				
24.425	Fidelity National Information Services Inc.	1.845.797	1,27				
81.635	General Motors Company	2.619.667	1,81				
8.536	IBM Corp.	1.014.162	0,70				
35.525	IntercontinentalExchange Inc.	3.209.684	2,21				
12.434	Marsh & McLennan Companies Inc.	1.856.272	1,28				
10.226	McDonald's Corp.	2.359.547	1,63				
27.401	Microsoft Corp.	6.381.694	4,39				
16.986	PepsiCo Inc.	2.773.134	1,91				
15.581	PNC Financial Services Group Inc.	2.328.113	1,60				
19.509	Procter & Gamble Company	2.463.012	1,70				
9.314	Qualcomm Inc.	1.052.296	0,73				
19.366	Quest Diagnostics Inc.	2.376.015	1,64				
54.189	State Street Corp.	3.295.233	2,28				
9.772	Target Corp.	1.450.067	1,00				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Select

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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				JAPÓN			
52.546	Nutrien Limited	4.405.446	0,99	15.500	Keyence Corp.	5.129.364	1,16
	Total de Canadá	4.405.446	0,99	112.400	Recruit Holdings Company Limited	3.231.174	0,73
				37.800	Sony Corp.	2.425.028	0,55
					Total de Japón	10.785.566	2,44
ISLAS CAIMÁN				PAÍSES BAJOS			
37.129	Sea Limited	2.081.080	0,47	32.091	Koninklijke DSM NV	3.692.387	0,83
	Total de Islas Caimán	2.081.080	0,47		Total de Países Bajos	3.692.387	0,83
DINAMARCA				NORUEGA			
97.994	Novo-Nordisk A/S	9.830.513	2,22	210.856	Equinor ASA	6.929.024	1,56
67.444	Orsted A/S	5.398.255	1,22		Total de Noruega	6.929.024	1,56
244.122	Tryg A/S	5.046.539	1,14				
	Total de Dinamarca	20.275.307	4,58				
FRANCIA				REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
24.908	Essilor International SA	3.424.698	0,77	162.625	Samsung Electronics Company Limited	6.035.790	1,36
15.793	L'Oreal SA	5.109.500	1,15	12.375	Samsung Sdi Company Limited	4.722.698	1,07
6.350	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	3.797.162	0,86		Total de República de Corea (Sur)	10.758.488	2,43
57.359	Schneider Electric SE	6.571.063	1,48				
241.136	TotalEnergies SE	11.403.950	2,58				
	Total de Francia	30.306.373	6,84				
ALEMANIA				SINGAPUR			
27.077	Adidas AG	3.153.409	0,71	302.100	DBS Group Holdings Limited	7.029.844	1,59
	Total de Alemania	3.153.409	0,71		Total de Singapur	7.029.844	1,59
HONG KONG				SUIZA			
419.000	AIA Group Limited	3.493.486	0,79	79.268	Nestle SA - Reg	8.623.843	1,95
	Total de Hong Kong	3.493.486	0,79	21.943	Roche Holding AG	7.211.037	1,63
					Total de Suiza	15.834.880	3,58
INDIA				TAIWÁN			
550.572	HDFC Bank Limited	9.619.173	2,16	834.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	11.085.307	2,51
	Total de India	9.619.173	2,16		Total de Taiwán	11.085.307	2,51
INDONESIA				REINO UNIDO			
24.856.074	Bank Rakyat Indonesia	7.329.020	1,66	159.380	Anglo American plc	4.866.889	1,10
	Total de Indonesia	7.329.020	1,66	146.878	Diageo plc	6.226.378	1,41
				146.090	SSE plc	2.491.051	0,56
					Total de Reino Unido	13.584.318	3,07
IRLANDA							
83.909	CRH plc	2.718.402	0,61				
39.306	Trane Technologies plc	5.691.902	1,29				
	Total de Irlanda	8.410.304	1,90				

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				IRLANDA			
49.884	Abbott Laboratories	4.826.776	1,09	3.459.276	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	3.459.276	0,78
17.660	Adobe Systems Inc.	4.860.032	1,10				
192.078	Alphabet Inc. - A	18.372.261	4,15		Total de Irlanda	3.459.276	0,78
179.278	Amazon.com Inc.	20.258.414	4,57				
34.025	American Tower Corp.	7.305.167	1,65		Total de fondos	3.459.276	0,78
35.584	Autodesk Inc.	6.647.091	1,50				
44.974	Centene Corp.	3.499.427	0,79		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	3.459.276	0,78
19.508	Cooper Companies Inc.	5.148.161	1,16				
22.316	Deere & Company	7.451.089	1,68		Valor total de las inversiones	443.718.346	100,20
48.982	Doximity Inc.	1.480.236	0,33				
38.389	Ecolab Inc.	5.544.139	1,26		(Coste total: 482.671.301 USD)		
59.710	Electronic Arts Inc.	6.909.044	1,56				
10.432	Elevance Health Inc.	4.738.632	1,07				
27.949	Eli Lilly & Company	9.037.309	2,04				
8.527	Equinix Inc.	4.850.499	1,10				
39.804	First Republic Bank	5.196.412	1,17				
105.172	General Motors Company	3.374.969	0,76				
49.807	IntercontinentalExchange Inc.	4.500.063	1,02				
23.142	Intuit Inc.	8.963.359	2,02				
83.408	JPMorgan Chase & Company	8.716.136	1,97				
17.786	Lam Research Corp.	6.509.676	1,47				
47.005	Mastercard Inc. - A	13.365.402	3,02				
4.640	Mercadolibre Inc.	3.840.899	0,87				
113.167	Microsoft Corp.	26.356.595	5,96				
75.199	NextEra Energy Inc.	5.896.354	1,33				
42.380	Nvidia Corp.	5.144.508	1,16				
49.146	Paypal Holdings Inc.	4.229.996	0,96				
65.954	Qualcomm Inc.	7.451.483	1,68				
11.018	S&P Global Inc.	3.364.346	0,76				
32.032	Stryker Corp.	6.487.761	1,47				
15.526	Svb Financial Group	5.213.320	1,18				
14.026	Thermo Fisher Scientific Inc.	7.113.847	1,60				
108.704	T-Mobile USA Inc.	14.584.816	3,29				
64.444	Trimble Navigation Limited	3.497.376	0,79				
155.022	Uber Technologies Inc.	4.108.083	0,93				
30.698	Union Pacific Corp.	5.980.584	1,35				
70.618	Walt Disney Company	6.661.396	1,50				
	Total de Estados Unidos	271.485.658	61,31				
	Total de renta variable	440.259.070	99,42				
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	440.259.070	99,42				

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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				JAPÓN (continuación)			
2.049	Lotus Bakeries NV	10.757.250	0,70	104.695	Disco Corp.	23.626.605	1,55
	Total de Bélgica	10.757.250	0,70	385.409	Giken Limited	8.493.707	0,56
CANADÁ				239.735	Jtower Inc.	11.056.931	0,72
196.180	Cargojet Inc.	16.264.687	1,07	1.642.800	Mani Inc.	20.367.089	1,34
432.162	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	27.562.376	1,81	683.762	Menicon Company Limited	14.335.910	0,94
	Total de Canadá	43.827.063	2,88	382.520	Shoei Company Limited	14.108.513	0,92
DINAMARCA				1.003.300	SMS Company Limited	20.724.095	1,36
798.492	ALK-Abello AS	12.972.699	0,85	544.810	Square Enix Holdings Company Limited	23.936.382	1,57
150.608	Simcorp A/S	8.707.798	0,57		Total de Japón	168.097.319	11,02
	Total de Dinamarca	21.680.497	1,42	PAÍSES BAJOS			
FINLANDIA				174.678	BE Semiconductor Industries	7.788.892	0,51
205.695	Revenio Group Oyj	7.841.093	0,51		Total de Países Bajos	7.788.892	0,51
	Total de Finlandia	7.841.093	0,51	ESPAÑA			
FRANCIA				666.994	Fluidra SA	10.351.747	0,68
331.538	Lectra	9.415.679	0,62		Total de España	10.351.747	0,68
	Total de Francia	9.415.679	0,62	SUECIA			
ALEMANIA				2.520.252	Fortnox AB	10.036.534	0,66
243.358	CompuGroup Medical SE & Company KgaA	8.653.810	0,57	771.619	Hemnet Group AB	10.042.952	0,66
178.744	CTS Eventim AG	7.600.195	0,50	110.412	MIPS AB	3.388.008	0,22
35.222	Hypoport AG	3.206.963	0,21	656.590	Nordnet AB	7.645.925	0,50
281.086	Nemetschek SE	13.837.864	0,91	459.016	Thule Group AB	9.436.423	0,62
103.712	Stratec Biomedical AG	8.462.899	0,55		Total de Suecia	40.549.842	2,66
	Total de Alemania	41.761.731	2,74	SUIZA			
ISLANDIA				57.276	Belimo Holding AG	21.829.995	1,43
1.642.183	Marel HF	5.090.767	0,33	16.933	Inficon Holding AG	11.713.410	0,77
	Total de Islandia	5.090.767	0,33	4.446	LEM Holding SA	6.971.799	0,46
ITALIA				1.447.148	SIG Group AG	30.287.103	1,98
126.430	Diasorin SpA	14.514.164	0,95	63.024	Tecan Group AG - Reg	22.419.385	1,47
1.080.664	Stevanato Group SpA	18.686.723	1,22	69.256	Vat Group AG	14.638.117	0,96
	Total de Italia	33.200.887	2,17		Total de Suiza	107.859.809	7,07
JAPÓN				REINO UNIDO			
908.600	Capcom Company Limited	23.323.811	1,53	1.685.842	Abcam plc	25.837.420	1,69
258.300	Daiseki Company Limited	8.124.276	0,53	1.057.240	Auction Technology Group plc	8.577.556	0,56
				5.136.018	Dr. Martens plc	13.039.223	0,85
				702.782	Future plc	10.570.719	0,69
				286.208	Games Workshop Group plc	18.899.277	1,24
				424.637	Genus plc	12.667.691	0,83
				481.851	Keywords Studios plc	12.617.484	0,83

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)			
400.012	Renishaw plc	16.026.249	1,05	83.994	Topbuild Corp.	14.128.037	0,93
1.203.165	Watches of Switzerland Group plc	9.240.491	0,61	201.678	Triumph Bancorp Inc.	11.188.893	0,73
	Total de Reino Unido	127.476.110	8,35	1.566.609	Verra Mobility Corp.	24.578.962	1,61
				233.075	Visteon Corp.	25.233.435	1,65
				132.014	WD-40 Company	23.682.070	1,55
				829.489	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	34.148.208	2,24
				354.151	Workiva Inc.	28.125.298	1,84
				225.938	XPEL Inc.	14.861.884	0,97
				492.208	YETI Holdings Inc.	14.329.374	0,94
					Total de Estados Unidos	863.304.107	56,57
					Total de renta variable	1.499.002.793	98,23
					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	1.499.002.793	98,23
					Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		
					Fondos		
					IRLANDA		
				31.023.241	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	31.667.678	2,07
					Total de Irlanda	31.667.678	2,07
					Total de fondos	31.667.678	2,07
					Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	31.667.678	2,07
					Valor total de las inversiones	1.530.670.471	100,30
					(Coste total: 1.785.002.191 EUR)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - American

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
269.088	Globalfoundries Inc.	13.010.405	1,35	104.889	Salesforce.com Inc.	15.087.234	1,57
	Total de Islas Caimán	13.010.405	1,35	436.229	State Street Corp.	26.527.085	2,76
				47.001	Svb Financial Group	15.781.996	1,64
				330.800	Take-Two Interactive Software Inc.	36.057.199	3,76
				77.768	Target Corp.	11.539.993	1,20
				187.181	Teradata Corp.	5.813.842	0,60
				31.008	Teradyne Inc.	2.330.251	0,24
				237.905	Tjx Companies Inc.	14.778.658	1,53
				93.276	Transunion	5.548.989	0,58
				189.635	Trimble Navigation Limited	10.291.491	1,07
				234.557	Uber Technologies Inc.	6.215.761	0,65
				77.159	Union Pacific Corp.	15.032.116	1,56
				205.155	United Parcel Service Inc.	33.140.739	3,45
				116.437	Vertex Pharmaceuticals Inc.	33.713.169	3,50
				424.279	Virtu Financial Inc.	8.812.275	0,92
				470.833	Voya Financial Inc.	28.485.397	2,96
				184.263	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	7.431.327	0,77
				23.109	Zebra Technologies Corp.	6.054.789	0,63
					Total de Estados Unidos	908.901.934	94,49
					Total de renta variable	949.748.222	98,73
					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	949.748.222	98,73
					Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		
					Fondos		
					IRLANDA		
				10.190.507	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	10.190.507	1,06
					Total de Irlanda	10.190.507	1,06
					Total de fondos	10.190.507	1,06
					Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	10.190.507	1,06
					Valor total de las inversiones	959.938.729	99,79
					(Coste total: 1.012.806.239 USD)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - American Select

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
90.688	Globalfoundries Inc.	4.384.765	1,42	59.527	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	2.400.724	0,78
	Total de Islas Caimán	4.384.765	1,42		Total de Estados Unidos	299.592.795	96,83
ESTADOS UNIDOS				Total de renta variable			
18.917	Adobe Systems Inc.	5.205.958	1,68	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
43.893	Advanced Micro Devices Inc.	2.781.060	0,90	303.977.560			
1.884	Agco Corp.	181.184	0,06	Valor total de las inversiones			
154.006	Alphabet Inc. - A	14.730.674	4,76	303.977.560			
84.994	American Electric Power Company Inc.	7.347.731	2,37	(Coste total: 353.979.615 USD)			
343.478	Coca Cola Company	19.241.638	6,22	<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>			
52.995	Crowdstrike Holdings Inc. - A	8.734.106	2,83				
236.555	CVS Health Corp.	22.560.250	7,29				
57.809	Darling Ingredients Inc.	3.824.065	1,23				
155.893	Electronic Arts Inc.	18.038.379	5,84				
76.058	Exact Sciences Corp.	2.471.124	0,80				
14.552	Generac Holdings Inc.	2.592.293	0,84				
124.214	Hilton Worldwide Holdings Inc.	14.982.693	4,84				
50.098	Kellogg Company	3.489.827	1,13				
211.973	Kontoor Brands Inc.	7.124.413	2,30				
37.981	Lam Research Corp.	13.901.047	4,49				
94.383	Lamb Weston Holding Inc.	7.303.357	2,36				
147.794	Livent Corp.	4.529.886	1,46				
42.678	Microsoft Corp.	9.939.706	3,21				
56.111	Mirati Therapeutics Inc.	3.918.792	1,27				
152.353	NCino Inc.	5.196.761	1,68				
173.085	Northern Trust Corp.	14.809.153	4,79				
791.710	Nov Inc.	12.809.868	4,14				
86.939	Qualcomm Inc.	9.822.368	3,17				
32.906	Salesforce.com Inc.	4.733.199	1,53				
104.536	Schnitzer Steel Industries Inc.	2.975.095	0,96				
274.308	State Street Corp.	16.680.669	5,39				
9.897	Svb Financial Group	3.323.215	1,07				
22.890	Target Corp.	3.396.647	1,10				
133.818	Teradata Corp.	4.156.387	1,34				
75.864	Transunion	4.513.149	1,46				
43.786	Trimble Navigation Limited	2.376.266	0,77				
75.834	Uber Technologies Inc.	2.009.601	0,65				
116.998	United Parcel Service Inc.	18.899.857	6,11				
64.211	Vertex Pharmaceuticals Inc.	18.591.653	6,01				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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)			
BERMUDAS				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
120.450	Axalta Coating System Limited	2.536.677	1,00	38.530	Icf International Inc.	4.200.541	1,67
136.696	Essent Group Limited	4.766.590	1,89	60.136	Insmed Inc.	1.295.329	0,51
	Total de Bermudas	7.303.267	2,89	18.439	Installed Building Products Inc.	1.493.375	0,59
				206.812	Kontoor Brands Inc.	6.950.951	2,76
CANADÁ				83.733	Lamb Weston Holding Inc.	6.479.260	2,57
86.855	Gildan Activewear Inc.	2.455.391	0,97	175.090	Livent Corp.	5.366.509	2,13
58.828	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	3.675.573	1,46	93.814	Lyft Inc. - A	1.235.530	0,49
	Total de Canadá	6.130.964	2,43	83.485	Madison Square Garden Entertainment Corp.	3.680.854	1,46
IRLANDA				216.240	Matthews International Corp. - A	4.845.939	1,92
61.761	Trinseo plc	1.131.462	0,45	19.178	Medpace Holdings Inc.	3.014.206	1,20
	Total de Irlanda	1.131.462	0,45	50.412	Mirati Therapeutics Inc.	3.520.774	1,40
ESTADOS UNIDOS				151.076	Moelis & Company - A	5.107.880	2,03
80.541	Acadia Pharmaceuticals Inc.	1.317.651	0,52	143.040	Ncino Inc.	4.879.093	1,93
33.979	Acushnet Holdings Corp.	1.477.747	0,59	2.987.133	Newpark Resources	7.527.574	2,98
15.315	Agco Corp.	1.472.844	0,58	346.944	Nov Inc.	5.613.554	2,23
143.642	Allogene Therapeutics Inc.	1.551.334	0,62	76.622	Patterson Companies Inc.	1.840.460	0,73
20.370	Applied Industrial Technologies Inc.	2.093.628	0,83	38.868	Qualys Inc.	5.417.810	2,14
90.222	Aris Water Solution Inc.	1.151.233	0,46	195.108	Quanex Building Products Corp.	3.543.161	1,40
10.991	Aspen Technology Inc.	2.618.056	1,04	216.828	Quanterix Corp.	2.389.445	0,95
255.810	Avista Corp.	9.477.761	3,76	462.110	Ranpak Holdings Corp.	1.580.416	0,63
115.097	Axos Financial Inc.	3.939.770	1,56	102.091	Revolution Medicines Inc.	2.013.235	0,80
36.408	Beacon Roofing Supply Inc.	1.992.246	0,79	54.360	Sage Therapeutics Inc.	2.128.737	0,84
116.150	Bloom Energy Corp.	2.321.839	0,92	177.460	Schnitzer Steel Industries Inc.	5.050.512	2,00
40.710	Bright Horizons Family Solutions Inc.	2.346.932	0,93	1.310.580	Sharecare Inc.	2.490.102	0,99
267.081	Brixmor Property Group Inc.	4.932.986	1,96	34.242	Shift4 Payments Inc.	1.527.536	0,61
286.382	Carriage Services Inc.	9.210.044	3,65	105.805	Teradata Corp.	3.286.303	1,30
18.282	Casella Waste Systems Inc. - A	1.396.562	0,55	7.601	Teradyne Inc.	571.215	0,23
42.212	Cirrus Logic Inc.	2.904.186	1,15	128.807	Toast Inc.	2.153.653	0,85
96.475	Commed Corp.	7.734.401	3,07	188.812	Utz Brands Inc.	2.851.062	1,13
67.780	Darling Ingredients Inc.	4.483.647	1,78	311.367	Virtu Financial Inc.	6.467.092	2,56
105.209	Domo Inc.	1.892.710	0,75	131.078	Voya Financial Inc.	7.930.219	3,14
30.625	Doximity Inc.	925.488	0,37	329.000	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	13.268.570	5,26
461.472	Empire State Realty Trust Inc. - A	3.027.256	1,20	40.367	Wingstop Inc.	5.062.829	2,01
108.683	Endeavor Group Holdings Inc.	2.201.918	0,87	258.185	Xponential Fitness Inc.	4.714.458	1,87
67.525	Envestnet Inc.	2.998.110	1,19		Total de Estados Unidos	230.630.410	91,46
17.040	Evo Payments Inc.	567.432	0,23		Total de renta variable	245.196.103	97,23
40.367	Fti Consulting Inc.	6.689.215	2,65		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	245.196.103	97,23
14.619	Herc Holdings Inc.	1.518.622	0,60				
80.081	Hostess Brands Inc.	1.861.082	0,74				
93.228	Houlihan Lokey Inc.	7.027.526	2,79				

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			
3.333.149	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	3.333.149	1,32
	Total de Irlanda	3.333.149	1,32
	Total de fondos	3.333.149	1,32
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	3.333.149	1,32
	Valor total de las inversiones	248.529.252	98,55
	(Coste total: 271.267.313 USD)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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 (continuación)			
32.229	Ancor plc	344.808	0,89	252.000	Boc Hong Kong Holdings Limited	839.475	2,17
65.459	Australia & New Zealand Banking Group Limited	959.580	2,48	126.400	Galaxy Entertainment Group Limited	747.137	1,93
4.159	CSL Limited	762.152	1,97	530.000	Guangdong Investment Limited	424.680	1,10
32.529	Goodman Group	330.031	0,85	35.021	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	1.202.773	3,11
65.244	Lendlease Group	374.182	0,97	19.500	Techtronic Industries Company	188.419	0,49
10.797	Macquarie Group Limited	1.060.311	2,74		Total de Hong Kong	5.181.744	13,39
59.925	Newcrest Mining Limited	651.907	1,68				
11.726	Rio Tinto Limited	704.089	1,82				
269.110	Santos Limited	1.226.742	3,17				
78.850	Transurban Group	625.596	1,62				
	Total de Australia	7.039.398	18,19				
ISLAS CAIMÁN				INDIA			
158.216	Alibaba Group Holding Limited	1.571.093	4,06	27.820	HDFC Bank Limited	486.050	1,25
64.850	Baidu Inc. - A	942.608	2,43	50.621	Reliance Industries Limited	1.479.515	3,82
213.000	China Mengniu Dairy Company Limited	845.226	2,18	7.954	Tata Consultancy Services Limited	293.757	0,76
38.688	JD.com Inc. - A	978.793	2,53	51.162	Tech Mahindra Limited	634.292	1,64
79.000	Li Ning Company Limited	604.835	1,56	79.833	UPL Limited	659.488	1,70
43.400	Meituan Inc.	915.557	2,36		Total de India	3.553.102	9,17
40.800	NetEase Inc.	615.905	1,59				
21.000	Parade Technologies Limited	391.571	1,01				
3.667	Sea Limited	205.535	0,53				
49.000	Shenzhen International Group Holdings Limited	382.953	0,99				
49.200	Tencent Holdings Limited	1.669.684	4,30				
	Total de Islas Caimán	9.123.760	23,54				
CHINA				INDONESIA			
557.600	China Construction Bank Corp.	322.488	0,83	707.600	Indofood Cbp Sukses Makmur Tbk Pt	401.949	1,04
26.100	China International Travel Service Corp. Limited - A	725.797	1,87		Total de Indonesia	401.949	1,04
102.100	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	472.322	1,22				
65.100	Midea Group Company Limited - A	450.275	1,16				
152.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	759.041	1,96				
17.100	Wuliangye Yibin Company Limited - A	405.915	1,05				
	Total de China	3.135.838	8,09				
HONG KONG				REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
213.400	AIA Group Limited	1.779.260	4,59	15.992	Hana Financial Group Inc.	396.252	1,02
				87.786	Hanon Systems	510.506	1,32
				7.971	Kakao Corp.	318.128	0,82
				8.344	Kia Corp.	419.330	1,08
				3.118	Naver Corp.	421.706	1,09
				45.056	Samsung Electronics Company Limited	1.672.243	4,32
				854	Samsung Sdi Company Limited	325.914	0,84
				7.470	SK hynix Inc.	433.884	1,12
				18.530	SK Telecom Company Limited	657.948	1,70
					Total de República de Corea (Sur)	5.155.911	13,31
SINGAPUR				TAIWÁN			
				78.300	Oversea-Chinese Banking Corp. Limited	645.543	1,67
					Total de Singapur	645.543	1,67
				14.000	Asmedia Technology Inc.	292.796	0,76

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

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 (continuación)			
240.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	3.190.017	8,23
	Total de Taiwán	3.482.813	8,99
TAILANDIA			
1.371.900	Thai Beverage plc	573.657	1,48
	Total de Tailandia	573.657	1,48
	Total de renta variable	38.293.715	98,87
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	38.293.715	98,87
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
18.211	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	18.211	0,05
	Total de Irlanda	18.211	0,05
	Total de fondos	18.211	0,05
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	18.211	0,05
	Valor total de las inversiones	38.311.926	98,92
	(Coste total: 46.350.274 USD)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Asia Equities

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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				CHINA (continuación)			
105.133	Ancor plc	1.124.785	1,10	53.700	WuXi AppTec Company Limited - H	434.051	0,42
193.654	Australia & New Zealand Banking Group Limited	2.838.825	2,76	Total de China			
107.821	Chalice Mining Limited	272.441	0,27	5.963.825 5,82			
134.535	Coles Group Limited	1.421.184	1,39	HONG KONG			
15.531	CSL Limited	2.846.112	2,77	400.200	AIA Group Limited	3.336.738	3,25
569.660	Deterra Royalties Limited	1.465.052	1,43	608.000	Boc Hong Kong Holdings Limited	2.025.399	1,97
159.965	Graincorp Limited	802.226	0,78	394.000	Galaxy Entertainment Group Limited	2.328.893	2,27
104.893	IGO Limited	923.941	0,89	28.637	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	983.519	0,96
21.719	Macquarie Group Limited	2.132.897	2,08	134.500	Sun Hung Kai Properties Limited	1.488.084	1,45
19.567	Oz Minerals Limited	324.328	0,32	51.161	Techtronic Industries Company	494.344	0,48
518.918	Santos Limited	2.365.496	2,31	Total de Hong Kong			
206.246	Transurban Group	1.636.356	1,60	10.656.977 10,38			
Total de Australia				INDIA			
18.153.643 17,70				287.346	Bharti Airtel Limited	2.825.292	2,76
ISLAS CAIMÁN				136.622	HDFC Bank Limited	2.386.955	2,33
202.428	Alibaba Group Holding Limited	2.010.120	1,96	261.764	ICICI Bank Limited	2.773.575	2,70
73.850	Baidu Inc. - A	1.073.424	1,05	114.258	Reliance Industries Limited	3.339.453	3,25
350.000	China Mengniu Dairy Company Limited	1.388.869	1,35	86.958	Tech Mahindra Limited	1.078.081	1,05
476.816	China Resources Land Limited	1.876.915	1,83	160.196	UPL Limited	1.323.353	1,29
116.085	JD.com Inc. - A	2.936.910	2,86	Total de India			
37.792	KE Holdings Inc.	662.116	0,64	13.726.709 13,38			
171.000	Kingdee International Software Group Company Limited	223.936	0,22	INDONESIA			
135.000	Kuaishou Technology	876.220	0,85	8.969.956	Bank Rakyat Indonesia	2.644.866	2,58
96.000	Li Ning Company Limited	734.989	0,72	5.331.700	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	1.561.592	1,52
147.683	Meituan Inc.	3.115.489	3,04	Total de Indonesia			
22.000	Parade Technologies Limited	410.217	0,40	4.206.458 4,10			
10.506	Sea Limited	588.861	0,57	FILIPINAS			
97.600	Tencent Holdings Limited	3.312.222	3,22	1.055.325	Metropolitan Bank & Trust	873.084	0,85
69.000	Wuxi Biologics Cayman Inc.	416.642	0,41	Total de Filipinas			
Total de Islas Caimán				873.084 0,85			
19.626.930 19,12				REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
CHINA				101.768	Hanon Systems	591.816	0,58
14.500	BYD Company Limited	359.087	0,35	23.696	Kia Corp.	1.190.848	1,16
44.600	China International Travel Service Corp. Limited - A	1.240.251	1,21	41.848	Kt Corp.	1.058.853	1,03
260.000	China Merchants Bank Company Limited - H	1.208.931	1,18	4.639	Lotte Chilsung Beverage Company Limited	517.175	0,50
171.000	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	791.058	0,77	2.087	Samsung Biologics Company Limited	1.177.195	1,15
119.400	NARI Technology Company Limited	416.526	0,41				
63.777	Wuliangye Yibin Company Limited - A	1.513.921	1,48				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Asia 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)				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Renta variable (continuación)				Fondos			
REPÚBLICA DE COREA (SUR) (continuación)				IRLANDA			
90.021	Samsung Electronics Company Limited	3.341.109	3,26	8.624	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	8.624	0,01
3.594	Samsung Sdi Company Limited	1.371.586	1,34	Total de Irlanda			
21.729	SK hynix Inc.	1.262.098	1,23	8.624 0,01			
Total de República de Corea (Sur)		10.510.680	10,25	Total de fondos			
				8.624 0,01			
SINGAPUR				Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
488.000	Keppel Corp. Limited	2.363.650	2,30	8.624 0,01			
134.500	United Overseas Bank Limited	2.452.102	2,39	Valor total de las inversiones			
Total de Singapur		4.815.752	4,69	100.602.292 98,06			
TAIWÁN				(Coste total: 114.714.355 USD)			
16.000	Asmedia Technology Inc.	334.624	0,33	<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>			
198.550	Chailease Holding Company Limited	1.141.305	1,11				
226.000	Chroma ATE Inc.	1.281.298	1,25				
1.458.000	CTBC Financial Holding Company Limited	911.564	0,89				
539.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	7.164.245	6,98				
Total de Taiwán		10.833.036	10,56				
TAILANDIA							
902.763	Thai Oil plc	1.226.574	1,20				
Total de Tailandia		1.226.574	1,20				
Total de renta variable		100.593.668	98,05				
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		100.593.668	98,05				

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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)			
52.901	Canadian Natural Resources Limited	2.463.600	1,03	12.549	Honeywell International Inc.	2.095.307	0,88
	Total de Canadá	2.463.600	1,03	13.603	Horizon Pharma plc	841.890	0,35
IRLANDA				8.070	IBM Corp.	958.797	0,40
7.244	Aon plc	1.940.450	0,81	28.329	International Flavors & Fragrances Inc.	2.573.123	1,08
	Total de Irlanda	1.940.450	0,81	10.720	Intuit Inc.	4.152.070	1,75
SUIZA				8.486	Iqvia Holdings Inc.	1.537.154	0,64
19.206	TE Connectivity Limited	2.119.573	0,88	51.149	Johnson & Johnson	8.355.700	3,51
	Total de Suiza	2.119.573	0,88	20.109	JPMorgan Chase & Company	2.101.391	0,88
ESTADOS UNIDOS				4.182	Lam Research Corp.	1.530.612	0,64
32.200	Abbott Laboratories	3.115.672	1,31	5.950	Lowe's Companies Inc.	1.117.470	0,47
13.842	Adobe Systems Inc.	3.809.318	1,60	11.393	Marvell Technology Inc.	488.874	0,20
15.722	Advanced Micro Devices Inc.	996.146	0,42	12.062	Mastercard Inc. - A	3.429.709	1,43
43.906	Alphabet Inc. - A	4.199.610	1,76	19.463	Match Group Inc.	929.358	0,39
39.963	Alphabet Inc. - C	3.842.442	1,61	6.445	McDonald's Corp.	1.487.119	0,62
93.443	Amazon.com Inc.	10.559.058	4,43	12.219	Meta Platforms Inc.	1.657.874	0,69
42.903	American Electric Power Company Inc.	3.708.964	1,55	11.791	Microchip Technology Inc.	719.605	0,30
1.824	American Express Company	246.076	0,10	67.579	Microsoft Corp.	15.739.149	6,60
15.617	American Tower Corp.	3.352.970	1,40	65.869	Mondelez International Inc.	3.611.597	1,51
112.653	Apple Inc.	15.568.645	6,52	19.203	Monster Beverage Corp.	1.669.893	0,70
134.420	Bank of America Corp.	4.059.484	1,70	4.326	MSCI Inc. - A	1.824.664	0,76
25.052	Baxter International Inc.	1.349.301	0,57	13.995	Nvidia Corp.	1.698.852	0,72
26.185	Berkshire Hathaway Inc.	6.991.919	2,93	15.411	Palo Alto Networks Inc.	2.524.168	1,06
23.217	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	1.968.105	0,82	19.497	Paypal Holdings Inc.	1.678.107	0,70
3.178	BlackRock Inc.	1.748.790	0,73	18.275	Procter & Gamble Company	2.307.219	0,96
59.401	Boston Scientific Corp.	2.300.600	0,96	48.429	Public Service Enterprise Group Inc.	2.723.163	1,14
37.650	Chevron Corp.	5.409.175	2,27	53.854	Raytheon Technologies Corp.	4.408.488	1,85
56.199	Comcast Corp.	1.648.317	0,69	14.144	Salesforce.com Inc.	2.034.473	0,85
36.462	Corteva Inc.	2.083.803	0,87	51.546	Southwest Airlines Company	1.589.679	0,67
123.366	Coty Inc. - A	779.673	0,33	59.491	State Street Corp.	3.617.648	1,52
45.743	CVS Health Corp.	4.362.510	1,83	44.058	Sysco Corp.	3.115.341	1,31
12.061	Ecolab Inc.	1.741.850	0,73	29.585	Take-Two Interactive Software Inc.	3.224.765	1,35
7.917	Elevance Health Inc.	3.596.218	1,51	54.287	Tapestry Inc.	1.543.379	0,65
15.941	Eli Lilly & Company	5.154.522	2,16	10.663	Tesla Motors Inc.	2.828.361	1,18
50.943	Endeavor Group Holdings Inc.	1.032.105	0,43	3.329	Thermo Fisher Scientific Inc.	1.688.436	0,71
28.687	EOG Resources Inc.	3.205.199	1,34	24.017	Tjx Companies Inc.	1.491.936	0,63
24.678	Fidelity National Information Services Inc.	1.864.916	0,78	33.464	T-Mobile USA Inc.	4.489.865	1,88
34.012	General Electric Company	2.105.683	0,88	130.620	Uber Technologies Inc.	3.461.430	1,46
16.513	Global Payments Inc.	1.784.230	0,75	14.548	Union Pacific Corp.	2.834.241	1,18
				13.036	Vertex Pharmaceuticals Inc.	3.774.444	1,59
				18.218	Visa Inc. - A	3.236.428	1,36
				44.242	Walmart Inc.	5.738.188	2,39
				21.553	Walt Disney Company	2.033.094	0,85

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)			
122.253	Wells Fargo & Company	4.917.015	2,06
	Total de Estados Unidos	226.365.377	94,85
	Total de renta variable	232.889.000	97,57
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	232.889.000	97,57
	Valor total de las inversiones	232.889.000	97,57

(Coste total: 214.926.873 USD)

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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)			
664	Aon plc	177.866	0,22	10.098	Lennar Corp.	752.806	0,95
	Total de Irlanda	177.866	0,22	10.650	Lincoln National Corp.	467.642	0,59
ESTADOS UNIDOS				3.637	Lockheed Martin Corp.	1.404.937	1,76
9.797	Abbott Laboratories	947.958	1,19	4.800	Marathon Oil Corp.	108.384	0,14
4.762	AbbVie Inc.	639.108	0,80	8.713	Marathon Petroleum Corp.	865.462	1,08
2.171	Adobe Systems Inc.	597.459	0,75	8.837	Marsh & McLennan Companies Inc.	1.319.275	1,66
16.052	Advanced Micro Devices Inc.	1.017.055	1,28	4.679	Mastercard Inc. - A	1.330.427	1,66
37.221	Alphabet Inc. - A	3.560.189	4,46	3.778	McKesson Corp.	1.284.029	1,61
26.233	Altria Group Inc.	1.059.288	1,33	9.613	Meta Platforms Inc.	1.304.292	1,64
13.125	Amazon.com Inc.	1.483.125	1,86	17.771	Metlife Inc.	1.080.121	1,35
7.926	American Electric Power Company Inc.	685.203	0,86	22.823	Microsoft Corp.	5.315.476	6,66
309	Amgen Inc.	69.649	0,09	2.667	Molina Healthcare Inc.	879.683	1,10
38.519	Apple Inc.	5.323.325	6,68	14.752	Morgan Stanley	1.165.556	1,46
2.020	Autodesk Inc.	377.336	0,47	17.537	NRG Energy Inc.	671.141	0,84
553	Autozone Inc.	1.184.487	1,48	9.886	Nucor Corp.	1.057.703	1,33
3.596	Bank of New York Mellon Corp.	138.518	0,17	1.705	O'Reilly Automotive Inc.	1.199.212	1,50
2.636	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	223.454	0,28	6.207	Otis Worldwide Corp.	396.007	0,50
23.580	Bristol-Myers Squibb Company	1.676.302	2,10	1.950	Parker Hannifin Corp.	472.505	0,59
10.574	Capital One Financial Corp.	974.606	1,22	40.667	Pfizer Inc.	1.779.588	2,23
4.192	CF Industries Holdings Inc.	403.480	0,51	6.652	Philip Morris International Inc.	552.183	0,69
2.685	Cintas Corp.	1.042.290	1,31	9.604	Procter & Gamble Company	1.212.505	1,52
36.317	Cisco Systems Inc.	1.452.680	1,82	15.624	Pulte Homes Inc.	585.900	0,73
3.585	CME Group Inc.	635.011	0,79	2.490	PVH Corp.	111.552	0,14
1.846	Conocophillips	188.920	0,24	12.595	Qualcomm Inc.	1.422.983	1,78
7.573	CSX Corp.	201.745	0,25	9.230	Ralph Lauren Corp.	783.904	0,98
10.700	CVS Health Corp.	1.020.459	1,28	479	Regeneron Pharmaceuticals Inc.	329.969	0,41
2.105	Delta Air Lines Inc.	59.066	0,07	1.124	Republic Services Inc.	152.909	0,19
3.799	Devon Energy Corp.	228.434	0,29	2.901	Robert Half International Inc.	221.927	0,28
1.221	Discover Financial Services	111.013	0,14	1.099	SBA Communications	312.830	0,39
4.056	Dow Inc.	178.180	0,22	1.254	Snap-On Inc.	252.493	0,32
4.364	Electronic Arts Inc.	504.958	0,63	1.971	Southwest Airlines Company	60.786	0,08
4.329	Emerson Electric Company	316.969	0,40	3.514	Tapestry Inc.	99.903	0,13
9.648	Evergy Inc.	573.091	0,72	3.190	Tesla Motors Inc.	846.148	1,06
9.657	Expedia Group Inc.	904.764	1,13	12.747	Textron Inc.	742.640	0,93
22.661	Exxon Mobil Corp.	1.978.532	2,47	1.590	Tyson Foods Inc. - A	104.829	0,13
27.332	Fortinet Inc.	1.342.821	1,68	946	Ultra Salon, Cosmetics & Fragrance	379.526	0,48
15.848	General Mills Inc.	1.214.115	1,52	28.440	Under Armour Inc.	189.126	0,24
4.559	Hologic Inc.	294.147	0,37	3.308	United Parcel Service Inc.	534.374	0,67
42.289	Host Hotels & Resorts Inc.	671.549	0,84	2.610	VeriSign Inc.	453.357	0,57
10.112	Interpublic Group of Companies Inc.	258.867	0,32	6.684	Verizon Communications Inc.	253.791	0,32
6.881	Iqvia Holdings Inc.	1.246.425	1,57	1.970	Vertex Pharmaceuticals Inc.	570.393	0,72
13.796	Kroger Company	603.575	0,76	13.941	Viatis Inc.	118.777	0,15
1.529	Lam Research Corp.	559.614	0,70	2.505	Voya Financial Inc.	151.553	0,19
				37.892	Wells Fargo & Company	1.524.015	1,92

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US Disciplined 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)			
43.754	Weyerhaeuser Company	1.249.615	1,57
	Total de Estados Unidos	72.020.001	90,29
	Total de renta variable	72.197.867	90,51
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	72.197.867	90,51
	Valor total de las inversiones	72.197.867	90,51

(Coste total: 81.810.839 USD)

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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			
93.731	KBC Group NV	4.560.950	1,21	81.117	Moncler SpA	3.438.550	0,91
	Total de Bélgica	4.560.950	1,21		Total de Italia	3.438.550	0,91
DINAMARCA				PAÍSES BAJOS			
23.527	DSV A/S	2.835.094	0,75	2.938	Adyen NV	3.824.688	1,01
137.993	Novo-Nordisk A/S	14.130.671	3,75	14.688	ASM International NV	3.433.320	0,91
275.772	Tryg A/S	5.819.236	1,54	25.650	ASML Holding NV	11.121.839	2,95
	Total de Dinamarca	22.785.001	6,04	1.056.870	ING Groep NV	9.361.755	2,48
				42.736	Koninklijke DSM NV	5.019.343	1,33
				90.055	STMicroelectronics NV	2.904.274	0,77
FRANCIA				Total de Países Bajos			
360.788	AXA SA	8.108.710	2,15			35.665.219	9,45
161.696	BNP Paribas	7.050.754	1,87	NORUEGA			
100.775	Compagnie de Saint-Gobain	3.733.714	0,99	336.007	DNB Bank ASA	5.440.372	1,44
112.471	Dassault Systemes SE	4.019.152	1,07		Total de Noruega	5.440.372	1,44
4.181	Hermes International	5.088.277	1,35	SUECIA			
8.121	Kering	3.723.885	0,99	370.440	Atlas Copco AB - A	3.570.929	0,95
36.086	L'Oreal SA	11.917.402	3,16	377.562	Sandvik AB	5.297.885	1,40
21.470	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	13.105.288	3,48		Total de Suecia	8.868.814	2,35
45.490	Pernod-Ricard SA	8.590.787	2,28	SUIZA			
77.894	Publicis Groupe SA	3.809.017	1,01	44.122	Compagnie Financiere Richemont SA - Reg	4.314.181	1,14
107.922	Sanofi	8.461.085	2,24	9.391	Lonza Group AG - Reg	4.736.306	1,26
57.333	Schneider Electric SE	6.704.521	1,78	134.851	Nestle SA - Reg	14.975.666	3,97
30.882	Teleperformance	8.057.113	2,14	54.719	Roche Holding AG	18.355.613	4,86
276.548	TotalEnergies SE	13.350.355	3,54	27.100	Sika AG	5.640.795	1,50
	Total de Francia	105.720.060	28,05	725.576	UBS Group AG	10.892.438	2,88
ALEMANIA					Total de Suiza	58.914.999	15,61
23.495	Allianz SE - Reg	3.801.491	1,01	REINO UNIDO			
105.333	Brenntag AG	6.570.673	1,74	598.222	3i Group plc	7.450.622	1,98
161.451	Daimler Truck Holding AG	3.769.881	1,00	164.428	Ashtead Group plc	7.655.686	2,03
80.616	Dr Ing hc F Porsche AG	6.650.820	1,76	101.999	Astrazeneca plc	11.557.583	3,06
133.150	Infineon Technologies AG	3.023.837	0,80	282.611	Compass Group	5.812.678	1,54
69.538	Mercedes-Benz Group AG - Reg	3.640.314	0,97	29.055	Linde plc	8.112.155	2,15
67.167	Puma AG Rudolf Dassler Sport	3.222.001	0,85	110.395	Reckitt Benckiser Group plc	7.517.440	1,99
	Total de Alemania	30.679.017	8,13	1.526.163	Rentokil Initial plc	8.303.942	2,20
IRLANDA				144.900	Rio Tinto plc	8.083.878	2,14
704.365	Bank of Ireland Group plc	4.638.948	1,23	500.518	SSE plc	8.711.860	2,31
224.008	CRH plc	7.407.945	1,96				
73.860	Kingspan Group plc	3.422.672	0,91				
	Total de Irlanda	15.469.565	4,10				

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)			
8.182.985	Vodafone Group plc	9.428.852	2,50
	Total de Reino Unido	82.634.696	21,90
	Total de renta variable	374.177.243	99,19
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	374.177.243	99,19
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
10.332	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	1.013.067	0,27
	Total de Irlanda	1.013.067	0,27
	Total de fondos	1.013.067	0,27
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	1.013.067	0,27
	Valor total de las inversiones	375.190.310	99,46
	(Coste total: 382.666.969 EUR)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

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)			
5.609	London Stock Exchange Group plc	487.535	1,02
24.399	Persimmon plc	344.054	0,72
16.618	Reckitt Benckiser Group plc	1.131.617	2,37
38.705	SSE plc	673.687	1,41
88.245	St James's Place plc	1.041.741	2,18
712.460	Vodafone Group plc	820.933	1,72
	Total de Reino Unido	9.866.279	20,67
	Total de renta variable	47.100.519	98,66
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	47.100.519	98,66
	Valor total de las inversiones	47.100.519	98,66
	(Coste total: 51.998.000 EUR)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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			
135.757	Azelis Group NV	3.095.260	0,86	702.068	Dalata Hotel Group Limited	1.979.832	0,55
309.528	Fagron	3.896.958	1,08	842.755	Irish Continental Group plc	3.244.607	0,90
525	Lotus Bakeries NV	2.756.250	0,76				
112.028	Melexis NV	7.841.960	2,17		Total de Irlanda	5.224.439	1,45
	Total de Bélgica	17.590.428	4,87				
DINAMARCA				ISLA DE MAN			
134.919	ALK-Abello A/S	2.191.961	0,61	2.223.037	Strix Group plc	3.115.744	0,86
82.405	Simcorp A/S	4.764.462	1,32		Total de Isla de Man	3.115.744	0,86
	Total de Dinamarca	6.956.423	1,93				
FINLANDIA				ITALIA			
171.820	Huhtamaki Oyj	5.611.641	1,56	409.466	Carel Industries SpA	7.837.179	2,17
117.711	Musti Group Oyj	2.097.610	0,58	21.476	Diasorin SpA	2.465.445	0,68
76.140	Revenio Group Oyj	2.902.457	0,80	216.572	GVS SpA	1.305.929	0,36
142.572	Vaisala Oyj	5.332.193	1,48	310.642	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	2.786.459	0,77
	Total de Finlandia	15.943.901	4,42	63.169	Interpump Group SpA	2.111.108	0,59
				231.593	Marr SpA	2.239.504	0,62
				309.937	Technoprobe SpA	2.200.553	0,61
					Total de Italia	20.946.177	5,80
FRANCIA				JERSEY - ISLAS DEL CANAL			
235.159	Elis SA	2.443.302	0,68	1.074.469	JTC plc	8.423.494	2,34
252.328	Lectra	7.166.115	1,99		Total de Jersey - Islas del Canal	8.423.494	2,34
24.920	Remy Cointreau	4.258.828	1,18				
237.523	Verallia SA	5.491.532	1,52				
6.329	Virbac SA	1.689.843	0,47				
	Total de Francia	21.049.620	5,84				
ALEMANIA				PAÍSES BAJOS			
186.023	Cancom AG	4.531.520	1,26	41.241	BE Semiconductor Industries	1.838.936	0,51
175.433	CompuGroup Medical SE & Company KgaA	6.238.397	1,74	32.844	IMCD Group NV	4.026.674	1,12
168.434	CTS Eventim AG	7.161.814	1,99		Total de Países Bajos	5.865.610	1,63
39.414	Gerresheimer AG	1.982.524	0,55				
12.275	Hypoport AG	1.117.639	0,31				
77.649	Nemetschek SE	3.822.660	1,06				
84.355	Norma Group	1.166.630	0,32				
116.552	Stabilus SE	5.279.806	1,46				
59.334	Stratec Biomedical AG	4.841.654	1,34				
	Total de Alemania	36.142.644	10,03				
ISLANDIA				ESPAÑA			
1.415.393	Marel HF	4.387.718	1,22	441.118	Fluidra SA	6.846.151	1,90
	Total de Islandia	4.387.718	1,22		Total de España	6.846.151	1,90
				SUECIA			
				443.223	Avanza Bank Holding AB	6.969.369	1,93
				354.581	Cint Group AB	2.000.931	0,55
				635.295	Elekta AB - B	3.322.648	0,92
				388.355	Engcon AB	2.418.353	0,67
				878.140	Fortnox AB	3.497.064	0,97
				299.650	Hexpol AB	2.532.980	0,70
				1.632.723	Karnov Group AB	8.169.839	2,26
				145.532	MIPS AB	4.465.670	1,24
				1.125.550	Munters Group AB	8.090.881	2,24

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)			
314.929	Nordnet AB	3.667.317	1,02	903.952	Watches of Switzerland Group plc	6.942.490	1,93
3.193	Stillfront Group AB	7.061	0,00				
204.483	Thule Group AB	4.203.749	1,16				
	Total de Suecia	49.345.862	13,66		Total de Reino Unido	111.696.380	30,93
					Total de renta variable	356.099.184	98,68
					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	356.099.184	98,68
SUIZA				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
18.638	Belimo Holding AG	7.103.629	1,97	Renta variable			
4.388	Inficon Holding AG	3.035.401	0,84	DINAMARCA			
3.480	LEM Holding SA	5.457.009	1,52	49.761	Ow Bunker A/S**	0	0,00
459.086	SIG Combibloc Group AG	9.608.129	2,66				
11.737	Tecan Group AG - Reg	4.175.176	1,16		Total de Dinamarca	0	0,00
28.881	Vat Group AG	6.104.358	1,69		Total de renta variable	0	0,00
98.238	VZ Holding AG	7.080.891	1,96		Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	0	0,00
	Total de Suiza	42.564.593	11,80		Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		
					Fondos		
REINO UNIDO					IRLANDA		
218.035	Abcam plc	3.341.631	0,93	13	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	1.310	0,00
324.438	Allfunds Group plc	2.457.618	0,68				
1.976.406	Ascential plc	4.630.301	1,28		Total de Irlanda	1.310	0,00
454.318	Auction Technology Group plc	3.685.954	1,02		Total de fondos	1.310	0,00
527.986	Big Yellow Group plc	6.377.320	1,76		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	1.310	0,00
527.567	CVS Group plc	10.297.812	2,85		Valor total de las inversiones	356.100.494	98,68
1.797.167	Dr. Martens plc	4.562.613	1,26		(Coste total: 386.553.773 EUR)		
178.504	FD Technologies PLC	2.896.463	0,80				
332.372	Future plc	4.999.290	1,39				
32.649	Games Workshop Group plc	2.155.923	0,60				
256.763	Genus plc	7.659.705	2,12				
512.290	GlobalData plc	6.041.798	1,67				
1.101.352	Howden Joinery Group plc	6.340.149	1,76				
1.445.694	Ibstock plc	2.704.952	0,75				
4.953.063	Johnson Service Group plc	4.458.727	1,24				
112.274	Keywords Studios plc	2.939.945	0,81				
935.599	Moonpig Group plc	1.700.437	0,47				
73.213	Renishaw plc	2.933.236	0,81				
670.353	Rightmove plc	3.683.331	1,02				
528.458	RWS Holdings plc	1.926.950	0,53				
538.318	Shaftesbury plc	2.256.112	0,63				
386.659	St James's Place plc	4.564.549	1,26				
1.181.839	Synthomer plc	1.434.227	0,40				
623.158	Victoria plc	3.145.661	0,87				
219.308	Victrex plc	4.173.313	1,15				
1.012.401	Volution Group plc	3.385.873	0,94				

* Diferencias menores debido al redondeo.

** Título a su valor razonable.

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 (continuación)				REINO UNIDO (continuación)			
602.892	Hexpol AB	5.096.325	0,72	1.778.278	Watches of Switzerland Group plc	13.657.448	1,93
80.691	MIPS AB	2.476.015	0,35				
470.602	Nordnet AB	5.480.113	0,77				
1.356.662	Stillfront Group AB	2.999.910	0,42				
410.088	Thule Group AB	8.430.564	1,19				
	Total de Suecia	54.650.029	7,72		Total de Reino Unido	226.270.816	31,99
					Total de renta variable	703.297.909	99,43
					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	703.297.909	99,43
SUIZA				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
36.920	Belimo Holding AG	14.071.573	1,99	Fondos			
8.991	Inficon Holding AG	6.219.528	0,88	IRLANDA			
917.855	SIG Group AG	19.209.624	2,72	35.806	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	3.510.728	0,50
25.862	Tecan Group AG - Reg	9.199.831	1,30				
57.366	Vat Group AG	12.125.017	1,71				
	Total de Suiza	60.825.573	8,60		Total de Irlanda	3.510.728	0,50
REINO UNIDO					Total de fondos	3.510.728	0,50
465.862	Abcam plc	7.139.858	1,01		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	3.510.728	0,50
1.289.391	Allfunds Group plc	9.767.138	1,37		Valor total de las inversiones	706.808.637	99,93
4.541.786	Ascential plc	10.640.444	1,50				
1.007.299	Auction Technology Group plc	8.172.377	1,16				
412.460	Aveva Group plc	14.767.194	2,09				
1.127.538	Big Yellow Group plc	13.619.057	1,93				
943.042	CVS Group plc	18.407.651	2,60				
3.621.633	Dr. Martens plc	9.194.532	1,30				
3.054.405	Elementis plc	3.141.115	0,44				
379.684	FD Technologies PLC	6.160.873	0,87				
700.189	Future plc	10.531.717	1,49				
61.815	Games Workshop Group plc	4.081.852	0,58				
568.124	Genus plc	16.948.168	2,40				
732.170	GlobalData plc	8.634.998	1,22				
2.214.113	Howden Joinery Group plc	12.745.976	1,80				
2.900.617	Ibstock plc	5.427.171	0,77				
1.806.035	Moonpig Group plc	3.282.440	0,46				
231.608	Renishaw plc	9.279.240	1,31				
892.456	Rentokil Initial plc	4.855.905	0,69				
1.023.459	RWS Holdings plc	3.731.904	0,53				
1.086.208	Shaftesbury plc	4.552.340	0,64				
1.190.768	St James's Place plc	14.057.137	1,99				
1.601.560	Synthomer plc	1.943.582	0,27				
929.954	Victoria plc	4.694.347	0,66				
359.251	Victrex plc	6.836.352	0,98				

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - European Select

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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)			
DINAMARCA				SUECIA			
275.348	DSV A/S	33.180.491	2,67	3.594.197	Atlas Copco AB - A	34.646.966	2,79
461.705	Novo-Nordisk A/S	47.279.222	3,81	2.083.814	Sandvik AB	29.239.720	2,35
2.479.250	Tryg A/S	52.316.193	4,21				
	Total de Dinamarca	132.775.906	10,69		Total de Suecia	63.886.686	5,14
FRANCIA				SUIZA			
109.587	Air Liquide SA	12.883.048	1,04	100.773	Lonza Group AG - Reg	50.824.379	4,09
486.888	Dassault Systemes SE	17.398.943	1,40	706.959	Nestle SA - Reg	78.510.223	6,32
26.472	Hermes International	32.216.424	2,59	8.109	Partners Group Holding AG - Reg	6.766.607	0,54
214.676	Legrand SA	14.310.302	1,15	36.087	Roche Holding AG	12.105.467	0,97
190.655	L'Oreal SA	62.963.814	5,07	197.983	Sika AG	41.209.647	3,32
124.175	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	75.796.419	6,11	108.340	Vat Group AG	22.899.006	1,84
285.774	Pernod-Ricard SA	53.968.420	4,34				
474.440	Schneider Electric SE	55.481.014	4,47				
	Total de Francia	325.018.384	26,17		Total de Suiza	212.315.329	17,08
ALEMANIA				REINO UNIDO			
838.927	Brenntag AG	52.332.265	4,22	1.769.725	Allfunds Group plc	13.405.667	1,08
110.913	Dr Ing hc F Porsche AG	9.150.323	0,74				
490.074	SAP SE	41.225.024	3,32				
524.351	Siemens Healthineers AG	23.218.262	1,87				
859.713	Zalando SE	17.391.994	1,40				
	Total de Alemania	143.317.868	11,55		Total de Reino Unido	13.405.667	1,08
ITALIA				Total de renta variable			
2.516.341	Finecobank Banca Fineco SpA	32.045.603	2,58			1.227.895.066	98,85
1.487.170	Nexi SpA	12.405.972	1,00				
	Total de Italia	44.451.575	3,58				
PAÍSES BAJOS				Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
11.981	Adyen NV	15.596.866	1,26			1.227.895.066	98,85
143.606	ASML Holding NV	62.267.562	5,01				
4.661.859	Davide Campari-Milano NV	42.478.859	3,42				
270.157	IMCD Group NV	33.121.248	2,67				
188.305	Koninklijke DSM NV	22.116.422	1,78				
751.317	STMicroelectronics NV	24.229.973	1,95				
	Total de Países Bajos	199.810.930	16,09				
ESPAÑA				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
644.666	Amadeus IT Holding SA - A	30.885.947	2,48	Fondos			
2.914.792	Inditex SA	62.026.774	4,99	IRLANDA			
	Total de España	92.912.721	7,47	97.923	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	9.601.353	0,77
				10.204	ILF EUR Liquidity Fund	983.686	0,08
					Total de Irlanda	10.585.039	0,85
					Total de fondos	10.585.039	0,85
					Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	10.585.039	0,85
					Valor total de las inversiones	1.238.480.105	99,70
					(Coste total: 1.188.001.525 EUR)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

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)				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Renta variable (continuación)				Fondos			
SUECIA (continuación)				IRLANDA			
1.167.144	Cint Group AB	6.586.293	0,53	69.386	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	6.803.264	0,55
2.251.701	Elekta AB - B	11.776.592	0,95				
3.299.598	Fortnox AB	13.140.165	1,06		Total de Irlanda	6.803.264	0,55
798.678	Hemnet Group AB	10.395.137	0,84				
1.017.527	Hexpol AB	8.601.288	0,69		Total de fondos	6.803.264	0,55
136.990	MIPS AB	4.203.557	0,34				
1.370.105	Nordnet AB	15.954.735	1,28		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	6.803.264	0,55
1.502.529	Stillfront Group AB	3.322.457	0,27				
681.836	Thule Group AB	14.017.143	1,13		Valor total de las inversiones	1.241.262.644	99,73
150.041	Vitrolife AB	2.194.366	0,18				
	Total de Suecia	114.176.847	9,20		(Coste total: 1.173.980.131 EUR)		
					<i>*Diferencias menores debido al redondeo.</i>		
					<i>**Titulo a su valor razonable.</i>		
SUIZA							
86.095	Belimo Holding AG	32.813.979	2,63				
61.346	Burckhardt Compression Holding AG	23.603.900	1,89				
19.275	Inficon Holding AG	13.333.490	1,07				
12.446	LEM Holding SA	19.516.647	1,57				
1.647.328	SIG Group AG	34.476.634	2,76				
120.182	Sika AG	25.015.571	2,01				
178.673	Skan Group AG	10.710.516	0,86				
64.694	Tecan Group AG - Reg	23.013.450	1,84				
116.316	Vat Group AG	24.584.833	1,98				
	Total de Suiza	207.069.020	16,61				
REINO UNIDO							
1.884.875	Allfunds Group plc	14.277.928	1,15				
	Total de Reino Unido	14.277.928	1,15				
	Total de renta variable	1.234.459.380	99,18				
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	1.234.459.380	99,18				
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario							
Renta variable							
DINAMARCA							
280.528	Ow Bunker A/S**	0	0,00				
	Total de Dinamarca	0	0,00				
	Total de renta variable	0	0,00				
	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	0	0,00				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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 (continuación)			
65.468	Australia & New Zealand Banking Group Limited	959.712	2,30	309.000	Xinyi Glass Holdings Limited	449.531	1,07
81.311	Coles Group Limited	858.943	2,06	Total de Hong Kong			
299.768	Deterra Royalties Limited	770.943	1,85	5.385.770			
124.398	Dexus Property Group	617.459	1,48	12,91			
84.213	Graincorp Limited	422.329	1,01	INDIA			
9.940	Macquarie Group Limited	976.150	2,34	238.036	Embassy Office Parks REIT	1.011.906	2,43
29.984	Oz Minerals Limited	496.992	1,19	45.638	HDFC Bank Limited	797.352	1,91
113.235	Santos Limited	516.184	1,24	102.315	Hindalco Industries Limited	491.178	1,18
161.563	Transurban Group	1.281.841	3,08	41.183	Tech Mahindra Limited	510.575	1,22
Total de Australia		6.900.553	16,55	Total de India			
				2.811.011			
				6,74			
ISLAS CAIMÁN				INDONESIA			
375	Chailease Holding Company Limited	10.778	0,03	3.639.378	Bank Rakyat Indonesia	1.073.101	2,57
193.000	China Mengniu Dairy Company Limited	765.862	1,84	3.488.100	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	1.021.623	2,45
286.000	China Resources Land Limited	1.125.796	2,70	Total de Indonesia			
40.700	JD.com Inc. - A	1.029.696	2,47	2.094.724			
69.485	NetEase Inc.	1.048.926	2,52	5,02			
Total de Islas Caimán		3.981.058	9,56	REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
				48.421	Hanon Systems	281.585	0,68
CHINA				20.326	KB Financial Group Inc.	620.849	1,49
617.200	Baoshan Iron & Steel Company Limited - A	455.379	1,09	13.672	Kia Corp.	687.089	1,65
1.393.000	China Construction Bank Corp.	805.642	1,93	25.331	Kt Corp.	640.934	1,54
126.500	China Merchants Bank Company Limited - H	588.191	1,41	48.349	Samsung Electronics Company Limited Pfd	1.584.939	3,80
148.542	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	687.166	1,65	24.559	SK Telecom Company Limited	872.021	2,09
157.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	786.506	1,89	Total de República de Corea (Sur)			
22.800	Wuliangye Yibin Company Limited - A	541.220	1,30	4.687.417			
Total de China		3.864.104	9,27	11,25			
HONG KONG				SINGAPUR			
167.200	AIA Group Limited	1.394.059	3,34	535.200	Capitamall Trust	716.137	1,72
285.500	Boc Hong Kong Holdings Limited	951.071	2,28	43.700	Jardine Cycle & Carriage Limited	1.029.078	2,47
168.000	Galaxy Entertainment Group Limited	993.031	2,38	282.500	Keppel Corp. Limited	1.368.302	3,28
15.122	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	519.355	1,25	60.700	United Overseas Bank Limited	1.106.638	2,66
97.500	Sun Hung Kai Properties Limited	1.078.723	2,59	Total de Singapur			
				4.220.155			
				10,13			
TAIWÁN				TAIWÁN			
137.750	Chailease Holding Company Limited	791.814	1,90	171.000	Chroma ATE Inc.	969.478	2,33
735.000	CTBC Financial Holding Company Limited	459.533	1,10	20.000	MediaTek Inc.	347.097	0,83

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)			
TAIWÁN (continuación)			
229.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	3.043.807	7,31
	Total de Taiwán	5.611.729	13,47
TAILANDIA			
54.900	PTT Exploration & Production pcl	233.600	0,56
2.341.800	Thai Beverage pcl	979.219	2,35
480.963	Thai Oil pcl	653.479	1,57
	Total de Tailandia	1.866.298	4,48
	Total de renta variable	41.422.819	99,38
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	41.422.819	99,38
	Valor total de las inversiones	41.422.819	99,38
	(Coste total: 46.067.286 USD)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Global Technology

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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)			
97.070	Shaw Communications Inc.	2.372.973	0,46	683.205	Bloom Energy Corp.	13.657.268	2,64
	Total de Canadá	2.372.973	0,46	48.501	Broadcom Inc.	21.534.929	4,16
ISLAS CAIMÁN				85.925	Cerence Inc.	1.353.319	0,26
117.951	Globalfoundries Inc.	5.702.931	1,10	70.153	Comcast Corp.	2.057.587	0,40
236.214	Smart Global Holdings Inc.	3.748.716	0,73	131.001	Dell Technologies Inc. - C	4.476.304	0,87
	Total de Islas Caimán	9.451.647	1,83	608.592	Dropbox Inc. - A	12.610.026	2,44
ALEMANIA				135.096	Dxc Technology Company	3.307.150	0,64
209.127	TeamViewer AG	1.638.970	0,32	275.360	Ebay Inc.	10.136.002	1,96
	Total de Alemania	1.638.970	0,32	368.413	Eiger Biopharmaceuticals Inc.	2.774.150	0,54
ISRAEL				52.453	F5 Inc.	7.591.523	1,47
18.527	Cyberark Software Limited	2.777.938	0,53	64.457	Fidelity National Information Services Inc.	4.871.015	0,94
13.893	Tower Semiconductor Limited	610.458	0,12	68.500	Fiserv Inc.	6.409.545	1,24
	Total de Israel	3.388.396	0,65	204.095	Fortinet Inc.	10.027.187	1,94
JAPÓN				174.660	GoDaddy Inc.	12.379.900	2,40
1.299.400	Renesas Electronics Corp.	10.790.552	2,09	106.401	Hireright Holdings Corp.	1.623.679	0,31
139.000	Sumco Corp.	1.621.002	0,31	238.429	HP inc.	5.941.651	1,15
	Total de Japón	12.411.554	2,40	27.976	Intapp Inc.	522.312	0,10
PAÍSES BAJOS				78.387	Lam Research Corp.	28.689.643	5,54
57.943	NXP Semiconductor NV	8.547.172	1,65	114.007	Lumentum Holdings Lite US	7.817.460	1,51
	Total de Países Bajos	8.547.172	1,65	274.626	Marvell Technology Inc.	11.784.202	2,28
SUECIA				130.696	Microchip Technology Inc.	7.976.377	1,54
825.061	Telefonaktiebolaget LM Ericsson - ADR	4.735.851	0,91	147.369	Micron Technology Inc.	7.383.187	1,43
	Total de Suecia	4.735.851	0,91	83.845	Microsoft Corp.	19.527.501	3,77
ESTADOS UNIDOS				22.037	National Instruments Corp.	831.676	0,16
112.582	Activision Blizzard Inc.	8.369.346	1,62	185.816	NetApp Inc.	11.492.720	2,22
119.875	Advanced Energy Industries Inc.	9.279.524	1,80	497.450	Nortonlifelock Inc.	10.018.643	1,94
230.879	Alphabet Inc. - A	22.083.576	4,27	9.562	ON Semiconductor Corp.	595.999	0,12
96.780	Alphabet Inc. - C	9.305.397	1,80	173.502	Oracle Corp.	10.595.767	2,05
107.326	Analog Devices Inc.	14.954.805	2,89	66.896	Palo Alto Networks Inc.	10.956.895	2,12
236.023	Apple Inc.	32.618.379	6,30	96.099	Qorvo Inc.	7.631.222	1,48
190.774	Applied Materials Inc.	15.630.114	3,02	164.034	Rambus Inc.	4.169.744	0,81
36.951	Arista Networks Inc.	4.171.398	0,81	26.870	Salesforce.com Inc.	3.864.981	0,75
				191.144	Samsara Inc.	2.307.108	0,45
				11.367	Skyworks Solutions Inc.	969.264	0,19
				9.121	Splunk Inc.	685.899	0,13
				152.205	Synaptics Inc.	15.069.817	2,92
				62.453	Synopsys Inc.	19.080.016	3,69
				33.719	Tenable Holdings Inc.	1.173.421	0,23
				227.520	Teradyne Inc.	17.098.128	3,31
				140.951	Thoughtworks Holding Inc.	1.478.576	0,29
				2.130	T-Mobile USA Inc.	285.782	0,06
				166.534	Viavi Solutions Inc.	2.173.269	0,42
				79.024	Visa Inc. - A	14.038.614	2,72
				44.075	VMware Inc. - A	4.692.225	0,91
				206.915	Western Digital Corp.	6.735.083	1,30

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)			
463,474	Xperi Holding Corp.	6.553.522	1,27
	Total de Estados Unidos	473.362.827	91,58
	Total de renta variable	515.909.390	99,80
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	515.909.390	99,80
	Valor total de las inversiones	515.909.390	99,80

(Coste total: 519.306.969 USD)

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - UK Equities

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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)			
234.388	CRH plc	6.820.691	2,66	934.915	Schroders plc	3.639.624	1,42
248.519	Experian plc	6.613.090	2,58	448.761	Smith & Nephew plc	4.714.234	1,84
	Total de Irlanda	13.433.781	5,24	111.001	Spectris plc	3.036.987	1,19
				184.512	SSE plc	2.818.421	1,10
JERSEY - ISLAS DEL CANAL				1.397.147	SSP Group plc	2.652.484	1,04
4.923.880	Breedon Aggregates Limited	2.624.428	1,03	415.578	St James's Place plc	4.305.388	1,68
	Total de Jersey - Islas del Canal	2.624.428	1,03	180.252	Standard Chartered plc	1.021.668	0,40
REINO UNIDO				1.031.225	Synthomer plc	1.098.255	0,43
78.710	Ashtead Group plc	3.216.091	1,26	494.347	Tate & Lyle plc	3.361.560	1,31
420.040	Associated British Foods plc	5.298.805	2,07	2.289.229	Tesco plc	4.734.125	1,85
136.858	Aveva Group plc	4.300.078	1,68	367.166	Unilever plc	14.572.818	5,69
2.883.979	Barclays plc	4.161.582	1,63	423.923	Weir Group plc	5.962.477	2,33
86.015	Berkeley Group Holdings plc	2.835.915	1,11	251.300	Whitbread plc	5.784.926	2,26
2.739.155	BT Group plc	3.323.965	1,30		Total de Reino Unido	234.600.800	91,69
326.463	Burberry Group plc	5.902.451	2,31		Total de renta variable	250.659.009	97,96
362.744	Compass Group	6.547.528	2,56		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	250.659.009	97,96
2.235.816	ConvaTec Group plc	4.596.838	1,80		Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		
885.480	Crest Nicholson Holdings plc	1.622.199	0,63		Fondos		
79.514	Derwent London plc	1.606.183	0,63		IRLANDA		
343.306	Diageo plc	13.037.045	5,09	1.850.763	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	1.850.763	0,72
1.094.324	DS Smith plc	2.811.318	1,10		Total de Irlanda	1.850.763	0,72
239.464	Easyjet plc	709.771	0,28		Total de fondos	1.850.763	0,72
1.182.550	Elementis plc	1.067.251	0,42		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	1.850.763	0,72
51.468	Ferguson plc	4.840.051	1,89		Valor total de las inversiones	252.509.772	98,68
1.985.590	Grainger plc	4.554.943	1,78		(Coste total: 288.070.405 GBP)		
635.221	GSK Plc	8.294.716	3,24				
738.509	Haleon plc	2.062.286	0,81				
492.512	Howden Joinery Group plc	2.488.171	0,97				
113.230	Imperial Brands plc	2.100.417	0,82				
1.260.071	Informa plc	6.542.288	2,56				
92.193	InterContinental Hotels Group plc	4.027.912	1,57				
466.607	Intermediate Capital Group plc	4.585.814	1,79				
3.671.927	ITV plc	2.103.280	0,82				
245.688	Johnson Matthey plc	4.502.233	1,76				
3.000.067	Legal & General Group plc	6.495.145	2,54				
124.647	London Stock Exchange Group plc	9.508.073	3,72				
2.794.707	Melrose Industries plc	2.856.191	1,12				
767.838	Prudential plc	6.862.936	2,68				
178.505	Reckitt Benckiser Group plc	10.667.459	4,17				
494.879	Relx plc	10.897.235	4,26				
944.898	Rentokil Initial plc	4.511.888	1,76				
179.531	Rio Tinto plc	8.789.838	3,44				
777.973	Rotork plc	1.822.013	0,71				
1.053.919	Sage Group plc	7.347.924	2,87				

*Diferencias menores debido al redondeo.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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)			
3.312.245	Sherborne Investors Guernsey	1.563.380	0,71	1.046.991	Wincanton plc	3.062.449	1,40
Total de Guernsey - Islas del Canal		1.563.380	0,71	Total de Reino Unido		216.850.863	98,89
REINO UNIDO				Total de renta variable			
723.021	3i Group plc	7.902.620	3,60	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
223.283	Astrazeneca plc	22.203.261	10,12	218.414.243			
1.066.428	BAE Systems plc	8.422.648	3,84	99,60			
4.196.542	BT Group plc	5.092.504	2,32	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
5.402.985	Centrica plc	3.827.475	1,75	Fondos			
840.530	Chesnara plc	2.307.255	1,05	IRLANDA			
323.785	Compass Group	5.844.319	2,67	520.867	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	520.867	0,24
2.424.152	Direct Line Insurance Group plc	4.496.802	2,05	Total de Irlanda			
1.185.437	DS Smith plc	3.045.388	1,39	520.867			
919.779	Elementis plc	830.101	0,38	0,24			
71.235	Ferguson plc	6.698.939	3,05	Total de fondos			
90.922	Go-Ahead Group plc	1.405.654	0,64	520.867			
765.360	GSK Plc	9.994.071	4,56	0,24			
956.702	Haleon plc	2.671.590	1,22	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
4.045.116	Hays plc	4.126.018	1,88	520.867			
121.686	Hostmore plc	20.005	0,01	0,24			
252.795	Imi plc	2.828.776	1,29	Valor total de las inversiones			
757.752	Imperial Brands plc	14.056.300	6,41	218.935.110			
4.889.012	ITV plc	2.800.426	1,28	(Coste total: 234.836.679 GBP)			
319.422	JD Wetherspoon plc	1.292.381	0,59	<i>*Diferencias menores debido al redondeo.</i>			
197.360	Johnson Matthey plc	3.616.622	1,65				
2.558.245	Legal & General Group plc	5.538.600	2,53				
3.252.761	Marks & Spencer Group plc	3.209.825	1,46				
1.857.481	Melrose Industries plc	1.898.345	0,87				
529.388	Morgan Crucible Company	1.201.711	0,55				
141.839	Morgan Sindall plc	2.096.380	0,96				
205.284	Oxford Instruments plc	3.662.267	1,67				
1.100.941	Pearson plc	9.542.957	4,35				
202.161	Pennon Group plc	1.591.007	0,73				
1.505.611	Phoenix Group Holdings plc	7.931.559	3,62				
1.313.301	Rank Group plc	895.671	0,41				
323.954	Relx plc	7.133.467	3,25				
2.462.581	Rentokil Initial plc	11.758.825	5,36				
1.811.010	RS Group plc	17.548.686	8,00				
403.833	Smiths Group plc	6.097.878	2,78				
802.867	Tate & Lyle plc	5.459.496	2,49				
2.350.873	Tesco plc	4.861.605	2,22				
40.597	Unbound Group plc	4.263	0,00				
200.480	Unilever plc	7.957.051	3,62				
215.534	United Utilities Group plc	1.915.666	0,87				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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)			
10.331	Shopify Inc. - A	278.317	0,68	96.638	Nov Inc.	1.563.603	3,79
	Total de Canadá	278.317	0,68	3.626	Qualcomm Inc.	409.665	0,99
				20.588	Ranpak Holdings Corp.	70.411	0,17
				7.557	Salesforce.com Inc.	1.086.999	2,64
				8.098	Schnitzer Steel Industries Inc.	230.469	0,56
				256.373	Sharecare Inc.	487.109	1,18
				1.871	Shift4 Payments Inc.	83.465	0,20
				17.396	State Street Corp.	1.057.851	2,57
				1.427	Svb Financial Group	479.158	1,16
				3.023	Target Corp.	448.582	1,09
				11.740	Teradata Corp.	364.644	0,88
				3.469	Teradyne Inc.	260.695	0,63
				8.895	Transunion	529.164	1,29
				5.512	Trimble Navigation Limited	299.136	0,73
				10.282	Uber Technologies Inc.	272.473	0,66
				9.605	United Parcel Service Inc.	1.551.592	3,76
				6.707	Vertex Pharmaceuticals Inc.	1.941.945	4,72
				5.652	Voya Financial Inc.	341.946	0,83
				7.790	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	314.171	0,76
				11.874	Xponential Fitness Inc.	216.819	0,53
					Total de Estados Unidos	36.487.193	88,52
					Total de renta variable	37.470.985	90,91
					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	37.470.985	90,91
					Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		
					Fondos		
					IRLANDA		
				681.205	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	681.205	1,65
					Total de Irlanda	681.205	1,65
					Total de fondos	681.205	1,65
					Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	681.205	1,65
					Valor total de las inversiones	38.152.190	92,56
					(Coste total: 43.280.498 USD)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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	1.648.000	APA Infrastructure Limited 1.25% 15/03/2033	1.145.719	0,18	EUR	1.400.000	Electricite de France SA - Perp FRN	957.394	0,15
EUR	1.098.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	788.791	0,13	EUR	1.165.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	896.195	0,14
EUR	1.100.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	790.228	0,13	EUR	1.505.000	Faurecia SE 3.13% 15/06/2026	1.267.311	0,20
EUR	2.220.000	AusNet Services Holdings Pty Limited 0.63% 25/08/2030	1.671.806	0,27	EUR	3.531.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	3.236.079	0,52
		Total de Australia	4.396.544	0,71	EUR	3.793.000	Iliad Holdings SAS 5.13% 15/10/2026	3.434.419	0,55
					EUR	900.000	Iliad SA 0.75% 11/02/2024	848.978	0,14
					EUR	900.000	Iliad SA 1.50% 14/10/2024	840.809	0,14
					EUR	2.315.000	Iqera Group SAS 6.50% 30/09/2024	2.186.649	0,35
					EUR	3.318.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	2.982.465	0,48
					EUR	2.000.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 1.50% 27/09/2030	1.678.801	0,27
							Total de Francia	28.286.808	4,53
BÉLGICA				ALEMANIA					
EUR	6.700.000	Belfius Bank SA Perp FRN	6.264.500	1,01	EUR	1.400.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	1.147.391	0,18
EUR	2.200.000	Elia Transmission Belgium SA 0.88% 28/04/2030	1.763.434	0,28	EUR	1.150.000	Adler Real Estate AG 2.13% 06/02/2024	900.413	0,14
EUR	2.800.000	Kbc Group NV - Perp FRN	2.234.128	0,36	EUR	4.200.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	3.445.702	0,55
		Total de Bélgica	10.262.062	1,65	EUR	4.700.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	3.252.389	0,52
					EUR	1.600.000	Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032	1.573.909	0,25
					EUR	2.700.000	Bayer AG 1.00% 12/01/2036	1.724.492	0,28
					EUR	2.844.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	2.337.325	0,38
					EUR	5.600.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	5.105.812	0,82
					EUR	2.300.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	1.743.839	0,28
					EUR	2.400.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	1.879.744	0,31
					EUR	700.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	590.086	0,09
					EUR	1.100.000	Deutsche Lufthansa AG 3.75% 11/02/2028	870.825	0,14
					EUR	1.081.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	928.711	0,15
					EUR	456.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	380.211	0,06
					EUR	1.215.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	1.013.063	0,16
ISLAS CAIMÁN				FRANCIA					
GBP	11.910.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	10.949.255	1,76	EUR	1.209.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	1.080.362	0,17
USD	742.000	Tencent Holdings Limited 3.24% 03/06/2050	459.630	0,07	USD	2.700.000	BNP Paribas SA - Perp FRN	2.561.139	0,41
USD	1.333.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	1.227.584	0,20	EUR	2.600.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	1.750.543	0,28
USD	1.800.000	Tencent Holdings Limited 3.93% 19/01/2038	1.423.518	0,23	EUR	1.717.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	900.406	0,14
GBP	5.506.000	Thames Water Utilities 2.88% 03/05/2027	5.113.844	0,82	EUR	5.200.000	Electricite de France SA - Perp FRN	3.665.258	0,59
		Total de Islas Caimán	19.173.831	3,08					
DINAMARCA									
EUR	575.000	Danske Bank AS FRN 15/05/2031	481.767	0,08					
		Total de Dinamarca	481.767	0,08					

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)				ISLA DE MAN						
EUR	2.355.000	HT Troplast AG 9.25% 15/07/2025	2.089.855	0,34	EUR	3.200.000	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	3.130.151	0,50	
EUR	1.308.000	Ineos Styrolution Group GmbH 2.25% 16/01/2027	1.012.247	0,16	Total de Isla de Man					
EUR	3.000.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	1.982.889	0,32	3.130.151 0,50					
EUR	2.378.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	1.925.632	0,31	ITALIA					
EUR	3.240.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	2.611.296	0,42	EUR	932.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	669.499	0,11	
EUR	2.500.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	2.271.961	0,37	EUR	1.444.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	1.173.112	0,19	
EUR	1.300.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	1.065.511	0,17	EUR	3.261.000	Fis Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	2.730.495	0,44	
EUR	2.288.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 2.00% 15/07/2025	2.010.694	0,32	EUR	100.000	Gamma Bidco SpA 5.13% 15/07/2025	90.374	0,01	
EUR	1.300.000	Thyssenkrupp AG 1.88% 06/03/2023	1.276.583	0,21	EUR	362.000	Gamma Bidco SpA 6.25% 15/07/2025	334.997	0,06	
EUR	2.750.000	Thyssenkrupp AG 2.88% 22/02/2024	2.583.677	0,41	EUR	1.673.000	Lkq Italia Bondco 3.88% 01/04/2024	1.642.018	0,26	
EUR	400.000	Vier Gas Transport GmbH 0.13% 10/09/2029	290.972	0,05	EUR	1.096.000	Lottomatica SpA 9.75% 30/09/2027	1.099.748	0,18	
EUR	1.100.000	Vier Gas Transport GmbH 4.00% 26/09/2027	1.080.214	0,17	EUR	3.342.000	Nexi SpA 1.75% 31/10/2024	3.233.244	0,52	
EUR	3.100.000	Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	3.032.745	0,49	EUR	1.500.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	1.452.304	0,23	
EUR	2.700.000	Volkswagen Financial Services AG 0.88% 31/01/2028	2.267.933	0,36	Total de Italia					
EUR	3.200.000	Vonovia SE 1.50% 14/06/2041	1.747.008	0,28	12.425.791 2,00					
Total de Alemania				54.143.129	8,69	JERSEY - ISLAS DEL CANAL				
INDIA				JERSEY - ISLAS DEL CANAL						
USD	3.630.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	3.115.108	0,50	EUR	2.916.000	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	2.702.145	0,43	
USD	2.929.000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	2.427.334	0,39	EUR	7.300.000	Avis Budget Finance plc 4.13% 15/11/2024	7.007.379	1,14	
Total de India				5.542.442	0,89	USD	2.338.465	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.16% 31/03/2034	1.964.398	0,32
IRLANDA				JERSEY - ISLAS DEL CANAL						
EUR	4.767.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	4.306.627	0,69	EUR	1.542.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	1.184.980	0,19	
EUR	1.275.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	1.109.573	0,18	Total de Jersey - Islas del Canal					
EUR	3.710.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	3.036.793	0,49	12.858.902 2,08					
EUR	4.533.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	4.017.497	0,65	LUXEMBURGO					
Total de Irlanda				12.470.490	2,01	EUR	1.600.000	Adler Group SA 3.25% 05/08/2025	883.917	0,14
IRLANDA				LUXEMBURGO						
EUR	1.275.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	1.109.573	0,18	EUR	2.295.000	Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	1.733.004	0,28	
EUR	3.710.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	3.036.793	0,49	EUR	3.597.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	2.739.427	0,44	
EUR	4.533.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	4.017.497	0,65	EUR	3.300.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	2.502.525	0,40	
Total de Irlanda				12.470.490	2,01	EUR	3.900.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	2.938.556	0,48
IRLANDA				LUXEMBURGO						
EUR	4.767.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	4.306.627	0,69	GBP	1.855.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	1.529.186	0,25	
EUR	1.275.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	1.109.573	0,18						
EUR	3.710.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	3.036.793	0,49						
EUR	4.533.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	4.017.497	0,65						
Total de Irlanda				12.470.490	2,01					

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)					
LUXEMBURGO (continuación)				PAÍSES BAJOS (continuación)					
EUR	1.138.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 12/02/2036	772.078	0,13	EUR	3.140.000	Stichting AK Rabobank - Perp 6.50%	2.885.824	0,46
EUR	1.150.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	696.155	0,11	EUR	2.610.734	Summer Bidco BV 9.00% 15/11/2025	1.927.969	0,31
EUR	2.826.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	2.258.268	0,36	EUR	1.600.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	1.229.976	0,20
EUR	2.123.775	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	2.076.548	0,33	EUR	5.700.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	5.400.698	0,86
EUR	1.613.000	Gamma Bondco Sarl 8.13% 15/11/2026	1.333.090	0,21	EUR	1.658.000	TenneT Holding BV - Perp FRN	1.502.887	0,24
EUR	437.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 6.75% 01/11/2025	341.135	0,05	EUR	3.221.000	TenneT Holding BV - Perp FRN	3.102.511	0,50
GBP	931.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	831.121	0,13	EUR	4.200.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	3.417.137	0,55
EUR	2.100.000	Grand City Properties SA - Perp FRN	1.499.300	0,24	EUR	1.430.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	1.290.712	0,21
EUR	6.874.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	5.183.533	0,83	EUR	3.635.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	3.393.096	0,55
EUR	840.000	Loarre Investments Sarl FRN 15/05/2029	799.167	0,13	EUR	1.031.000	Universal Music Group NV 3.75% 30/06/2032	964.640	0,16
EUR	1.500.000	Loarre Investments Sarl 6.50% 15/05/2029	1.426.946	0,23	Total de Países Bajos			54.279.018	8,74
EUR	3.200.000	Matterhorn Telecom SA 2.63% 15/09/2024	3.146.213	0,51	NORUEGA				
EUR	1.390.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.63% 15/10/2050	841.674	0,14	EUR	3.475.000	DNB Bank ASA FRN 23/02/2029	2.816.707	0,45
EUR	3.835.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	2.849.072	0,46	Total de Noruega			2.816.707	0,45
EUR	1.673.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	1.580.819	0,25	ESPAÑA				
EUR	2.630.000	Selp Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	2.431.007	0,39	EUR	1.960.000	Grifols Escrow Issuer SA 3.88% 15/10/2028	1.453.683	0,23
Total de Luxemburgo			40.392.741	6,49	EUR	1.483.000	Grifols SA 1.63% 15/02/2025	1.316.194	0,21
PAÍSES BAJOS					EUR	767.000	Kaixo Bondco Telecom SA 5.13% 30/09/2029	605.785	0,10
EUR	865.000	Alliander NV 2.63% 09/09/2027	839.624	0,14	EUR	3.897.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	3.398.647	0,55
EUR	2.188.000	Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	1.753.291	0,28	Total de España			6.774.309	1,09
EUR	4.300.000	Constellium NV 4.25% 15/02/2026	3.877.874	0,62	SUECIA				
EUR	7.800.000	Cooperatieve Rabobank UA - Perp FRN	5.958.810	0,96	EUR	1.450.000	Heimstaden Bostad AB - Perp FRN	1.055.078	0,17
EUR	3.028.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	2.871.868	0,47	EUR	3.100.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	2.758.269	0,45
GBP	2.900.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	3.192.853	0,51	EUR	2.003.000	Intrum Justitia AB 3.13% 15/07/2024	1.834.332	0,29
USD	4.600.000	ING Groep NV - Perp FRN	3.093.399	0,50	EUR	1.704.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	1.365.685	0,22
EUR	2.010.000	Sagax Euro MTN BV 0.75% 26/01/2028	1.446.800	0,23	EUR	1.252.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	1.021.442	0,16
EUR	4.700.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	3.726.898	0,60	EUR	170.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	138.694	0,02
EUR	3.020.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	2.402.151	0,39	EUR	5.382.000	Verisure Holding AB 3.50% 15/05/2023	5.383.381	0,87

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)					
SUECIA (continuación)				REINO UNIDO (continuación)					
EUR	642.000	Verisure Holding AB 9.25% 15/10/2027	651.217	0,10	EUR	787.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	649.974	0,10
		Total de Suecia	14.208.098	2,28	EUR	790.000	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	773.550	0,12
					EUR	2.200.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	1.968.401	0,32
SUIZA					GBP	500.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 3.88% 01/03/2023	550.386	0,09
EUR	2.571.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	1.951.533	0,31	GBP	3.100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 3.88% 01/03/2023	3.412.391	0,55
EUR	3.200.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	1.919.367	0,31	EUR	1.466.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	1.296.860	0,21
USD	4.500.000	Credit Suisse Group AG - Perp FRN	4.235.651	0,68	GBP	2.776.000	Jerrold Finco plc 4.88% 15/01/2026	2.483.128	0,41
EUR	3.238.000	UBS AG 0.50% 31/03/2031	2.427.019	0,39	GBP	2.166.000	Legal & General Group plc FRN 26/11/2049	1.842.308	0,30
USD	5.205.000	UBS Group AG - Perp FRN	5.054.108	0,81	GBP	836.000	Legal & General Group plc FRN 01/11/2050	735.651	0,12
USD	3.906.000	UBS Group Funding Switzerland AG - Perp FRN	3.780.106	0,61	GBP	1.800.000	Lloyds Banking Group plc - Perp FRN	1.786.223	0,29
		Total de Suiza	19.367.784	3,11	GBP	1.347.065	Mitchells & Butlers Finance plc 5.57% 15/12/2030	1.493.227	0,24
REINO UNIDO					GBP	82.267	Mitchells & Butlers Finance plc 5.97% 15/12/2023	92.922	0,01
EUR	691.000	Anglo American Capital plc 4.75% 21/09/2032	668.815	0,11	GBP	2.096.709	Mitchells & Butlers Finance plc 6.01% 15/12/2028	2.233.958	0,36
GBP	6.845.000	Barclays Bank plc 5.75% 14/09/2026	7.349.127	1,18	EUR	1.620.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.87% 26/11/2040	865.276	0,14
EUR	2.300.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	1.619.385	0,26	GBP	1.400.000	National Grid plc 3.50% 16/10/2026	1.420.332	0,23
GBP	3.650.000	Barclays plc - Perp FRN	3.783.630	0,61	EUR	5.733.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	4.543.479	0,73
GBP	2.833.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	2.116.131	0,34	EUR	1.856.000	NatWest Group plc FRN 14/09/2032	1.436.744	0,23
EUR	2.968.000	British American Tobacco plc - Perp FRN	2.195.799	0,35	GBP	1.639.000	NatWest Group plc FRN 28/11/2031	1.452.081	0,23
GBP	400.500	Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	405.724	0,07	EUR	4.686.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	3.719.897	0,60
EUR	5.038.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	3.765.742	0,60	EUR	2.140.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	1.863.539	0,30
GBP	3.028.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	3.121.914	0,50	GBP	400.000	Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	367.823	0,06
GBP	1.801.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	1.541.043	0,25	GBP	3.100.000	Santander UK plc - Perp 10.06% 15/11/2026	5.454.260	0,88
EUR	3.308.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	2.892.010	0,47	EUR	1.609.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	1.234.462	0,20
USD	4.639.224	Enquest plc 7.00% 15/10/2023	4.360.137	0,70	GBP	1.769.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	1.724.872	0,28
EUR	6.500.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	6.195.835	1,00	GBP	5.542.185	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	5.539.702	0,90
GBP	2.920.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	2.846.381	0,46					
EUR	10.300.000	HSBC Holdings plc FRN 04/01/2066	7.959.397	1,29					
EUR	1.840.000	Imperial Brands Finance plc 3.38% 26/02/2026	1.740.750	0,28					
EUR	3.708.000	Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	3.179.054	0,52					

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)				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
GBP	1.992.112 Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	1.955.935	0,31	USD	1.840.000 JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	1.424.999	0,23
GBP	1.940.000 Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	1.845.968	0,30	USD	4.829.000 JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	3.819.171	0,61
EUR	3.674.000 Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	3.039.550	0,49	GBP	1.288.000 Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	1.301.781	0,21
EUR	2.040.000 Victoria plc 3.63% 26/08/2026	1.502.515	0,24	USD	1.365.000 Lowe's Companies Inc. 5.80% 15/09/2062	1.285.279	0,21
GBP	2.767.000 Vmed O2 UK Financing 4.00% 31/01/2029	2.396.968	0,39	EUR	1.242.000 Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	1.066.143	0,17
EUR	1.472.000 Vmed O2 UK Financing I plc 3.25% 31/01/2031	1.114.925	0,18	EUR	4.000.000 Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	3.542.877	0,56
USD	3.500.000 Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	3.405.248	0,55	EUR	640.000 Netflix Inc. 4.63% 15/05/2029	599.687	0,10
EUR	1.117.000 Western Power Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	1.074.947	0,17	USD	1.330.000 Occidental Petroleum Corp. 5.88% 01/09/2025	1.366.808	0,22
GBP	4.384.000 Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	3.943.545	0,63	USD	845.000 Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	871.178	0,14
	Total de Reino Unido	124.961.921	20,15	USD	1.230.000 Occidental Petroleum Corp. 8.00% 15/07/2025	1.336.460	0,21
				USD	775.000 Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	854.387	0,14
				USD	1.430.000 Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	1.625.527	0,26
				USD	2.478.000 Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	2.108.029	0,33
				EUR	4.149.000 Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	3.913.751	0,63
				EUR	1.375.000 Southern Company FRN 15/09/2081	966.925	0,16
				GBP	3.925.000 Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	3.918.336	0,63
					Total de Estados Unidos	61.480.704	9,87
				Total de bonos		487.453.199	78,40
				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			
				ALEMANIA			
				GBP	11.400.000 Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.88% 15/09/2026	11.115.706	1,79
					Total de Alemania	11.115.706	1,79
				Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			
						11.115.706	1,79
				Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
						498.568.905	80,19

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				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
AUSTRALIA				FRANCIA					
USD	3.640.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	3.396.743	0,55	USD	6.211.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	5.232.496	0,84
Total de Australia			3.396.743	0,55	Total de Francia			5.232.496	0,84
PAÍSES BAJOS				GIBRALTAR					
USD	2.956.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	3.002.043	0,48	EUR	2.300.000	888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027	1.939.188	0,31
Total de Países Bajos			3.002.043	0,48	Total de Gibraltar			1.939.188	0,31
ESTADOS UNIDOS				PORTUGAL					
USD	860.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	942.451	0,15	EUR	17.100.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	1.539.000	0,25
USD	5.619.000	Warnermedia Holdings Inc. 4.28% 15/03/2032	4.722.627	0,75	Total de Portugal			1.539.000	0,25
USD	5.243.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	3.900.992	0,63	REINO UNIDO				
Total de Estados Unidos			9.566.070	1,53	EUR	1.727.000	BCP V Modular Services Finance II plc 6.75% 30/11/2029	1.205.878	0,19
Total de bonos			15.964.856	2,56	GBP	4.319.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	4.237.061	0,68
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente			15.964.856	2,56	GBP	2.009.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	1.727.137	0,28
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				ESTADOS UNIDOS					
Bonos				Total de Estados Unidos					
AUSTRALIA				Total de bonos					
USD	9.082.000	APA Infrastructure Limited 4.25% 15/07/2027	8.597.190	1,39	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			39.820.876	6,40
Total de Australia			8.597.190	1,39	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			39.820.876	6,40
BERMUDAS				Fondos					
USD	11.721.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	11.168.812	1,79	IRLANDA				
Total de Bermudas			11.168.812	1,79	1.031.024	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	1.174.840	0,19	
DINAMARCA				3.519.647	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	3.592.760	0,58		
USD	2.205.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	1.890.379	0,30	294.937	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	28.918.503	4,64	
Total de Dinamarca			1.890.379	0,30					

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*
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios (continuación)			
Fondos (continuación)			
IRLANDA (continuación)			
32.603	Insight Liquidity Funds plc	37.151	0,01
	Total de Irlanda	33.723.254	5,42
	Total de fondos	33.723.254	5,42
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	33.723.254	5,42
	Valor total de las inversiones	588.077.891	94,57
(Coste total: 686.202.987 EUR)			

* Diferencias menores debido al redondeo.

** Título a su valor razonable.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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	174.000	APA Infrastructure Limited 1.25% 15/03/2033	120.968	0,38	USD	300.000	BNP Paribas SA - Perp FRN	284.571	0,90
USD	144.000	APA Infrastructure Limited 4.25% 15/07/2027	136.313	0,43	EUR	200.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	134.657	0,43
EUR	100.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	71.839	0,23	EUR	500.000	Credit Agricole SA 1.00% 03/07/2029	416.144	1,32
EUR	420.000	Ausgrid Finance Pty Limited 1.25% 30/07/2025	392.857	1,24	EUR	200.000	Electricite de France SA - Perp FRN	136.771	0,43
EUR	228.000	AusNet Services Holdings Pty Limited 0.63% 25/08/2030	171.699	0,55	EUR	141.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	95.930	0,30
EUR	201.000	National Australia Bank Limited 2.13% 24/05/2028	185.355	0,59	EUR	100.000	La Banque Postale SA FRN 26/01/2031	85.159	0,27
GBP	110.000	Pacific National Finance Pty Ltd 5.00% 19/09/2023	123.363	0,39	EUR	52.000	RCI Banque SA 4.88% 21/09/2028	50.353	0,16
USD	400.000	SGSP Australia Assets Pty Limited 3.25% 29/07/2026	372.994	1,19	EUR	200.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 1.50% 27/09/2030	167.880	0,53
Total de Australia			1.575.388	5,00	Total de Francia			1.371.465	4,34
BÉLGICA				ALEMANIA					
EUR	200.000	Elia Transmission Belgium SA 0.88% 28/04/2030	160.312	0,51	EUR	300.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	246.121	0,78
EUR	200.000	Kbc Group NV - Perp FRN	159.581	0,51	EUR	400.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	276.799	0,87
Total de Bélgica			319.893	1,02	EUR	200.000	Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032	196.739	0,63
ISLAS CAIMÁN				INDIA					
GBP	530.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	487.247	1,54	EUR	200.000	Bayer AG 1.00% 12/01/2036	127.740	0,41
USD	210.000	Tencent Holdings Limited 3.24% 03/06/2050	130.084	0,41	EUR	400.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	364.701	1,16
GBP	200.000	Thames Water Utilities Finance plc 2.38% 03/05/2023	222.838	0,71	EUR	200.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	151.638	0,48
Total de Islas Caimán			840.169	2,66	EUR	100.000	Vier Gas Transport GmbH 0.13% 10/09/2029	72.743	0,23
DINAMARCA				Total de Alemania					
EUR	100.000	Danske Bank AS FRN 15/05/2031	83.786	0,27	EUR	100.000	Vier Gas Transport GmbH 4.00% 26/09/2027	98.201	0,31
Total de Dinamarca			83.786	0,27	EUR	400.000	Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	391.323	1,25
FINLANDIA				Total de Alemania					
EUR	243.000	Nordea Bank Abp 0.50% 14/05/2027	212.294	0,67	EUR	160.000	Volkswagen Financial Services AG 0.13% 12/02/2027	134.855	0,43
EUR	643.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	534.461	1,70	EUR	250.000	Volkswagen Leasing GmbH 0.38% 20/07/2026	218.739	0,70
Total de Finlandia			746.755	2,37	EUR	300.000	Vonovia SE 1.50% 14/06/2041	163.782	0,52
				Total de Alemania					
				INDIA					
				USD					
				334.000					
				Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029				286.624	0,91
				Total de India				286.624	0,91

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)							
IRLANDA				PAÍSES BAJOS (continuación)							
EUR	296.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	267.414	0,85	GBP	213.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	234.510	0,75		
EUR	125.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	108.782	0,35	EUR	100.000	Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	77.554	0,25		
EUR	290.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	237.377	0,75	EUR	200.000	ING Groep NV FRN 29/09/2028	162.575	0,52		
Total de Irlanda			613.573	1,95	USD	400.000	ING Groep NV - Perp FRN	268.991	0,85		
ITALIA				PAÍSES BAJOS (continuación)							
EUR	100.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	71.835	0,23	EUR	100.000	Sagax Euro MTN BV 0.75% 26/01/2028	71.980	0,23		
EUR	100.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	77.340	0,25	EUR	460.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	364.760	1,15		
EUR	140.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	99.610	0,32	EUR	287.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	228.284	0,73		
EUR	220.000	Banco BPM SpA 2.50% 21/06/2024	212.127	0,67	EUR	169.000	TenneT Holding BV - Perp FRN	153.189	0,49		
Total de Italia			460.912	1,47	EUR	200.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	162.721	0,52		
JERSEY - ISLAS DEL CANAL				PAÍSES BAJOS (continuación)							
USD	330.104	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.16% 31/03/2034	277.299	0,88	EUR	100.000	Universal Music Group NV 3.75% 30/06/2032	93.564	0,30		
EUR	136.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	104.512	0,33	EUR	100.000	Volkswagen International Finance NV - Perp FRN	78.473	0,25		
Total de Jersey - Islas del Canal			381.811	1,21	Total de Países Bajos			2.636.509	8,40		
LUXEMBURGO				NORUEGA							
EUR	300.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	227.502	0,72	EUR	325.000	DNB Bank ASA FRN 23/02/2029	263.433	0,84		
EUR	300.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	226.043	0,72	Total de Noruega			263.433	0,84		
EUR	220.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.33% 13/08/2028	179.586	0,57	ESPAÑA						
EUR	200.000	Grand City Properties SA - Perp FRN	142.791	0,45	GBP	200.000	Banco Santander SA FRN 30/08/2028	207.789	0,66		
EUR	110.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.63% 15/10/2050	66.607	0,21	Total de España			207.789	0,66		
EUR	368.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	273.392	0,87	SUECIA						
EUR	231.000	Selp Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	213.522	0,68	EUR	358.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	286.922	0,91		
Total de Luxemburgo			1.329.443	4,22	EUR	100.000	Sagax AB 2.00% 17/01/2024	96.212	0,31		
PAÍSES BAJOS				SUECIA							
EUR	100.000	Alliander NV 2.63% 09/09/2027	97.066	0,31	Total de Suecia			383.134	1,22		
EUR	600.000	Cooperatieve Rabobank UA - Perp FRN	458.370	1,46	SUIZA						
EUR	240.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	184.472	0,59	EUR	257.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	195.077	0,62		
				EUR				160.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	95.968	0,30
				EUR				120.000	Credit Suisse Group AG FRN 02/04/2032	93.093	0,30
				USD				400.000	Credit Suisse Group AG - Perp FRN	376.503	1,20
				EUR				308.000	UBS AG 0.50% 31/03/2031	230.859	0,73
				USD				200.000	UBS Group AG - Perp FRN	173.503	0,55

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)					
SUIZA (continuación)				REINO UNIDO (continuación)					
USD	200.000	UBS Group Funding Switzerland AG - Perp FRN	193.554	0,61	EUR	170.000	Nationwide Building Society 3.25% 05/09/2029	159.116	0,51
		Total de Suiza	1.358.557	4,31	EUR	149.000	NatWest Group plc FRN 14/09/2032	115.342	0,37
					GBP	130.000	NatWest Group plc FRN 28/11/2031	115.174	0,37
REINO UNIDO					EUR	313.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	248.469	0,78
GBP	149.000	Anglian Water Osprey Financing plc 2.00% 31/07/2028	122.491	0,39	GBP	150.000	Santander UK plc - Perp 10.06%	263.916	0,84
EUR	100.000	Anglo American Capital plc 4.75% 21/09/2032	96.789	0,31	GBP	100.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	97.505	0,31
GBP	225.000	Barclays Bank plc 5.75% 14/09/2026	241.571	0,77	GBP	204.550	Tesco Property Finance 7.62% 13/07/2039	238.781	0,76
EUR	100.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	70.408	0,22	GBP	96.284	Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	94.535	0,30
GBP	350.000	Barclays plc - Perp FRN	362.814	1,15	EUR	200.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.19% 23/10/2023	192.064	0,61
GBP	300.000	BAT International Finance plc 2.25% 26/06/2028	253.201	0,80	EUR	376.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	311.070	0,99
USD	139.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	131.689	0,42	GBP	128.000	Virgin Money UK plc FRN 19/08/2031	112.923	0,36
GBP	44.500	Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	45.080	0,14	EUR	100.000	Western Power Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	96.235	0,31
GBP	246.000	Bupa Finance plc 5.00% 25/04/2023	278.195	0,89			Total de Reino Unido	7.288.818	23,17
GBP	224.000	BUPA Finance plc - Perp FRN	152.266	0,48	ESTADOS UNIDOS				
EUR	196.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	146.504	0,47	USD	258.000	Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	230.743	0,73
EUR	133.000	Cadent Finance plc 0.75% 11/03/2032	93.253	0,30	USD	407.000	Bank of America Corp. FRN 22/04/2032	324.310	1,03
GBP	100.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	103.102	0,33	USD	260.000	Becton Dickinson and Company 1.96% 11/02/2031	204.948	0,65
EUR	152.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	144.887	0,46	EUR	160.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 1.50% 18/03/2030	134.355	0,43
EUR	648.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	617.676	1,96	EUR	110.000	Berkshire Hathaway Inc. 0.50% 15/01/2041	59.472	0,19
GBP	500.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	487.394	1,55	EUR	189.000	Digital Euro Finco LLC 1.13% 09/04/2028	152.527	0,48
EUR	700.000	HSBC Holdings plc FRN 04/01/2066	540.930	1,72	EUR	118.000	Eli Lilly & Company 1.38% 14/09/2061	60.741	0,19
USD	380.000	Imperial Brands Finance plc 3.50% 26/07/2026	351.523	1,12	USD	71.000	Goodman USA Finance Three 3.70% 15/03/2028	65.748	0,21
GBP	126.000	Legal & General Group plc FRN 26/11/2049	107.170	0,34	USD	451.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	356.688	1,13
GBP	100.000	Legal & General Group plc FRN 01/11/2050	87.996	0,28	GBP	128.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	129.370	0,41
GBP	300.000	Lloyds Banking Group plc - Perp FRN	297.704	0,95	USD	136.000	Lowe's Companies Inc. 5.80% 15/09/2062	128.057	0,41
GBP	44.101	Marston's Issuer plc FRN 15/10/2027	45.353	0,14	EUR	548.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	470.408	1,50
EUR	130.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.87% 26/11/2040	69.436	0,22					
EUR	500.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	396.256	1,25					

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)				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario							
Bonos (continuación)				Bonos							
ESTADOS UNIDOS (continuación)				BERMUDAS							
EUR	100.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	88.572	0,28	USD	320.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	313.713	1,00		
USD	179.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	152.275	0,48	USD	333.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	317.312	1,01		
EUR	130.000	Southern Company FRN 15/09/2081	91.418	0,29	Total de Bermudas						
GBP	245.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	244.584	0,78	631.025 2,01						
Total de Estados Unidos		2.894.216	9,19	DINAMARCA							
Total de bonos				25.485.656	80,98	USD	442.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	378.933	1,20	
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				25.485.656	80,98	Total de Dinamarca					
						378.933 1,20					
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				FRANCIA							
Bonos				USD				500.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	421.228	1,34
AUSTRALIA				Total de Francia				421.228	1,34		
USD	330.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	307.947	0,98	ESTADOS UNIDOS						
Total de Australia				307.947	0,98	USD	271.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	219.543	0,70	
						USD	200.000	Stellantis Finance US Inc. 6.38% 12/09/2032	189.932	0,60	
PAÍSES BAJOS				Total de Estados Unidos				409.475	1,30		
USD	50.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	50.779	0,16	Total de bonos						
Total de Países Bajos				50.779	0,16	1.840.661 5,85					
ESTADOS UNIDOS				Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				1.840.661	5,85		
USD	309.000	Warnermedia Holdings Inc. 4.28% 15/03/2032	259.706	0,82	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios						
USD	240.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	178.569	0,57	Fondos						
Total de Estados Unidos				438.275	1,39	IRLANDA					
Total de bonos				797.001	2,53	5.273	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	517.002	1,64		
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				797.001	2,53	Total de Irlanda					
						517.002 1,64					
						Total de fondos					
						517.002 1,64					
						Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios					
						517.002 1,64					
						Valor total de las inversiones					
						28.640.320 91,00					
						(Coste total: 33.797.877 EUR)					

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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)			
DINAMARCA				SUECIA (continuación)			
27.579	Novo-Nordisk A/S	2.824.127	3,00	127.395	Sandvik AB	1.787.585	1,90
117.150	Tryg A/S	2.472.055	2,63				
	Total de Dinamarca	5.296.182	5,63		Total de Suecia	3.885.352	4,13
FRANCIA				SUIZA			
33.541	Air Liquide SA	3.943.081	4,20	14.326	Compagnie Financiere Richemont SA - Reg	1.400.774	1,49
78.496	Compagnie de Saint-Gobain	2.908.277	3,09	18.863	Nestle SA - Reg	2.094.801	2,23
5.119	Kering	2.347.318	2,50	24.606	Novartis AG - Reg	1.927.454	2,05
12.898	L'Oreal SA	4.259.565	4,53	4.702	Roche Holding AG	1.577.297	1,68
6.954	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	4.244.722	4,52	8.523	Sika AG	1.774.040	1,89
22.785	Pernod-Ricard SA	4.302.947	4,58	298.448	UBS Group AG	4.480.339	4,77
102.138	Publicis Groupe SA	4.994.548	5,31		Total de Suiza	13.254.705	14,11
15.955	Remy Cointreau	2.726.710	2,90				
15.287	Teleperformance	3.988.378	4,24				
	Total de Francia	33.715.546	35,87	REINO UNIDO			
ALEMANIA				51.439	InterContinental Hotels Group plc	2.560.852	2,72
45.797	Beiersdorf AG	4.623.206	4,92	8.492	Linde plc	2.370.966	2,52
23.271	SAP SE	1.957.557	2,08		Total de Reino Unido	4.931.818	5,24
	Total de Alemania	6.580.763	7,00	Total de renta variable			
ITALIA						83.473.090	88,78
40.000	Moncler SpA	1.695.600	1,80	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
	Total de Italia	1.695.600	1,80			83.473.090	88,78
PAÍSES BAJOS				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
9.977	ASM International NV	2.332.124	2,48	Fondos			
8.413	ASML Holding NV	3.647.877	3,88	IRLANDA			
1.792	Koninklijke DSM NV	210.470	0,22	59	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	5.776	0,01
30.501	Wolters Kluwer NV	3.047.660	3,24		Total de Irlanda	5.776	0,01
	Total de Países Bajos	9.238.131	9,82	Total de fondos			
NORUEGA						5.776	0,01
29.268	DNB Bank ASA	473.885	0,50	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
	Total de Noruega	473.885	0,50			5.776	0,01
ESPAÑA				Valor total de las inversiones			
91.862	Amadeus IT Holding SA - A	4.401.108	4,68			83.478.866	88,79
	Total de España	4.401.108	4,68	(Coste total: 91.774.374 EUR)			
SUECIA				<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>			
142.406	Epiroc AB	2.097.767	2,23				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
25.716	Globalfoundries Inc.	1.243.369	1,49	7.810	Svb Financial Group	2.622.442	3,15
	Total de Islas Caimán	1.243.369	1,49	30.646	Teradata Corp.	951.865	1,14
ESTADOS UNIDOS				2.812	Teradyne Inc.	211.322	0,25
18.851	Advanced Micro Devices Inc.	1.194.399	1,43	23.576	Transunion	1.402.537	1,68
77.795	AES Corp.	1.758.167	2,11	11.478	Trimble Navigation Limited	622.911	0,75
508	Agco Corp.	48.854	0,06	20.279	Uber Technologies Inc.	537.394	0,65
37.376	Alphabet Inc. - A	3.575.014	4,29	25.477	United Parcel Service Inc.	4.115.555	4,94
21.080	American Electric Power Company Inc.	1.822.366	2,19	23.791	Vertex Pharmaceuticals Inc.	6.888.446	8,27
6.373	Applied Industrial Technologies Inc.	655.017	0,79	24.045	Voya Financial Inc.	1.454.723	1,75
34.671	Aris Water Solution Inc.	442.402	0,53	15.542	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	626.809	0,75
4.127	Beacon Roofing Supply Inc.	225.829	0,27	21.500	Xponential Fitness Inc.	392.590	0,47
2.192	Cintas Corp.	850.912	1,02		Total de Estados Unidos	81.743.438	98,13
11.134	Cirrus Logic Inc.	766.019	0,92		Total de renta variable	82.986.807	99,62
3.689	Coca Cola Company	206.658	0,25		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	82.986.807	99,62
4.243	Conmed Corp.	340.161	0,41		Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		
17.537	Crowdstrike Holdings Inc. - A	2.890.273	3,47		Fondos		
64.488	CVS Health Corp.	6.150.221	7,38		IRLANDA		
27.154	Darling Ingredients Inc.	1.796.237	2,16	9.510	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	9.510	0,01
34.654	Domo Inc.	623.425	0,75		Total de Irlanda	9.510	0,01
13.749	Doximity Inc.	415.495	0,50		Total de fondos	9.510	0,01
14.449	Exact Sciences Corp.	469.448	0,56		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	9.510	0,01
2.692	Generac Holdings Inc.	479.553	0,58		Valor total de las inversiones	82.996.317	99,63
5.612	Herc Holdings Inc.	582.975	0,70		(Coste total: 99.666.932 USD)		
35.039	Hilton Worldwide Holdings Inc.	4.226.404	5,07				
4.682	Home Depot Inc.	1.291.951	1,56				
8.858	Hostess Brands Inc.	205.860	0,25				
2.057	Installed Building Products Inc.	166.596	0,20				
13.306	Kellogg Company	926.896	1,11				
21.687	Kohl's Corp.	545.428	0,65				
66.430	Kontoor Brands Inc.	2.232.712	2,68				
9.133	Lam Research Corp.	3.342.677	4,02				
59.857	Livent Corp.	1.834.617	2,20				
10.970	Microsoft Corp.	2.554.913	3,06				
14.524	Mirati Therapeutics Inc.	1.014.356	1,22				
28.333	NCino Inc.	966.439	1,16				
36.491	Northern Trust Corp.	3.122.170	3,75				
236.640	Nov Inc.	3.828.835	4,60				
7.424	Qualcomm Inc.	838.764	1,01				
34.156	Ranpak Holdings Corp.	116.814	0,14				
19.058	Salesforce.com Inc.	2.741.303	3,28				
39.365	Schnitzer Steel Industries Inc.	1.120.328	1,34				
600.319	Sharecare Inc.	1.140.606	1,37				
3.881	Shift4 Payments Inc.	173.131	0,21				
69.604	State Street Corp.	4.232.619	5,08				

*Diferencias menores debido al redondeo.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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				JAPÓN (continuación)			
6.865	Nutrien Limited	575.560	0,77	7.600	Sony Corp.	487.572	0,66
	Total de Canadá	575.560	0,77		Total de Japón	1.612.723	2,17
ISLAS CAIMÁN				PAÍSES BAJOS			
10.177	Sea Limited	570.421	0,77	5.286	Koninklijke DSM NV	608.207	0,82
	Total de Islas Caimán	570.421	0,77		Total de Países Bajos	608.207	0,82
DINAMARCA				NORUEGA			
14.295	Novo-Nordisk A/S	1.434.039	1,93	43.152	Equinor ASA	1.418.035	1,91
14.739	Orsted A/S	1.179.718	1,59		Total de Noruega	1.418.035	1,91
40.640	Tryg A/S	840.118	1,13				
	Total de Dinamarca	3.453.875	4,65				
FRANCIA				REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
2.260	Essilor International SA	310.736	0,42	26.200	Samsung Electronics Company Limited	972.407	1,31
2.508	L'Oreal SA	811.412	1,09	3.129	Samsung Sdi Company Limited	1.194.127	1,61
1.013	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	605.752	0,82		Total de República de Corea (Sur)	2.166.534	2,92
7.994	Schneider Electric SE	915.795	1,23				
39.841	TotalEnergies SE	1.884.185	2,53				
	Total de Francia	4.527.880	6,09				
ALEMANIA				SINGAPUR			
5.738	Adidas AG	668.252	0,89	50.200	DBS Group Holdings Limited	1.168.150	1,57
	Total de Alemania	668.252	0,89		Total de Singapur	1.168.150	1,57
INDIA				SUIZA			
123.734	HDFC Bank Limited	2.161.785	2,92	3.431	Roche Holding AG	1.127.515	1,52
	Total de India	2.161.785	2,92		Total de Suiza	1.127.515	1,52
INDONESIA				TAIWÁN			
1.759.949	Bank Rakyat Indonesia	518.936	0,70	130.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	1.727.926	2,32
	Total de Indonesia	518.936	0,70		Total de Taiwán	1.727.926	2,32
IRLANDA				REINO UNIDO			
896	CRH plc	29.028	0,04	26.083	Anglo American plc	796.481	1,07
7.635	Trane Technologies plc	1.105.624	1,49	22.926	Diageo plc	971.867	1,31
	Total de Irlanda	1.134.652	1,53	42.853	SSE plc	730.707	0,98
					Total de Reino Unido	2.499.055	3,36
JAPÓN				ESTADOS UNIDOS			
3.400	Keyence Corp.	1.125.151	1,51	8.178	Abbott Laboratories	791.303	1,06
				1.214	Adobe Systems Inc.	334.093	0,45
				2.041	Alphabet Inc. - A	195.222	0,26

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*	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			
38.905	Amazon.com Inc.	4.396.264	5,91	3.926.569	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	3.926.569	5,28
6.149	American Tower Corp.	1.320.191	1,78				
1.060	Autodesk Inc.	198.008	0,27		Total de Irlanda	3.926.569	5,28
20.341	Comcast Corp.	596.602	0,80				
3.305	Cooper Companies Inc.	872.190	1,17		Total de fondos	3.926.569	5,28
3.822	Deere & Company	1.276.128	1,72		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	3.926.569	5,28
6.765	Ecolab Inc.	977.001	1,32		Valor total de las inversiones	66.647.034	89,69
9.143	Electronic Arts Inc.	1.057.937	1,42				
1.728	Elevance Health Inc.	784.927	1,06		(Coste total: 75.479.662 USD)		
4.851	Eli Lilly & Company	1.568.571	2,11		<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>		
642	Equinix Inc.	365.195	0,49				
8.623	First Republic Bank	1.125.733	1,51				
13.887	General Motors Company	445.634	0,60				
8.376	IntercontinentalExchange Inc.	756.771	1,02				
5.118	Intuit Inc.	1.982.303	2,67				
3.579	JPMorgan Chase & Company	374.006	0,50				
3.372	Mastercard Inc. - A	958.794	1,29				
1.441	Mercadolibre Inc.	1.192.831	1,61				
8.141	NextEra Energy Inc.	638.336	0,86				
6.990	Nvidia Corp.	848.516	1,14				
9.813	Paypal Holdings Inc.	844.605	1,14				
14.445	Qualcomm Inc.	1.631.996	2,20				
1.665	S&P Global Inc.	508.408	0,68				
3.602	Svb Financial Group	1.209.479	1,63				
2.395	Thermo Fisher Scientific Inc.	1.214.720	1,63				
30.655	T-Mobile USA Inc.	4.112.981	5,53				
13.230	Trimble Navigation Limited	717.992	0,97				
40.651	Uber Technologies Inc.	1.077.252	1,45				
3.989	Union Pacific Corp.	777.137	1,05				
17.278	Walt Disney Company	1.629.833	2,20				
	Total de Estados Unidos	36.780.959	49,50				
	Total de renta variable	62.720.465	84,41				
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	62.720.465	84,41				

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre 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%	4.563.541	1,31
	Total de Irlanda	4.563.541	1,31
Total de instrumentos estructurados - Materias primas		4.563.541	1,31
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		4.563.541	1,31
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 35.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 06/10/2022	34.992.444	10,05
USD 52.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 13/10/2022	51.961.931	14,92
USD 60.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 20/10/2022	59.926.008	17,21
USD 65.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 03/11/2022	64.849.986	18,62
USD 75.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 25/11/2022	74.682.134	21,45
USD 10.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 01/12/2022	9.951.792	2,86
USD 35.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 08/12/2022	34.807.861	10,00
	Total de Estados Unidos	331.172.156	95,11
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda		331.172.156	95,11
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		331.172.156	95,11
Valor total de las inversiones		335.735.697	96,42
(Coste total: 335.401.936 USD)			

* Diferencias menores debido al redondeo.

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 periodo:

Nuevo folleto

Se ha publicado un nuevo Folleto en julio de 2022.

Reducción de comisiones y gastos

A partir del 1 de agosto de 2022, las Comisiones de gestión de activos y las comisiones de Gastos operativos se han reducido en algunas Clases de Acciones de varias Carteras, como se indica en la Nota 5.

Lanzamiento de Clases de Acciones

Las siguientes clases de acciones se lanzaron durante el periodo finalizado el 30 de septiembre de 2022:

Clase de Acciones	Cartera	Fecha Efectiva
ASH	Threadneedle (Lux) - Global Focus	27 de abril de 2022
ASH	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	27 de abril de 2022

A 30 de septiembre 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

Notas a los estados financieros

(continuación)

1 GENERAL

(continuación)

- 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

Las Carteras de Extended Alpha:

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

La Cartera de especialistas:

- Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

¹ A 30 de septiembre 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.

2 RESUMEN DE POLÍTICAS CONTABLES SIGNIFICATIVAS

Los estados financieros se preparan y presentan de acuerdo con 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 calcula a 30 de septiembre de 2022. El último Valor liquidativo oficial de las Carteras correspondientes se ha calculado a partir del 30 de septiembre 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 Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity Portfolio, 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.

1) 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 el precio será determinado por la SICAV, 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.

Notas a los estados financieros

(continuación)

2 RESUMEN DE POLÍTICAS CONTABLES SIGNIFICATIVAS

(continuación)

II) Contratos de divisas a plazo

Con el fin de cubrir el riesgo de divisa específico o la inversión en otras divisas, la SICAV podrá celebrar contratos de divisas a plazo. Al final del periodo, 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 30 de septiembre 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 de la bolsa para la 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 30 de septiembre 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 caja 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 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 30 de septiembre de 2022 figuran en la Nota 10. Los dividendos a 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 30 de septiembre 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 30 de septiembre 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 operaciones con 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 periodo, 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 30 de septiembre de 2022 son: 1 USD = 1,555331 AUD, 1 USD = 1,020773 EUR, 1 USD = 0,895817 GBP, 1 USD = 0,984250 CHF, 1 USD = 11,097547 SEK, 1 USD = 7,589902 DKK, 1 USD = 10,897282 NOK, 1 USD = 7,849910 HKD y 1 USD = 1,434899 SGD.

La diferencia entre el patrimonio neto de apertura declarado a los tipos de cambio vigentes al inicio del periodo y su valor al final del periodo se muestra como un ajuste de conversión de divisa en el Estado consolidado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto según el encabezamiento 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.

Notas a los estados financieros

(continuación)

2 RESUMEN DE POLÍTICAS CONTABLES SIGNIFICATIVAS

(continuación)

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 el periodo 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.

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 de conformidad con 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 las sanciones debidas en virtud del Reglamento de depositarios centrales de valores y de las indemnizaciones a los inversores perjudicados por un error en el VL.

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 términos comerciales normales y sean en el mejor interés de la Cartera correspondiente y sus Accionistas.

Para el periodo que finaliza el 30 de septiembre de 2022, la SICAV no realizó operaciones con personas relacionadas.

La SICAV ha nombrado a Threadneedle Management Luxembourg S.A. (la «Sociedad Gestora») para que actúe como su Sociedad Gestora designada de conformidad con el 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.

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

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 Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha Portfolio, con respecto a todas las Acciones J e Y de Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Portfolio y con respecto a todas las Acciones A, D, I, L y Z de Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha Portfolio.

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», juntos, los «Gastos») se fijan a las tasas mostradas en las tablas de la página 223 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 apoderados, certificados de acciones, informes y avisos de 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 a pagar 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.

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 223 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 Threadneedle (Lux) - Global Technology Portfolio.

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 su totalidad 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%	0,20% ¹	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,60% ²	0,20% ³	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	1,25%	0,20% ³	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%	0,20% ¹	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,35%	0,20% ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,35%	0,20% ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,30%	0,20% ³	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) - US High Yield Bond	1,25%	0,20% ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,90%	0,20% ¹	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%	0,20% ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,50%	0,20% ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,50%	0,20% ³	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
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,30%	0,20% ¹	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%	0,20% ³	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%	0,20% ¹	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

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

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 su totalidad 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%	0,20% ¹	USD
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	1,45%	0,20% ¹	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,45%	0,20% ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,45%	0,20% ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,45%	0,20% ³	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	1,45%	0,20% ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	1,20%	0,20% ¹	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%	0,20% ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	2,25%	0,20% ³	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%	0,20% ¹	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%	0,20% ³	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%	0,20% ¹	USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

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	0,40% ⁴	0,10% ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,40%	0,10% ⁶	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,55% ⁷	0,10% ⁶	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%	0,10% ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,65%	0,10% ⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,65%	0,10% ⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,65%	0,10% ⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,55%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,40%	0,10% ⁵	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%	0,10% ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75%	0,10% ⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75%	0,10% ⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75%	0,10% ⁶	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%	0,10% ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,50%	0,15%	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%	0,10% ⁶	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

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	0,80%	0,10% ⁵	USD

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%	0,10% ⁶	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 su totalidad 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%	0,10% ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,50%	0,20%	GBP
Carteras de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,20%	0,10% ⁶	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 su totalidad 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%	0,10% ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30%	0,10%	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 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
Cartera de especialistas				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,45%	0,10% ⁵	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 su totalidad 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%	0,20% ³	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 su totalidad 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 su totalidad 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%	0,20% ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,00%	0,20% ³	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
Cartera de asignación de activos				
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	1,40%	0,35%	USD
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,40%	0,20% ⁸	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%	0,20% ⁸	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	0,10% ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,10% ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,10% ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,10% ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,10% ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,10% ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,10% ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,10% ⁵	USD
Carteras de renta variable			
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	0,10% ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,10% ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,10% ⁵	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	0,10% ⁵	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	0,10% ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,15%	EUR
Cartera de especialistas			
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,10% ⁵	USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

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%

Los costes de venta son los máximos, a los que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en su totalidad 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%	0,15% ¹	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 su totalidad 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%	0,15% ⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,40%	0,15% ³	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60%	0,15% ³	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%	0,15% ¹	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,60%	0,15% ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,60%	0,15% ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,60%	0,15% ³	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,60%	0,15% ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,40%	0,15% ¹	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%	0,15% ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75%	0,15% ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75%	0,15% ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75%	0,15% ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	0,75%	0,25%	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 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%	0,15% ¹	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
	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%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,45%	0,15% ¹	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%	0,15% ¹	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 su totalidad 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

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 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

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%	USD
	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

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

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 su totalidad 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
	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

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

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
	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%	0,10% ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60%	0,10% ⁹	EUR
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75%	0,14%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75%	0,10% ¹⁰	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%	0,10% ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75%	0,16%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75%	0,12%	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 renta variable				
<i>(continuación)</i>				
	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 22.

¹ 0,25% hasta el 31 de julio de 2022.² 0,90% hasta el 31 de julio de 2022.³ 0,30% hasta el 31 de julio de 2022.⁴ 0,50% hasta el 31 de julio de 2022.⁵ 0,15% hasta el 31 de julio de 2022.⁶ 0,20% hasta el 31 de julio de 2022.⁷ 0,65% hasta el 31 de julio de 2022.⁸ 0,35% hasta el 31 de julio de 2022.⁹ 0,13% hasta el 31 de julio de 2022.¹⁰ 0,11% hasta el 31 de julio de 2022.

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 obtienen directamente de dichos corredores de bolsa/agentes o de terceros y son pagados por los corredores de bolsa/agentes con cargo a las comisiones que ellos mismos perciben en concepto de operaciones para la SICAV. En consonancia con la obtención de la mejor ejecución, las comisiones de corretaje sobre las operaciones de cartera de la SICAV pueden ser asignadas específicamente por la Sociedad Gestora o por cada uno de los Subasesores pertinentes a los corredores de bolsa/agentes en consideración de los servicios de investigación prestados, así como por 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 periodo finalizado el 30 de septiembre 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	24/06/2022	EUR	0,070	111.727
	Clase AEC	26/09/2022	EUR	0,080	117.303
	Clase AUP	24/06/2022	USD	0,082	9.754
	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,086	10.591
	Clase DEC	24/06/2022	EUR	0,064	6.059

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 DEC	26/09/2022	EUR	0,069	6.318
	Clase DUP	24/06/2022	USD	0,074	4.718
	Clase DUP	26/09/2022	USD	0,079	4.845
	Clase IEC	24/06/2022	EUR	0,071	26.772
	Clase IEC	26/09/2022	EUR	0,079	15.785
	Clase IEP	24/06/2022	EUR	0,083	7
	Clase IEP	26/09/2022	EUR	0,097	7
	Clase IGC	24/06/2022	GBP	0,074	98
	Clase IGC	26/09/2022	GBP	0,085	57
	Clase IUP	24/06/2022	USD	0,079	43.205
	Clase IUP	26/09/2022	USD	0,085	44.685
	Clase NEC	24/06/2022	EUR	0,071	9.821
	Clase NEC	26/09/2022	EUR	0,079	15.222
	Clase NGC	24/06/2022	GBP	0,073	1.383.354
	Clase NGC	26/09/2022	GBP	0,083	2.485.421
	Clase NUP	24/06/2022	USD	0,078	6.297
	Clase NUP	26/09/2022	USD	0,082	7.210
					4.309.256 USD
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond					
	Clase IEP	24/06/2022	EUR	0,034	3
	Clase IEP	26/09/2022	EUR	0,039	3
					6 EUR
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond					
	Clase 1UT	25/04/2022	USD	0,029	7.694
	Clase 1UT	23/05/2022	USD	0,029	7.800
	Clase 1UT	24/06/2022	USD	0,034	8.798
	Clase 1UT	25/07/2022	USD	0,031	8.309
	Clase 1UT	24/08/2022	USD	0,037	6.635
	Clase 1UT	26/09/2022	USD	0,029	5.351
					44.587 EUR
Threadneedle (Lux) - European Social Bond					
	Clase AEP	24/06/2022	EUR	0,026	1.170
	Clase AEP	26/09/2022	EUR	0,028	1.269
	Clase ASC	24/06/2022	SGD	0,028	2
	Clase ASC	26/09/2022	SGD	0,030	2
	Clase AUC	24/06/2022	USD	0,027	3
	Clase AUC	26/09/2022	USD	0,027	3
	Clase IEP	24/06/2022	EUR	0,027	77.800
	Clase IEP	26/09/2022	EUR	0,030	81.738
	Clase ISC	24/06/2022	SGD	0,028	2
	Clase ISC	26/09/2022	SGD	0,031	2
	Clase IUC	24/06/2022	USD	0,026	2.431
	Clase IUC	26/09/2022	USD	0,031	2.306
	Clase NEP	24/06/2022	EUR	2,732	267.909
	Clase NEP	26/09/2022	EUR	2,817	290.888
	Clase ZEP	24/06/2022	EUR	0,028	16.537
	Clase ZEP	26/09/2022	EUR	0,029	16.855
	Clase ZGC	24/06/2022	GBP	0,026	130.082

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 Social Bond					
<i>(continuación)</i>					
	Clase ZGC	26/09/2022	GBP	0,030	165.116
					1.054.115 EUR
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond					
	Clase AEP	25/04/2022	EUR	0,033	22.417
	Clase AEP	23/05/2022	EUR	0,033	22.344
	Clase AEP	24/06/2022	EUR	0,034	23.102
	Clase AEP	25/07/2022	EUR	0,034	23.342
	Clase AEP	24/08/2022	EUR	0,034	23.523
	Clase AEP	26/09/2022	EUR	0,038	26.906
	Clase DEP	25/04/2022	EUR	0,025	39.717
	Clase DEP	23/05/2022	EUR	0,025	38.868
	Clase DEP	24/06/2022	EUR	0,025	38.637
	Clase DEP	25/07/2022	EUR	0,025	38.247
	Clase DEP	24/08/2022	EUR	0,025	38.091
	Clase DEP	26/09/2022	EUR	0,029	44.199
					379.393 EUR
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds					
	Clase AEC	25/04/2022	EUR	0,037	15.705
	Clase AEC	23/05/2022	EUR	0,037	15.595
	Clase AEC	24/06/2022	EUR	0,037	15.700
	Clase AEC	25/07/2022	EUR	0,037	19.546
	Clase AEC	24/08/2022	EUR	0,037	19.302
	Clase AEC	26/09/2022	EUR	0,040	20.385
	Clase AUP	25/04/2022	USD	0,024	17.340
	Clase AUP	23/05/2022	USD	0,024	16.918
	Clase AUP	24/06/2022	USD	0,024	16.852
	Clase AUP	25/07/2022	USD	0,024	16.725
	Clase AUP	24/08/2022	USD	0,024	16.576
	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,027	18.566
	Clase DEC	25/04/2022	EUR	0,027	1.275
	Clase DEC	23/05/2022	EUR	0,027	1.214
	Clase DEC	24/06/2022	EUR	0,027	1.218
	Clase DEC	25/07/2022	EUR	0,027	1.156
	Clase DEC	24/08/2022	EUR	0,027	1.100
	Clase DEC	26/09/2022	EUR	0,029	1.093
	Clase IEC	25/04/2022	EUR	0,029	6.065
	Clase IEC	23/05/2022	EUR	0,029	5.943
	Clase IEC	24/06/2022	EUR	0,029	5.964
	Clase IEC	25/07/2022	EUR	0,029	5.758
	Clase IEC	24/08/2022	EUR	0,029	5.621
	Clase IEC	26/09/2022	EUR	0,031	6.441
	Clase XUP	24/06/2022	USD	0,115	10
	Clase XUP	26/09/2022	USD	0,120	10
					252.078 USD
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt					
	Clase AEC	25/04/2022	EUR	0,032	1.686
	Clase AEC	23/05/2022	EUR	0,032	1.653

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					
<i>(continuación)</i>					
	Clase AEC	24/06/2022	EUR	0,030	1.526
	Clase AEC	25/07/2022	EUR	0,030	1.474
	Clase AEC	24/08/2022	EUR	0,030	1.440
	Clase AEC	26/09/2022	EUR	0,030	1.400
	Clase AUP	25/04/2022	USD	0,039	106.882
	Clase AUP	23/05/2022	USD	0,039	105.977
	Clase AUP	24/06/2022	USD	0,037	99.530
	Clase AUP	25/07/2022	USD	0,037	98.705
	Clase AUP	24/08/2022	USD	0,037	98.021
	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,037	97.393
	Clase SUP	25/04/2022	USD	0,038	1.848
	Clase SUP	23/05/2022	USD	0,038	1.801
	Clase SUP	24/06/2022	USD	0,036	1.666
	Clase SUP	25/07/2022	USD	0,036	1.596
	Clase SUP	24/08/2022	USD	0,036	1.596
	Clase SUP	26/09/2022	USD	0,036	1.596
	Clase XUP	24/06/2022	USD	0,119	11
	Clase XUP	26/09/2022	USD	0,110	10
					625.811 USD
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds					
	Clase AEC	25/04/2022	EUR	0,018	48.010
	Clase AEC	23/05/2022	EUR	0,018	47.011
	Clase AEC	24/06/2022	EUR	0,018	47.495
	Clase AEC	25/07/2022	EUR	0,018	46.495
	Clase AEC	24/08/2022	EUR	0,018	45.675
	Clase AEC	26/09/2022	EUR	0,017	42.107
	Clase ASC	25/04/2022	SGD	0,025	859
	Clase ASC	23/05/2022	SGD	0,025	860
	Clase ASC	24/06/2022	SGD	0,025	861
	Clase ASC	25/07/2022	SGD	0,025	856
	Clase ASC	24/08/2022	SGD	0,025	856
	Clase ASC	26/09/2022	SGD	0,024	8.990
	Clase AUP	25/04/2022	USD	0,019	27.434
	Clase AUP	23/05/2022	USD	0,019	26.923
	Clase AUP	24/06/2022	USD	0,019	26.758
	Clase AUP	25/07/2022	USD	0,019	26.268
	Clase AUP	24/08/2022	USD	0,019	26.190
	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,019	25.973
	Clase XUP	25/04/2022	USD	0,034	12.704
	Clase XUP	23/05/2022	USD	0,034	12.330
	Clase XUP	24/06/2022	USD	0,034	12.330
	Clase XUP	25/07/2022	USD	0,034	12.330
	Clase XUP	24/08/2022	USD	0,034	12.330
	Clase XUP	26/09/2022	USD	0,033	11.511
					523.156 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) - US High Yield Bond	Clase AEC	25/04/2022	EUR	0,048	1.057
	Clase AEC	23/05/2022	EUR	0,048	964
	Clase AEC	24/06/2022	EUR	0,046	927
	Clase AEC	25/07/2022	EUR	0,046	895
	Clase AEC	24/08/2022	EUR	0,046	874
	Clase AEC	26/09/2022	EUR	0,049	702
	Clase AUP	25/04/2022	USD	0,052	12.890
	Clase AUP	23/05/2022	USD	0,052	12.725
	Clase AUP	24/06/2022	USD	0,050	12.233
	Clase AUP	25/07/2022	USD	0,050	12.005
	Clase AUP	24/08/2022	USD	0,050	12.015
	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,053	11.574
	Clase DEC	25/04/2022	EUR	0,036	968
	Clase DEC	23/05/2022	EUR	0,036	949
	Clase DEC	24/06/2022	EUR	0,034	899
	Clase DEC	25/07/2022	EUR	0,034	868
	Clase DEC	24/08/2022	EUR	0,034	721
	Clase DEC	26/09/2022	EUR	0,037	763
	Clase IEC	25/04/2022	EUR	0,036	4
	Clase IEC	23/05/2022	EUR	0,036	4
	Clase IEC	24/06/2022	EUR	0,034	3
	Clase IEC	25/07/2022	EUR	0,034	3
	Clase IEC	24/08/2022	EUR	0,034	3
	Clase IEC	26/09/2022	EUR	0,036	3
	Clase ISC	25/04/2022	SGD	0,039	5.316
	Clase ISC	23/05/2022	SGD	0,039	5.589
	Clase ISC	24/06/2022	SGD	0,037	5.613
	Clase ISC	25/07/2022	SGD	0,037	5.888
	Clase ISC	24/08/2022	SGD	0,037	6.411
	Clase ISC	26/09/2022	SGD	0,040	7.178
Clase XUP	24/06/2022	USD	0,137	12	
Clase XUP	26/09/2022	USD	0,141	13	
					120.069 USD
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	Clase ASC	25/04/2022	SGD	0,031	97
	Clase ASC	23/05/2022	SGD	0,031	96
	Clase ASC	24/06/2022	SGD	0,031	98
	Clase ASC	25/07/2022	SGD	0,031	98
	Clase ASC	24/08/2022	SGD	0,031	101
	Clase ASC	26/09/2022	SGD	0,031	101
	Clase AUP	25/04/2022	USD	0,032	22.341
	Clase AUP	23/05/2022	USD	0,032	21.537
	Clase AUP	24/06/2022	USD	0,032	21.560
	Clase AUP	25/07/2022	USD	0,032	21.630
	Clase AUP	24/08/2022	USD	0,032	20.285
	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,033	20.982
Clase AVC	25/04/2022	AUD	0,029	2	
Clase AVC	23/05/2022	AUD	0,029	2	
Clase AVC	24/06/2022	AUD	0,029	2	

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					
<i>(continuación)</i>					
	Clase AVC	25/07/2022	AUD	0,029	2
	Clase AVC	24/08/2022	AUD	0,029	2
	Clase AVC	26/09/2022	AUD	0,030	2
	Clase ZUP	25/04/2022	USD	0,031	3
	Clase ZUP	23/05/2022	USD	0,031	3
	Clase ZUP	24/06/2022	USD	0,031	3
	Clase ZUP	25/07/2022	USD	0,031	3
	Clase ZUP	24/08/2022	USD	0,031	3
	Clase ZUP	26/09/2022	USD	0,032	3
					128.956 USD
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return					
	Clase AEP	26/09/2022	EUR	0,006	0*
	Clase IEP	26/09/2022	EUR	0,006	0*
	Clase LEP	26/09/2022	EUR	0,006	1
	Clase ZEP	26/09/2022	EUR	0,006	1
					2 EUR
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return					
	Clase AEC	25/04/2022	EUR	0,011	730
	Clase AEC	23/05/2022	EUR	0,011	723
	Clase AEC	24/06/2022	EUR	0,015	990
	Clase AEC	25/07/2022	EUR	0,015	956
	Clase AEC	24/08/2022	EUR	0,015	934
	Clase AEC	26/09/2022	EUR	0,014	848
	Clase AUP	25/04/2022	USD	0,013	4.142
	Clase AUP	23/05/2022	USD	0,013	4.075
	Clase AUP	24/06/2022	USD	0,018	5.637
	Clase AUP	25/07/2022	USD	0,018	5.620
	Clase AUP	24/08/2022	USD	0,018	5.623
	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,017	5.316
					35.594 USD
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income					
	Clase AEC	24/06/2022	EUR	0,069	313.033
	Clase AEC	26/09/2022	EUR	0,066	266.392
	Clase AEP	24/06/2022	EUR	0,089	180.810
	Clase AEP	26/09/2022	EUR	0,093	179.618
	Clase ASC	24/06/2022	SGD	0,082	1.139
	Clase ASC	26/09/2022	SGD	0,079	988
	Clase ASP	24/06/2022	SGD	0,084	332
	Clase ASP	26/09/2022	SGD	0,083	309
	Clase AUM	25/04/2022	USD	0,032	1.307
	Clase AUM	23/05/2022	USD	0,032	1.307
	Clase AUM	24/06/2022	USD	0,029	1.184
	Clase AUM	25/07/2022	USD	0,029	1.184
	Clase AUM	24/08/2022	USD	0,029	1.184
	Clase AUM	26/09/2022	USD	0,028	1.143
	Clase AUP	24/06/2022	USD	0,083	85.009
	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,079	80.027

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 DEC	24/06/2022	EUR	0,066	181.028
	Clase DEC	26/09/2022	EUR	0,062	148.914
	Clase DEP	24/06/2022	EUR	0,083	24.637
	Clase DEP	26/09/2022	EUR	0,087	23.603
	Clase DUP	24/06/2022	USD	0,075	116.300
	Clase DUP	26/09/2022	USD	0,072	99.959
	Clase ZEC	24/06/2022	EUR	0,077	8
	Clase ZEC	26/09/2022	EUR	0,073	7
	Clase ZUP	24/06/2022	USD	0,083	8
	Clase ZUP	26/09/2022	USD	0,080	8
					1.709.438 USD
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities					
	Clase AEC	26/09/2022	EUR	0,090	9
	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,085	9
	Clase ZEC	26/09/2022	EUR	0,091	9
	Clase ZUP	26/09/2022	USD	0,086	8
					35 USD
Threadneedle (Lux) - Global Focus					
	Clase AEP	26/09/2022	EUR	0,136	479.250
	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,092	3.669
	Clase IUP	26/09/2022	USD	0,094	4.737
	Clase ZEP	26/09/2022	EUR	0,141	495.188
					982.844 USD
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income					
	Clase AEC	24/06/2022	EUR	0,099	506
	Clase AEC	26/09/2022	EUR	0,074	347
	Clase AUP	24/06/2022	USD	0,106	9
	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,075	6
	Clase DEC	24/06/2022	EUR	0,097	8
	Clase DEC	26/09/2022	EUR	0,072	5
	Clase DUP	24/06/2022	USD	0,104	5.127
	Clase DUP	26/09/2022	USD	0,075	3.697
	Clase 1EP	24/06/2022	EUR	0,116	178.563
	Clase 1EP	26/09/2022	EUR	0,090	128.169
	Clase 1SC	24/06/2022	SGD	0,104	33.653
	Clase 1SC	26/09/2022	SGD	0,076	24.001
	Clase 1ST	25/04/2022	SGD	0,021	888
	Clase 1ST	23/05/2022	SGD	0,038	1.586
	Clase 1ST	24/06/2022	SGD	0,044	1.831
	Clase 1ST	25/07/2022	SGD	0,013	775
	Clase 1ST	24/08/2022	SGD	0,027	1.601
	Clase 1ST	26/09/2022	SGD	0,030	1.725
	Clase 1UP	24/06/2022	USD	0,107	43.826
	Clase 1UP	26/09/2022	USD	0,077	31.317
	Clase 1VT	25/04/2022	AUD	0,021	125
	Clase 1VT	23/05/2022	AUD	0,037	213
	Clase 1VT	24/06/2022	AUD	0,043	245

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					
<i>(continuación)</i>					
	Clase 1VT	25/07/2022	AUD	0,018	103
	Clase 1VT	24/08/2022	AUD	0,025	154
	Clase 1VT	26/09/2022	AUD	0,029	168
	Clase 2EP	24/06/2022	EUR	0,118	9
	Clase 2EP	26/09/2022	EUR	0,092	6
	Clase 2UP	24/06/2022	USD	0,109	9
	Clase 2UP	26/09/2022	USD	0,078	6
	Clase 3EP	24/06/2022	EUR	0,118	1.044.734
	Clase 3EP	26/09/2022	EUR	0,093	650.582
	Clase 3UP	24/06/2022	USD	0,110	4.337
	Clase 3UP	26/09/2022	USD	0,079	1.592
	Clase 8EP	24/06/2022	EUR	0,118	30
	Clase 8EP	26/09/2022	EUR	0,092	21
	Clase 8UP	24/06/2022	USD	0,109	6.320
	Clase 8UP	26/09/2022	USD	0,078	4.523
	Clase 9EP	24/06/2022	EUR	0,119	9
	Clase 9EP	26/09/2022	EUR	0,093	7
	Clase 9UP	24/06/2022	USD	0,110	9
	Clase 9UP	26/09/2022	USD	0,079	6
					2.170.848 USD
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	Clase XUP	26/09/2022	USD	0,185	473.152
					473.152 USD
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	Clase AEC	26/09/2022	EUR	0,123	6
	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,129	1.189
					1.195 USD
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,125	8
	Clase IEC	26/09/2022	EUR	0,121	7
					15 USD
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	Clase 1EP	26/09/2022	EUR	0,035	371.038
	Clase 1GP	26/09/2022	GBP	0,031	11.429
	Clase 2EP	26/09/2022	EUR	0,356	26
	Clase 2GP	26/09/2022	GBP	0,359	25
	Clase 3EP	26/09/2022	EUR	0,056	3.990
	Clase 3GP	26/09/2022	GBP	0,050	34.197
	Clase 4GP	26/09/2022	GBP	0,046	267.760
	Clase 8EP	26/09/2022	EUR	0,037	31.847
	Clase 8GP	26/09/2022	GBP	0,033	16.998
	Clase 9EP	26/09/2022	EUR	0,357	25
	Clase 9GP	26/09/2022	GBP	0,362	26
	Clase AEP	26/09/2022	EUR	0,346	11.866
	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,305	25
	Clase DEP	26/09/2022	EUR	0,341	5.875

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					
<i>(continuación)</i>					
	Clase IEP	26/09/2022	EUR	0,357	307.207
	Clase ZEP	26/09/2022	EUR	0,355	8.095
					1.070.429 EUR
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income					
	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,286	45.163
	Clase DUP	26/09/2022	USD	0,278	16.296
	Clase IEP	26/09/2022	EUR	0,342	348.468
	Clase XUP	26/09/2022	USD	0,302	75.948
	Clase ZGP	26/09/2022	GBP	0,313	19
	Clase ZUP	26/09/2022	USD	0,334	1.227
					487.121 USD
Threadneedle (Lux) - UK Equities					
	Clase AGP	26/09/2022	GBP	0,383	16.731
	Clase IGP	26/09/2022	GBP	0,567	338.830
	Clase NGP	26/09/2022	GBP	0,227	13
	Clase TGP	26/09/2022	GBP	0,227	13
	Clase ZGP	26/09/2022	GBP	0,204	265.325
	Clase 9EP	26/09/2022	EUR	0,179	412.665
					1.033.577 GBP
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income					
	Clase AEC	24/06/2022	EUR	0,117	5.839
	Clase AEC	26/09/2022	EUR	0,081	4.000
	Clase ASC	24/06/2022	SGD	0,122	10
	Clase ASC	26/09/2022	SGD	0,080	7
	Clase AUC	24/06/2022	USD	0,127	56.110
	Clase AUC	26/09/2022	USD	0,082	39.960
	Clase DEC	24/06/2022	EUR	0,112	1.228
	Clase DEC	26/09/2022	EUR	0,074	839
	Clase DGP	24/06/2022	GBP	0,125	101
	Clase DGP	26/09/2022	GBP	0,085	69
	Clase IGP	24/06/2022	GBP	0,133	180.846
	Clase IGP	26/09/2022	GBP	0,089	125.937
	Clase LGP	24/06/2022	GBP	0,134	1.576.236
	Clase LGP	26/09/2022	GBP	0,091	1.098.940
	Clase ZGP	24/06/2022	GBP	0,138	17.245
	Clase ZGP	26/09/2022	GBP	0,092	15.120
					3.122.487 GBP
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities					
	Clase IEP	24/06/2022	EUR	0,086	8
	Clase IEP	26/09/2022	EUR	0,078	7
	Clase LEP	24/06/2022	EUR	0,087	8
	Clase LEP	26/09/2022	EUR	0,078	7
					30 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). El Índice de rendimiento está sujeto a una tasa mínima de rentabilidad para garantizar que las Carteras ofrezcan una tasa de rentabilidad mínima positiva, de forma que se abone una comisión de rendimiento, en caso de que la rentabilidad del índice de referencia subyacente sea negativa. 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).

El periodo de rendimiento de referencia con respecto a los resultados para cada Clase de Acciones se corresponde con toda la vida de la Clase de Acciones, es decir, desde el lanzamiento hasta su finalización.

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

¹ European Money Markets Institute, un administrador incluido en el registro de administradores de índices de referencia de la ESMA, 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.

El rendimiento de Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha Portfolio, Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Portfolio y Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha Portfolio, 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. La High Water Mark del VL solo se puede aumentar y no se puede reducir bajo ninguna circunstancia.

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 del saldo 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.

Si al final del año calendario el saldo de comisiones 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 saldo de comisiones de rendimiento acumulado 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.

Notas a los estados financieros

(continuación)

8 COMISIONES DE RENDIMIENTO

(continuación)

Desde el 30 de septiembre 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 ZE	13
		13 USD

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

A 30 de septiembre 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	19/10/2022	EUR	10.096.778	USD	10.134.691	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(230.156)
	19/10/2022	EUR	13.468.623	USD	13.519.197	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(307.017)
	19/10/2022	SEK	7.241	USD	682	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(29)
	19/10/2022	EUR	2.050.885	USD	2.058.586	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(46.750)
	19/10/2022	EUR	721.187	USD	723.895	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16.439)
	19/10/2022	EUR	15.232.880	USD	15.290.079	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(347.233)
	19/10/2022	GBP	16.369.216	USD	18.911.373	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(630.740)
	19/10/2022	SEK	8.551.121	USD	805.764	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(34.555)
	19/10/2022	GBP	303.634	USD	350.789	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11.700)
	19/10/2022	EUR	40.245.437	USD	40.396.558	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(917.395)
	19/10/2022	EUR	1.260.077	USD	1.264.808	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28.723)
	19/10/2022	GBP	25.673.253	USD	29.660.338	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(989.244)
	19/10/2022	GBP	244.145.715	USD	282.061.814	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9.407.447)
	19/10/2022	EUR	1.791.378	USD	1.798.104	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40.834)
	19/10/2022	GBP	5.606	USD	6.476	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(216)
	19/10/2022	EUR	1.759.679	USD	1.766.287	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40.112)
	19/10/2022	GBP	98.075.613	USD	113.306.864	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.779.059)
	19/10/2022	NOK	7.296	USD	726	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(56)
	19/10/2022	NOK	7.336	USD	730	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(57)
	19/10/2022	CHF	779	USD	813	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/10/2022	CHF	779	USD	812	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/10/2022	EUR	714	USD	717	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16)
	19/10/2022	USD	65.867	EUR	65.610	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.504
	19/10/2022	EUR	14.919	USD	14.977	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(342)
	19/10/2022	GBP	50.329	USD	58.147	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.941)
	19/10/2022	GBP	150.280	USD	173.623	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.795)
	19/10/2022	USD	3.994	EUR	3.986	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	83
	19/10/2022	EUR	1.893	USD	1.896	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40)
	19/10/2022	GBP	38.208	USD	44.273	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.604)
	19/10/2022	GBP	30.798	USD	35.687	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.293)
19/10/2022	GBP	201.948	USD	234.007	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.478)	
19/10/2022	EUR	46.604	USD	46.680	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(963)	
19/10/2022	EUR	14.652	USD	14.675	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(303)	
19/10/2022	USD	285.531	EUR	285.067	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.884	
19/10/2022	GBP	48.588	USD	55.872	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.611)	
19/10/2022	GBP	524.095	USD	602.666	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17.372)	
19/10/2022	EUR	3.990	USD	4.010	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(96)	

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>								
	19/10/2022	USD	19.700	EUR	19.601	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	472
	19/10/2022	USD	143	EUR	142	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2022	GBP	19.385	USD	22.178	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(530)
	19/10/2022	GBP	36.531	USD	41.794	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(998)
	19/10/2022	USD	20.959	EUR	20.894	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	462
	19/10/2022	USD	7.379	EUR	7.356	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	163
	19/10/2022	USD	8	CHF	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	34.393	USD	34.504	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(766)
	19/10/2022	EUR	785	USD	788	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	19/10/2022	EUR	39.975	USD	40.104	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(891)
	19/10/2022	EUR	22.000	USD	22.071	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(490)
	19/10/2022	USD	19.633	GBP	17.200	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	424
	19/10/2022	USD	143.503	EUR	144.758	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.499
	19/10/2022	USD	191.423	EUR	193.098	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.999
	19/10/2022	USD	10	SEK	105	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	212.178	EUR	214.034	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.216
	19/10/2022	USD	251.208	GBP	221.499	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.843
	19/10/2022	USD	11.109	SEK	121.942	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	111
	19/10/2022	USD	4.648	GBP	4.098	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	71
	19/10/2022	USD	566.585	EUR	571.543	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.917
	19/10/2022	USD	17.391	EUR	17.544	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	182
	19/10/2022	USD	393.314	GBP	346.799	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.017
	19/10/2022	USD	3.739.539	GBP	3.297.287	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	57.207
	19/10/2022	USD	25.174	EUR	25.394	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	263
	19/10/2022	USD	86	GBP	76	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	24.661	EUR	24.876	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	258
	19/10/2022	USD	1.479.651	GBP	1.304.662	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22.636
	19/10/2022	USD	10	NOK	102	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	10	NOK	102	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	11	CHF	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	10	EUR	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	39.990	USD	40.045	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(817)
	19/10/2022	USD	3.259	EUR	3.255	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	66
	19/10/2022	EUR	499	USD	499	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
	19/10/2022	GBP	7.818	USD	8.929	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(198)
	19/10/2022	GBP	55.997	USD	63.955	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.419)
	19/10/2022	EUR	426.898	USD	422.424	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.655)
	19/10/2022	USD	108	EUR	110	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	51.795	GBP	45.684	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	776
	19/10/2022	GBP	9.719	USD	11.019	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(165)
	19/10/2022	GBP	4.192	USD	4.753	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(71)
	19/10/2022	USD	25.617	EUR	26.132	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	19/10/2022	USD	9.503	EUR	9.695	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/10/2022	USD	10	CHF	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	2.954	EUR	3.004	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/10/2022	USD	9	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	15.020	USD	16.925	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(151)
	19/10/2022	GBP	23.379	USD	26.345	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(236)

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)								
	19/10/2022	EUR	14.379	USD	14.136	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(31)
	19/10/2022	USD	123.084	EUR	126.903	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.400)
	19/10/2022	USD	155.827	EUR	160.661	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.773)
	19/10/2022	USD	8	SEK	85	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	172.831	EUR	178.192	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.966)
	19/10/2022	USD	209.895	GBP	195.225	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.123)
	19/10/2022	USD	8.960	SEK	100.881	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(138)
	19/10/2022	USD	3.898	GBP	3.626	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(151)
	19/10/2022	USD	464.706	EUR	479.122	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.286)
	19/10/2022	USD	14.535	EUR	14.986	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(165)
	19/10/2022	USD	331.508	GBP	308.338	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12.829)
	19/10/2022	USD	3.143.781	GBP	2.924.054	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(121.661)
	19/10/2022	USD	20.723	EUR	21.366	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(236)
	19/10/2022	USD	72	GBP	67	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2022	USD	20.298	EUR	20.928	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(231)
	19/10/2022	USD	1.255.349	GBP	1.167.610	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(48.581)
	19/10/2022	USD	8	NOK	86	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	8	NOK	86	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	9	CHF	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	8	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	93.618	USD	91.002	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	833
	19/10/2022	USD	764	EUR	786	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/10/2022	GBP	16.835	USD	18.357	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	444
	19/10/2022	GBP	65.222	USD	71.117	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.721
	19/10/2022	USD	124.115	EUR	128.496	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.931)
	19/10/2022	USD	273.991	EUR	283.661	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.263)
	19/10/2022	USD	8	SEK	86	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	31.118	EUR	32.216	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(484)
	19/10/2022	USD	17.878	EUR	18.509	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(278)
	19/10/2022	USD	173.659	EUR	179.788	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.702)
	19/10/2022	USD	217.456	GBP	201.253	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.294)
	19/10/2022	USD	9.016	SEK	101.424	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(131)
	19/10/2022	USD	4.037	GBP	3.736	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(135)
	19/10/2022	USD	467.008	EUR	483.490	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.267)
	19/10/2022	USD	14.612	EUR	15.127	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(227)
	19/10/2022	USD	343.661	GBP	318.054	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11.527)
	19/10/2022	USD	5.745.506	GBP	5.317.395	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(192.716)
	19/10/2022	USD	36.753	EUR	38.050	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(572)
	19/10/2022	USD	132	GBP	122	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/10/2022	USD	35.639	EUR	36.897	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(555)
	19/10/2022	USD	1.300.354	GBP	1.203.462	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(43.616)
	19/10/2022	USD	8	NOK	87	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	8	NOK	87	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	12	CHF	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	10	CHF	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	8	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	9.953	USD	9.617	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	146
	19/10/2022	EUR	1.033	USD	998	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) - Global Corporate Bond (continuación)	19/10/2022	EUR	819.000	USD	791.364	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12.042
	19/10/2022	GBP	154	USD	167	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2022	GBP	3.395	USD	3.665	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	126
	19/10/2022	USD	1.454	EUR	1.505	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(22)
	19/10/2022	USD	12.243	EUR	12.670	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(186)
	19/10/2022	USD	590	EUR	613	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2022	USD	315	EUR	327	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/10/2022	GBP	8.433	USD	9.089	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	328
	19/10/2022	GBP	34.105	USD	36.760	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.327
	19/10/2022	EUR	234.701	USD	226.104	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.128
	19/10/2022	USD	993	EUR	1.029	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	19/10/2022	USD	49.091	GBP	45.670	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.910)
	19/10/2022	GBP	3.145	USD	3.380	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	132
	19/10/2022	GBP	325.422	USD	349.804	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13.617
	19/10/2022	EUR	22.673	USD	21.860	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	382
	19/10/2022	EUR	16.876	USD	16.271	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	284
	19/10/2022	EUR	9.990	USD	9.767	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	33
	19/10/2022	EUR	270	USD	264	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	GBP	1.238	USD	1.366	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
	19/10/2022	GBP	677.586	USD	747.954	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8.753
	19/10/2022	EUR	727.518	USD	711.259	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.407
	19/10/2022	EUR	6.713	USD	6.563	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
	03/10/2022	USD	1.092.199	JPY	150.926.316	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	49.262
	04/10/2022	AUD	152.671	USD	104.910	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(6.747)
	03/10/2022	USD	7.284.507	CAD	9.550.647	Operaciones comerciales	Barclays	333.805
	03/10/2022	USD	59.594.256	GBP	51.203.713	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	2.432.615
	03/10/2022	USD	169.031.959	EUR	168.443.635	Operaciones comerciales	Barclays	3.989.411
	03/10/2022	USD	1.307.420	EUR	1.298.800	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	34.843
	04/10/2022	AUD	7.588	USD	5.163	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(284)
	03/10/2022	CAD	94.220	USD	71.656	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(3.085)
	03/10/2022	GBP	361.665	USD	417.893	Operaciones comerciales	Barclays	(14.147)
	03/10/2022	EUR	1.304.882	USD	1.303.159	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(24.628)
	03/10/2022	EUR	1.446.520	USD	1.452.971	Operaciones comerciales	Barclays	(35.664)
	04/10/2022	USD	2.499	AUD	3.681	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	132
	03/10/2022	USD	96.233	CAD	126.680	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	4.038
	03/10/2022	JPY	1.119.198	USD	7.916	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(182)
	03/10/2022	CAD	136.837	USD	103.855	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(4.269)
	03/10/2022	JPY	794.222	USD	5.526	Operaciones comerciales	Barclays	(37)
	04/10/2022	AUD	5.578	USD	3.756	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(170)
	03/10/2022	USD	52.617	CAD	69.172	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	2.275
	04/10/2022	USD	8.844	AUD	12.877	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	564
	03/10/2022	CAD	87.833	USD	67.577	Operaciones comerciales	Barclays	(3.655)
	03/10/2022	GBP	313.271	USD	363.965	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(14.244)
	03/10/2022	USD	946.606	EUR	941.450	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	24.165
	03/10/2022	JPY	1.917.817	USD	13.447	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(194)
	03/10/2022	USD	55.448	CAD	72.022	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	3.033
	04/10/2022	AUD	5.969	USD	4.117	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(279)
04/10/2022	USD	3.804	AUD	5.653	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	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)								
	03/10/2022	CAD	92.066	USD	69.914	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(2.910)
	03/10/2022	GBP	1.514.160	USD	1.748.342	Operaciones comerciales	Barclays	(58.002)
	03/10/2022	USD	21.905	JPY	3.138.501	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	217
	04/10/2022	AUD	6.110	USD	4.122	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(194)
	03/10/2022	USD	38.789	CAD	51.065	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	1.625
	03/10/2022	USD	1.817.259	EUR	1.817.000	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	36.947
	03/10/2022	GBP	425.000	USD	489.257	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(14.806)
	03/10/2022	GBP	949.770	USD	1.081.120	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(20.839)
	03/10/2022	JPY	1.298.495	USD	9.070	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(97)
	04/10/2022	AUD	4.216	USD	2.817	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(106)
	03/10/2022	GBP	3.849.690	USD	4.403.316	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(105.695)
	04/10/2022	USD	590	AUD	879	Operaciones comerciales	Barclays	24
	03/10/2022	EUR	3.500.000	USD	3.506.857	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(77.540)
	04/10/2022	USD	2.764	AUD	4.143	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	100
	03/10/2022	EUR	1.163.751	USD	1.154.633	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(14.384)
	03/10/2022	USD	1.587.464	EUR	1.600.000	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	19.773
	03/10/2022	USD	61.115	CAD	81.764	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	1.610
	03/10/2022	JPY	1.325.653	USD	9.224	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(64)
	03/10/2022	USD	7.165.858	EUR	7.250.000	Operaciones comerciales	Barclays	62.262
	04/10/2022	AUD	3.203	USD	2.124	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(65)
	03/10/2022	USD	49.361	EUR	50.000	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	370
	03/10/2022	GBP	311.777	USD	352.414	Operaciones comerciales	Barclays	(4.361)
	03/10/2022	USD	82.854	CAD	111.691	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	1.568
	04/10/2022	AUD	1.364	USD	896	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(19)
	03/10/2022	GBP	262.835	USD	290.701	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	2.717
	03/10/2022	CAD	124.804	USD	92.179	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(1.350)
	04/10/2022	AUD	20.852	USD	13.607	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(200)
	03/10/2022	USD	37.404	CAD	50.820	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	418
	03/10/2022	EUR	904.741	USD	877.596	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	8.874
	03/10/2022	GBP	1.500.000	USD	1.618.439	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	56.093
	03/10/2022	GBP	1.000.000	USD	1.078.709	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	37.646
	03/10/2022	GBP	609.061	USD	656.881	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	23.048
	03/10/2022	GBP	1.000.000	USD	1.080.761	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	35.594
	03/10/2022	CAD	163.095	USD	119.251	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(555)
	03/10/2022	GBP	612.739	USD	662.699	Operaciones comerciales	Barclays	21.334
	04/10/2022	AUD	6.661	USD	4.326	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(43)
	04/10/2022	AUD	3.547	USD	2.266	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	14
	04/11/2022	USD	1.003.950	JPY	144.854.847	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(263)
	03/11/2022	USD	6.989.561	CAD	9.584.167	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	15.001
	03/11/2022	USD	41.577.108	GBP	38.190.911	Operaciones comerciales	Barclays	(1.083.806)
	03/11/2022	AUD	196.706	USD	127.236	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(709)
	03/11/2022	USD	166.539.707	EUR	170.712.483	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(1.100.197)
	03/11/2022	EUR	1.600.000	USD	1.561.302	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	9.925
	04/11/2022	USD	8.888	JPY	1.278.907	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	22
	03/11/2022	USD	8.959	AUD	13.742	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	120
	03/11/2022	CAD	152.259	USD	111.418	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(616)
	03/11/2022	USD	3.393.678	EUR	3.470.800	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(14.671)
								(12.597.165) 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) - European Corporate Bond								
	19/10/2022	NOK	7.560	EUR	749	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42)
	19/10/2022	NOK	7.623	EUR	756	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(43)
	19/10/2022	CHF	799	EUR	831	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	CHF	808	EUR	840	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	USD	908	EUR	904	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21
	19/10/2022	GBP	651	EUR	749	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	19/10/2022	EUR	10	NOK	100	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	10	NOK	100	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	11	USD	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	9	GBP	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	11	CHF	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	11	CHF	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	8	NOK	86	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	9	NOK	87	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	10	USD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	8	GBP	7	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	11	CHF	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	11	CHF	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	10	NOK	102	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	10	NOK	102	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	12	USD	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	10	GBP	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	9	CHF	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	9	CHF	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	03/10/2022	EUR	9.706.149	USD	9.738.751	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(233.368)
	03/10/2022	EUR	2.084.953	GBP	1.797.849	Operaciones comerciales	Lloyds	36.553
	03/10/2022	GBP	11.676	EUR	13.553	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(250)
	03/10/2022	EUR	998.424	USD	999.670	Operaciones comerciales	Lloyds	(21.854)
	03/10/2022	EUR	11.170	GBP	9.681	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	141
	03/10/2022	EUR	438.028	GBP	380.560	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	4.432
	03/10/2022	USD	476.860	EUR	475.579	Operaciones comerciales	Lloyds	11.110
	03/10/2022	GBP	141.730	EUR	161.677	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(195)
	03/10/2022	GBP	19.841	EUR	22.681	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(76)
	03/10/2022	GBP	16.731	EUR	18.938	Operaciones comerciales	Lloyds	125
	03/10/2022	GBP	30.137	EUR	33.496	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	841
	03/10/2022	USD	65.410	EUR	67.431	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(673)
	03/10/2022	GBP	26.530	EUR	29.766	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	461
	03/11/2022	EUR	10.433.156	USD	10.142.154	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	105.531
	03/11/2022	EUR	2.159.827	GBP	1.928.979	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(34.483)
								(131.779) EUR
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond								
	19/10/2022	SEK	7.536	EUR	707	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15)
	19/10/2022	SEK	7.608	EUR	714	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15)
	19/10/2022	USD	1.603.890	EUR	1.597.889	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	37.131
	19/10/2022	CHF	318.796	EUR	331.337	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(584)

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 High Yield Bond								
<i>(continuación)</i>	19/10/2022	CHF	55.628	EUR	57.816	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(102)
	19/10/2022	CHF	275.684	EUR	286.529	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(505)
	19/10/2022	CHF	67.329	EUR	69.978	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(123)
	19/10/2022	CHF	798	EUR	830	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	CHF	822	EUR	854	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2022	NOK	7.620	EUR	755	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(43)
	19/10/2022	NOK	7.699	EUR	763	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(43)
	19/10/2022	EUR	8	SEK	89	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	8	SEK	89	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	17.887	USD	17.732	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(189)
	19/10/2022	EUR	3.899	CHF	3.725	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	35
	19/10/2022	EUR	679	CHF	648	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2022	EUR	3.364	CHF	3.214	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30
	19/10/2022	EUR	823	CHF	786	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/10/2022	EUR	10	CHF	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	10	CHF	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	9	NOK	88	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	8	NOK	86	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	7	SEK	80	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	7	SEK	80	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	16.643	USD	16.142	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	188
	19/10/2022	EUR	3.436	CHF	3.280	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	33
	19/10/2022	EUR	599	CHF	572	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2022	EUR	2.969	CHF	2.835	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	28
	19/10/2022	EUR	725	CHF	693	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/10/2022	EUR	9	CHF	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	9	CHF	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	8	NOK	80	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	8	NOK	80	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	19.330	USD	18.671	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	297
	19/10/2022	EUR	7	SEK	74	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	7	SEK	75	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	3.347	CHF	3.177	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	50
	19/10/2022	EUR	584	CHF	554	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/10/2022	EUR	2.892	CHF	2.745	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	44
	19/10/2022	EUR	707	CHF	671	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
	19/10/2022	EUR	8	CHF	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	9	CHF	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	7	NOK	76	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	7	NOK	76	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	9	SEK	95	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	9	SEK	96	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	22.485	USD	22.146	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(90)
	19/10/2022	EUR	4.201	CHF	4.036	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/10/2022	EUR	733	CHF	704	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2022	EUR	3.632	CHF	3.489	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
	19/10/2022	EUR	887	CHF	852	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3

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 High Yield Bond								
<i>(continuación)</i>	19/10/2022	EUR	11	CHF	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	11	CHF	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	9	NOK	96	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	9	NOK	97	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	05/10/2022	EUR	47.783.513	GBP	41.333.265	Operaciones comerciales	Lloyds	695.156
	05/10/2022	EUR	8.760.732	USD	8.769.747	Operaciones comerciales	Lloyds	(188.415)
	05/10/2022	GBP	204.896	EUR	237.047	Operaciones comerciales	Lloyds	(3.621)
	05/10/2022	GBP	258.380	EUR	298.058	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(3.701)
	05/10/2022	GBP	360.750	EUR	417.799	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(6.818)
	05/10/2022	GBP	193.817	EUR	224.958	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(4.153)
	05/10/2022	EUR	135.550	GBP	116.950	Operaciones comerciales	Lloyds	2.316
	05/10/2022	EUR	26.042	USD	26.319	Operaciones comerciales	Lloyds	(815)
	05/10/2022	EUR	126.904	GBP	110.656	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	840
	05/10/2022	EUR	40.707	USD	41.549	Operaciones comerciales	Barclays	(1.693)
	05/10/2022	USD	32.933	EUR	32.943	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	664
	05/10/2022	GBP	200.000	EUR	230.811	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(2.963)
	05/10/2022	GBP	119.933	EUR	136.806	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(173)
	05/10/2022	GBP	180.284	EUR	205.748	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(361)
	05/10/2022	GBP	145.788	EUR	166.645	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(558)
	05/10/2022	GBP	212.026	EUR	242.868	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(1.320)
	05/10/2022	EUR	856.154	GBP	762.360	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(12.359)
	05/10/2022	GBP	427.450	EUR	475.318	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	11.651
	05/10/2022	USD	56.638	EUR	58.387	Operaciones comerciales	Barclays	(591)
	05/10/2022	GBP	250.000	EUR	280.474	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	4.336
	05/10/2022	GBP	517.909	EUR	580.912	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	9.111
	05/10/2022	USD	29.558	EUR	30.651	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(488)
	05/10/2022	GBP	363.827	EUR	406.845	Operaciones comerciales	Lloyds	7.641
	05/10/2022	USD	59.712	EUR	61.884	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(950)
	05/10/2022	USD	200.000	EUR	206.601	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(2.511)
	05/10/2022	GBP	125.000	EUR	139.720	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	2.685
								539.109 EUR
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond								
	19/10/2022	SEK	8.106	EUR	761	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16)
	19/10/2022	NOK	8.271	EUR	820	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(46)
	19/10/2022	GBP	711	EUR	818	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/10/2022	GBP	739	EUR	851	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/10/2022	GBP	44.670.706	EUR	51.408.138	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(552.996)
	19/10/2022	SEK	8.161	EUR	766	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16)
	19/10/2022	NOK	8.248	EUR	818	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(46)
	19/10/2022	GBP	6.859.467	EUR	7.894.042	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(84.916)
	19/10/2022	EUR	569.129	GBP	500.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(93)
	19/10/2022	EUR	9	SEK	100	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	9	NOK	95	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	9	GBP	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	9	GBP	8	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) - European Short-Term High Yield Bond (continuación)								
	19/10/2022	EUR	540.203	GBP	487.432	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14.726)
	19/10/2022	EUR	9	SEK	98	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	9	NOK	93	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	83.560	GBP	75.397	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.278)
	19/10/2022	EUR	9	SEK	101	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	10	NOK	103	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	10	GBP	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	10	GBP	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	613.899	GBP	550.537	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12.869)
	19/10/2022	EUR	9	SEK	101	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	10	NOK	102	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	95.336	GBP	85.496	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.998)
	05/10/2022	EUR	16.363.391	GBP	14.153.889	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	238.765
	05/10/2022	EUR	1.206.960	USD	1.208.267	Operaciones comerciales	Barclays	(26.024)
	05/10/2022	EUR	6.493	USD	6.477	Operaciones comerciales	Barclays	(116)
	05/10/2022	GBP	61.522	EUR	71.410	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(1.322)
	05/10/2022	EUR	3.537	USD	3.539	Operaciones comerciales	Barclays	(74)
	05/10/2022	EUR	58.088	GBP	50.557	Operaciones comerciales	Barclays	491
	05/10/2022	EUR	47.995	GBP	41.850	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	318
	05/10/2022	EUR	4.878	USD	4.958	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(181)
	05/10/2022	GBP	736.300	EUR	849.702	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(10.881)
	05/10/2022	USD	3.109	EUR	3.109	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	64
	05/10/2022	GBP	580.000	EUR	667.478	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(6.719)
	05/10/2022	GBP	33.184	EUR	37.871	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(67)
	05/10/2022	USD	3.197	EUR	3.222	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	41
	05/10/2022	GBP	47.009	EUR	53.848	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(293)
	05/10/2022	EUR	223.256	GBP	198.790	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(3.215)
	05/10/2022	GBP	76.022	EUR	84.482	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	2.124
	05/10/2022	USD	7.549	EUR	7.782	Operaciones comerciales	Barclays	(79)
	05/10/2022	GBP	110.790	EUR	124.309	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	1.908
	05/10/2022	USD	6.204	EUR	6.434	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(103)
	05/10/2022	GBP	878.990	EUR	978.278	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	23.103
	05/10/2022	GBP	82.259	EUR	91.987	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	1.726
	05/10/2022	USD	4.053	EUR	4.201	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(65)
								(450.617) EUR
Threadneedle (Lux) - European Social Bond								
	19/10/2022	CHF	22.593.723	EUR	23.482.484	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(41.383)
	19/10/2022	CHF	31.392	EUR	32.627	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(58)
	19/10/2022	GBP	6.974.000	EUR	8.025.849	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(86.334)
	19/10/2022	SEK	7.434	EUR	698	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	19/10/2022	NOK	7.525	EUR	746	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42)
	19/10/2022	GBP	43.054.401	EUR	49.548.055	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(532.988)
	19/10/2022	USD	13.478	EUR	13.428	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	312
	19/10/2022	NOK	7.522	EUR	746	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42)
	19/10/2022	SEK	7.423	EUR	697	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	19/10/2022	CHF	796	EUR	828	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 (continuación)								
	19/10/2022	USD	872	EUR	869	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
	19/10/2022	USD	859	EUR	856	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
	19/10/2022	SGD	871	EUR	617	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	SGD	858	EUR	608	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	874	EUR	870	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
	19/10/2022	USD	620.843	EUR	618.520	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14.373
	19/10/2022	SGD	871	EUR	618	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	SGD	858	EUR	609	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	GBP	635	EUR	731	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	19/10/2022	CHF	89.971	EUR	93.513	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(168)
	19/10/2022	GBP	9.332	EUR	10.739	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(115)
	19/10/2022	GBP	8.977	EUR	10.330	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(111)
	19/10/2022	GBP	19.834	EUR	22.939	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(359)
	19/10/2022	GBP	1.083.973	EUR	1.253.665	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19.622)
	19/10/2022	CHF	111.743	EUR	116.395	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(461)
	19/10/2022	GBP	1.708	EUR	1.961	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16)
	19/10/2022	GBP	18.603	EUR	21.357	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(178)
	19/10/2022	GBP	14.829	EUR	16.879	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2022	EUR	4.599	GBP	4.040	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	EUR	4.254	GBP	3.739	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2022	EUR	348.468	CHF	332.891	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.091
	19/10/2022	EUR	481	CHF	460	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/10/2022	EUR	112.807	GBP	98.633	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	520
	19/10/2022	EUR	10	SEK	109	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	10	NOK	106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	584.009	GBP	510.627	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.691
	19/10/2022	EUR	157	USD	156	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2022	EUR	10	NOK	106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	10	SEK	109	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	12	CHF	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	10	USD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	10	USD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	7	SGD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	7	SGD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	10	USD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	7.230	USD	7.167	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(77)
	19/10/2022	EUR	7	SGD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	7	SGD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	8	GBP	7	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	3.023	EUR	3.448	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/10/2022	EUR	24.888	GBP	21.821	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	46
	19/10/2022	GBP	7.218	EUR	8.270	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(53)
	19/10/2022	GBP	6.903	EUR	7.909	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(51)
	19/10/2022	GBP	4.142	EUR	4.747	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32)
	19/10/2022	GBP	19.265	EUR	22.081	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(149)
	19/10/2022	GBP	23.718	EUR	26.605	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	397
	19/10/2022	EUR	22.188	GBP	19.780	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(331)

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 (continuación)								
	19/10/2022	EUR	339.351	CHF	323.805	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.400
	19/10/2022	EUR	468	CHF	446	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2022	EUR	114.267	GBP	102.172	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.052)
	19/10/2022	EUR	10	SEK	106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	10	NOK	107	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	883.986	GBP	790.418	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15.875)
	19/10/2022	EUR	191	USD	184	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2022	EUR	10	NOK	107	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	10	SEK	105	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	12	CHF	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	12	USD	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	15	USD	14	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	9	SGD	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	11	SGD	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	12	USD	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	11.083	USD	10.705	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	170
	19/10/2022	EUR	9	SGD	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	11	SGD	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	10	GBP	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	209.007	CHF	199.778	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.736
	19/10/2022	GBP	2.533	EUR	2.830	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	54
	19/10/2022	GBP	57.323	EUR	64.043	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.216
	19/10/2022	GBP	1.190	EUR	1.331	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	19/10/2022	EUR	5.228	CHF	4.941	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	102
	19/10/2022	GBP	8.237	EUR	9.183	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	194
	19/10/2022	GBP	10.509	EUR	11.717	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	247
	19/10/2022	GBP	11.898	EUR	13.434	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	112
	19/10/2022	GBP	29.748	EUR	33.587	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	279
	20/10/2022	EUR	14.689.307	USD	14.732.094	Operaciones comerciales	HSBC	(328.120)
	20/10/2022	EUR	495.382	SEK	5.298.074	Operaciones comerciales	HSBC	8.304
	20/10/2022	EUR	29.957.085	GBP	26.089.125	Operaciones comerciales	HSBC	257.761
	20/10/2022	EUR	782.988	CAD	1.034.433	Operaciones comerciales	HSBC	15.664
	20/10/2022	EUR	1.392.469	USD	1.395.050	Operaciones comerciales	HSBC	(29.598)
	20/10/2022	SEK	26.840	EUR	2.458	Operaciones comerciales	HSBC	10
	20/10/2022	GBP	128.000	EUR	146.509	Operaciones comerciales	HSBC	(795)
	20/10/2022	GBP	164.104	EUR	182.273	Operaciones comerciales	HSBC	4.541
	20/10/2022	GBP	139.117	EUR	155.878	Operaciones comerciales	HSBC	2.492
	20/10/2022	USD	124.609	EUR	129.090	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(2.071)
	20/10/2022	SEK	38.498	EUR	3.545	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(5)
	20/10/2022	USD	60.000	EUR	62.566	Operaciones comerciales	HSBC	(1.406)
	20/10/2022	GBP	136.622	EUR	152.646	Operaciones comerciales	HSBC	2.883
	20/10/2022	USD	84.393	EUR	87.392	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(1.367)
								(743.211) EUR
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond								
	19/10/2022	USD	20.551	EUR	20.474	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	476
	19/10/2022	USD	910	EUR	906	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21

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 Strategic Bond								
<i>(continuación)</i>	19/10/2022	SEK	7.779	EUR	730	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15)
	19/10/2022	NOK	7.852	EUR	778	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(44)
	19/10/2022	NOK	7.925	EUR	786	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(44)
	19/10/2022	EUR	230	USD	225	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	11	USD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	9	SEK	96	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	9	NOK	90	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	9	NOK	89	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	313	USD	303	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2022	EUR	14	USD	13	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	11	SEK	116	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	11	NOK	118	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	11	NOK	119	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	203	USD	200	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	EUR	9	USD	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	7	SEK	76	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	7	NOK	77	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	7	NOK	78	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	21/10/2022	EUR	23.499.636	USD	24.180.897	Operaciones comerciales	Barclays	(1.148.782)
	21/10/2022	EUR	31.669.193	GBP	26.896.177	Operaciones comerciales	Barclays	1.053.457
	21/10/2022	EUR	119.131	AUD	175.664	Operaciones comerciales	HSBC	3.988
	21/10/2022	EUR	386.077	USD	400.000	Operaciones comerciales	HSBC	(21.661)
	21/10/2022	EUR	220.396	USD	228.884	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(12.917)
	21/10/2022	EUR	234.633	GBP	198.697	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	8.458
	21/10/2022	USD	114.203	EUR	112.342	Operaciones comerciales	Lloyds	4.061
	21/10/2022	GBP	300.473	EUR	355.323	Operaciones comerciales	HSBC	(13.285)
	21/10/2022	USD	483.557	EUR	484.581	Operaciones comerciales	Lloyds	8.291
	21/10/2022	GBP	222.134	EUR	262.498	Operaciones comerciales	HSBC	(9.635)
	21/10/2022	GBP	6.784.244	EUR	7.982.036	Operaciones comerciales	Lloyds	(259.308)
	21/10/2022	USD	382.826	EUR	380.732	Operaciones comerciales	Barclays	9.469
	21/10/2022	GBP	391.728	EUR	451.926	Operaciones comerciales	UBS	(6.009)
	21/10/2022	USD	589.985	EUR	594.168	Operaciones comerciales	HSBC	7.182
	21/10/2022	GBP	355.061	EUR	409.561	Operaciones comerciales	Lloyds	(5.384)
	21/10/2022	EUR	531.032	USD	536.595	Operaciones comerciales	Lloyds	(15.923)
	21/10/2022	GBP	516.473	EUR	594.171	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(6.252)
	21/10/2022	USD	659.230	EUR	657.364	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	14.565
	21/10/2022	EUR	53.865	GBP	47.206	Operaciones comerciales	HSBC	129
	21/10/2022	GBP	1.073.715	EUR	1.216.845	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	5.401
	21/10/2022	USD	1.392.943	EUR	1.422.551	Operaciones comerciales	HSBC	(2.774)
	21/10/2022	EUR	273.176	USD	263.587	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	4.518
	21/10/2022	GBP	165.200	EUR	184.396	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	3.657
	21/10/2022	USD	743.391	EUR	771.199	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(13.487)
	21/10/2022	GBP	258.259	EUR	289.748	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	4.236
	21/10/2022	USD	373.276	EUR	389.081	Operaciones comerciales	HSBC	(8.614)
	21/10/2022	GBP	169.050	EUR	188.509	Operaciones comerciales	HSBC	3.926
	21/10/2022	EUR	813.936	USD	791.751	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	6.943
	21/10/2022	EUR	132.650	GBP	119.014	Operaciones comerciales	HSBC	(2.830)

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 Strategic Bond								
(continuación)	21/10/2022	USD	199.167	EUR	203.785	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(781)
	21/10/2022	GBP	108.230	EUR	123.061	Operaciones comerciales	Lloyds	141
								(388.822) EUR
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds								
	19/10/2022	EUR	4.709.070	USD	4.726.752	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(107.343)
	19/10/2022	EUR	1.858.178	USD	1.865.155	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42.357)
	19/10/2022	EUR	11.367.370	USD	11.410.055	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(259.120)
	19/10/2022	SGD	94.899	USD	67.538	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.390)
	19/10/2022	EUR	5.510.744	USD	5.531.437	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(125.618)
	19/10/2022	EUR	138.022	USD	138.540	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.146)
	19/10/2022	EUR	310.385	USD	311.551	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.075)
	19/10/2022	SEK	7.286	USD	687	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(29)
	19/10/2022	NOK	7.343	USD	731	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(57)
	19/10/2022	EUR	1.707.634	USD	1.714.046	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(38.926)
	19/10/2022	USD	664	EUR	662	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
	19/10/2022	EUR	7.361	USD	7.375	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(154)
	19/10/2022	EUR	16.483	USD	16.510	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(341)
	19/10/2022	USD	3.439	EUR	3.433	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	71
	19/10/2022	USD	1.870	EUR	1.867	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	39
	19/10/2022	USD	62.064	EUR	62.144	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.102
	19/10/2022	USD	3.508	EUR	3.513	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	62
	19/10/2022	USD	1.040	EUR	1.035	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25
	19/10/2022	EUR	96	USD	96	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2022	EUR	255	USD	256	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/10/2022	USD	47.467	EUR	47.883	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	496
	19/10/2022	USD	18.766	EUR	18.930	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	196
	19/10/2022	USD	1.362	EUR	1.374	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
	19/10/2022	USD	7	SEK	73	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	7.177	EUR	7.168	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	146
	19/10/2022	USD	14.812	EUR	14.792	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	302
	19/10/2022	USD	128.792	EUR	130.919	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	365
	19/10/2022	USD	701	SGD	997	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2022	USD	8	NOK	81	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	19.337	EUR	19.656	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	55
	19/10/2022	USD	980	EUR	990	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2022	USD	3.787	EUR	3.827	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	33
	19/10/2022	USD	151	EUR	154	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	52.364	EUR	53.988	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(596)
	19/10/2022	USD	20.609	EUR	21.248	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(234)
	19/10/2022	USD	81.178	EUR	83.696	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(923)
	19/10/2022	USD	1.526	EUR	1.573	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	19/10/2022	USD	4.415	EUR	4.552	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(50)
	19/10/2022	USD	7	SEK	82	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	17.652	EUR	18.160	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(161)
	19/10/2022	USD	924	EUR	951	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) - Emerging Market Corporate Bonds								
<i>(continuación)</i>	19/10/2022	USD	152.912	EUR	158.309	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.379)
	19/10/2022	USD	899	SGD	1.290	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	10	NOK	102	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	29.453	EUR	30.492	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(458)
	19/10/2022	USD	672	EUR	696	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
	19/10/2022	EUR	7.618	USD	7.361	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	112
	19/10/2022	USD	45.129	EUR	47.050	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.024)
	19/10/2022	USD	17.835	EUR	18.594	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(405)
	19/10/2022	USD	72.928	EUR	76.033	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.655)
	19/10/2022	USD	1.319	EUR	1.375	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30)
	19/10/2022	USD	3.907	EUR	4.074	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(89)
	19/10/2022	USD	6	SEK	72	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	1.406	EUR	1.460	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26)
	19/10/2022	USD	45.250	EUR	46.826	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(683)
	19/10/2022	USD	17.871	EUR	18.493	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(270)
	19/10/2022	USD	169.926	EUR	175.842	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.565)
	19/10/2022	USD	1.020	SGD	1.471	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/10/2022	USD	52.742	EUR	54.579	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(796)
	19/10/2022	USD	1.326	EUR	1.372	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/10/2022	USD	2.820	EUR	2.918	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(43)
	19/10/2022	USD	6	SEK	73	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	11	NOK	114	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	25.471	EUR	26.358	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(385)
	19/10/2022	USD	17.977	EUR	18.646	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(314)
	19/10/2022	EUR	2.475	USD	2.420	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2022	EUR	860	USD	841	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2022	EUR	4	USD	4	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								(595.654) USD
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt								
	19/10/2022	EUR	166.881	USD	167.508	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.804)
	19/10/2022	EUR	278.959	USD	280.006	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.359)
	19/10/2022	EUR	443.944	USD	445.611	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10.120)
	19/10/2022	EUR	340.960	USD	342.241	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.772)
	19/10/2022	SGD	25.139	USD	17.891	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(368)
	19/10/2022	SEK	6.838	USD	644	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28)
	19/10/2022	NOK	6.935	USD	690	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(54)
	19/10/2022	USD	2.186	EUR	2.190	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	38
	19/10/2022	USD	3.657	EUR	3.664	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	63
	19/10/2022	USD	5.795	EUR	5.805	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	100
	19/10/2022	USD	231	SGD	325	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2022	USD	8	SEK	90	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	9	NOK	92	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	3.794	EUR	3.788	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	78
	19/10/2022	USD	6	SEK	67	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	2.206	EUR	2.226	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	19/10/2022	USD	3.681	EUR	3.713	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	38

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 Debt (continuación)								
	19/10/2022	USD	5.806	EUR	5.857	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	61
	19/10/2022	USD	3.779	EUR	3.812	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	39
	19/10/2022	USD	232	SGD	328	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2022	USD	9	NOK	93	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	8	SEK	84	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	3.359	EUR	3.464	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(38)
	19/10/2022	USD	5.614	EUR	5.788	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(64)
	19/10/2022	USD	8.907	EUR	9.183	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(101)
	19/10/2022	USD	6.883	EUR	7.096	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(78)
	19/10/2022	USD	352	SGD	505	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	7	SEK	83	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	13	NOK	143	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	2.007	EUR	2.078	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(31)
	19/10/2022	USD	3.353	EUR	3.471	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(52)
	19/10/2022	USD	5.310	EUR	5.498	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(83)
	19/10/2022	USD	5.518	EUR	5.712	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(86)
	19/10/2022	USD	215	SGD	308	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	8	SEK	84	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	8	NOK	86	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	2.280	EUR	2.359	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(34)
	19/10/2022	USD	3.809	EUR	3.942	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(58)
	19/10/2022	USD	6.047	EUR	6.257	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(91)
	19/10/2022	USD	4.656	EUR	4.818	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(70)
	19/10/2022	USD	246	SGD	354	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	USD	8	SEK	96	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	9	NOK	98	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	90	USD	88	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	26/10/2022	EUR	38.195	USD	38.099	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(612)
	26/10/2022	USD	425.935	MXN	8.655.169	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(2.422)
	26/10/2022	USD	32.909	EUR	32.223	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	1.282
	26/10/2022	USD	836.094	EUR	818.650	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	32.568
								1.973 USD
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds								
	19/10/2022	EUR	964.668	USD	968.290	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21.990)
	19/10/2022	EUR	2.583.145	USD	2.592.844	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(58.883)
	19/10/2022	EUR	10.516.797	USD	10.556.288	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(239.731)
	19/10/2022	EUR	10.789.139	USD	10.829.652	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(245.939)
	19/10/2022	SGD	171.559	USD	122.095	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.512)
	19/10/2022	SGD	280.900	USD	199.911	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.113)
	19/10/2022	SEK	7.378	USD	695	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30)
	19/10/2022	EUR	153.312	USD	153.888	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.495)
	19/10/2022	NOK	7.420	USD	738	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(57)
	19/10/2022	USD	18.269	EUR	18.234	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	382
	19/10/2022	EUR	99.990	USD	100.183	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.096)

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 (continuación)	19/10/2022	SGD	1.080.608	USD	769.621	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16.397)
	19/10/2022	SGD	79.637	USD	56.541	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.031)
	19/10/2022	SGD	1.497.914	USD	1.063.494	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19.392)
	19/10/2022	USD	16.724	EUR	16.640	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	401
	19/10/2022	SGD	362.616	USD	257.826	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.070)
	19/10/2022	USD	10.728	EUR	10.822	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	112
	19/10/2022	USD	28.687	EUR	28.938	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	300
	19/10/2022	USD	110.848	EUR	111.818	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.158
	19/10/2022	USD	7	SEK	81	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	1.615	EUR	1.630	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2022	USD	7	NOK	76	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	2.385	USD	2.360	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/10/2022	USD	26	EUR	27	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	2.253	SGD	3.201	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
	19/10/2022	USD	22.955	SGD	32.615	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	220
	19/10/2022	SGD	141.636	USD	99.780	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.054)
	19/10/2022	SGD	99	USD	70	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	USD	11.328	EUR	11.679	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(129)
	19/10/2022	USD	30.910	EUR	31.869	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(352)
	19/10/2022	USD	125.124	EUR	129.005	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.423)
	19/10/2022	USD	174.224	EUR	179.629	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.982)
	19/10/2022	USD	8	SEK	90	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	1.824	EUR	1.881	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21)
	19/10/2022	USD	9	NOK	90	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	43.345	SGD	61.923	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	183
	19/10/2022	USD	107.879	EUR	111.687	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.679)
	19/10/2022	USD	3.614	SGD	5.185	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	38.420	SGD	55.117	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	7.004	EUR	7.249	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(106)
	19/10/2022	EUR	1.975	USD	1.909	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29
	19/10/2022	USD	35.931	SGD	51.534	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/10/2022	USD	9.091	EUR	9.478	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(206)
	19/10/2022	USD	24.777	EUR	25.832	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(562)
	19/10/2022	USD	100.135	EUR	104.398	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.272)
	19/10/2022	USD	6	SEK	73	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	1.460	EUR	1.522	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(33)
	19/10/2022	USD	7	NOK	74	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	7.054	EUR	7.322	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(129)
	19/10/2022	SGD	99	USD	69	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	120.420	EUR	124.613	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.818)
	19/10/2022	USD	3.121	SGD	4.502	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	19/10/2022	USD	24.525	SGD	35.385	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(140)
	19/10/2022	SGD	99	USD	69	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	9.678	EUR	9.827	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	39
	19/10/2022	USD	26.558	EUR	26.965	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	106
	19/10/2022	USD	108.008	EUR	109.664	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	432

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 (continuación)	19/10/2022	USD	7	SEK	78	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	1.575	EUR	1.599	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2022	USD	7	NOK	78	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	89	EUR	91	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	SGD	30	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								(629.263) USD
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	19/10/2022	USD	10	CHF	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	9	GBP	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	624	EUR	650	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	19/10/2022	USD	9	NOK	97	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	9	NOK	97	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	3.300	SGD	4.744	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/10/2022	USD	3.121	SGD	4.492	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
	19/10/2022	SGD	431	USD	300	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	561	SGD	806	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	8	SEK	95	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	8	SEK	95	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	539.793	USD	541.820	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12.305)
	19/10/2022	EUR	447.078	USD	448.756	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10.191)
	19/10/2022	EUR	59.704.702	USD	59.928.893	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.360.969)
	19/10/2022	SGD	446.128	USD	317.500	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.532)
	19/10/2022	EUR	189.758	USD	190.471	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.326)
	19/10/2022	EUR	169.832	USD	170.470	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.871)
	19/10/2022	SEK	7.688	USD	724	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(31)
	19/10/2022	SEK	7.805	USD	735	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32)
	19/10/2022	CHF	838	USD	874	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21)
	19/10/2022	GBP	663	USD	766	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26)
	19/10/2022	EUR	52.552	USD	52.749	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.198)
	19/10/2022	EUR	724	USD	727	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	19/10/2022	NOK	7.793	USD	776	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(60)
	19/10/2022	NOK	7.890	USD	785	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(61)
	19/10/2022	SGD	2.187.863	USD	1.557.057	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32.036)
	19/10/2022	USD	6.790	EUR	6.796	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	124
	19/10/2022	USD	5.627	EUR	5.631	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	103
	19/10/2022	USD	749.777	EUR	750.342	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13.703
	19/10/2022	USD	1.945	EUR	1.947	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	36
	19/10/2022	USD	1.740	EUR	1.741	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	32
	19/10/2022	USD	9	SEK	97	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	9	SEK	98	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	11	CHF	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	10	GBP	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	660	EUR	660	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
	19/10/2022	USD	7	EUR	7	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	10	NOK	99	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) - US High Yield Bond (continuación)								
	19/10/2022	USD	10	NOK	100	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	19.345	SGD	27.187	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	395
	19/10/2022	USD	7.035	EUR	7.007	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	161
	19/10/2022	SGD	1.383	USD	984	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/10/2022	USD	3.556	SGD	5.001	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	70
	19/10/2022	EUR	21.904	USD	21.946	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(459)
	19/10/2022	USD	21.946	EUR	21.904	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	459
	19/10/2022	SGD	18.687	USD	13.309	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(284)
	19/10/2022	SGD	256	USD	181	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2022	SGD	6.385	USD	4.533	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(83)
	19/10/2022	USD	7.452	EUR	7.461	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	132
	19/10/2022	USD	5.875	EUR	5.883	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	104
	19/10/2022	USD	792.301	EUR	793.320	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14.066
	19/10/2022	USD	3.717	SGD	5.236	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	67
	19/10/2022	USD	2.280	EUR	2.283	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	40
	19/10/2022	USD	2.271	EUR	2.274	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	40
	19/10/2022	USD	10	SEK	104	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	10	SEK	106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	12	CHF	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	10	GBP	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	697	EUR	698	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
	19/10/2022	USD	10	EUR	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	10	NOK	106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	10	NOK	106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	20.473	SGD	28.843	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	369
	19/10/2022	SGD	486	USD	346	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/10/2022	SGD	3.826	USD	2.717	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(50)
	19/10/2022	SGD	97.983	USD	69.503	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.205)
	19/10/2022	SGD	1.483	USD	1.052	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	19/10/2022	EUR	147	USD	146	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	USD	10.571	EUR	10.683	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	91
	19/10/2022	SGD	4.793	USD	3.387	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(45)
	19/10/2022	SGD	100	USD	70	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	SGD	6.196	USD	4.365	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(46)
	19/10/2022	USD	9.362	EUR	9.653	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(107)
	19/10/2022	USD	7.346	EUR	7.574	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(84)
	19/10/2022	USD	985.888	EUR	1.016.472	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11.215)
	19/10/2022	USD	6.340	SGD	9.089	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2022	USD	2.607	EUR	2.687	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30)
	19/10/2022	USD	2.843	EUR	2.931	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32)
	19/10/2022	USD	12	SEK	132	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	12	SEK	133	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	14	CHF	14	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	12	GBP	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	868	EUR	895	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
	19/10/2022	USD	12	EUR	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	12	NOK	132	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	13	NOK	133	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) - US High Yield Bond (continuación)								
	19/10/2022	USD	25.484	SGD	36.533	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	19/10/2022	USD	28	EUR	29	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	8.902	SGD	12.717	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	38
	19/10/2022	USD	662	SGD	945	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2022	USD	1.971	EUR	2.041	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(31)
	19/10/2022	USD	2.142	EUR	2.217	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(33)
	19/10/2022	USD	9	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	19.809	SGD	28.418	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	5.837	EUR	6.041	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(89)
	19/10/2022	SGD	8	USD	5	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	8.637	SGD	12.388	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2022	USD	6.715	EUR	7.001	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(152)
	19/10/2022	USD	5.266	EUR	5.490	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(119)
	19/10/2022	USD	708.667	EUR	738.837	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16.082)
	19/10/2022	USD	4.525	SGD	6.542	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(35)
								(1.431.859) USD
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond								
	19/10/2022	EUR	926.016	USD	929.493	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21.108)
	19/10/2022	SGD	474.107	USD	337.413	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.942)
	19/10/2022	SGD	41.914	USD	29.829	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(614)
	19/10/2022	EUR	643.411	USD	645.827	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14.666)
	19/10/2022	EUR	13.600.974	USD	13.652.046	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(310.033)
	19/10/2022	GBP	632	USD	731	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24)
	19/10/2022	SGD	1.189	USD	846	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	19/10/2022	AUD	1.019	USD	691	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(36)
	19/10/2022	AUD	858	USD	581	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30)
	19/10/2022	SEK	7.374	USD	695	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30)
	19/10/2022	USD	4	SGD	5	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	6.197	EUR	6.173	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	142
	19/10/2022	USD	12.090	EUR	12.112	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	208
	19/10/2022	USD	3.879	SGD	5.455	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	77
	19/10/2022	USD	8.480	EUR	8.495	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	146
	19/10/2022	USD	171.086	EUR	171.398	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.947
	19/10/2022	USD	8	GBP	7	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	9	SGD	13	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	8	AUD	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	9	SEK	93	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	SGD	571	USD	407	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/10/2022	EUR	4.567	USD	4.576	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(96)
	19/10/2022	SGD	400	USD	284	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	19/10/2022	USD	7.619	EUR	7.606	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	157
	19/10/2022	SGD	292	USD	208	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/10/2022	USD	460	EUR	458	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
	19/10/2022	USD	16	SGD	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	SGD	244	USD	173	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2022	USD	10.010	EUR	9.996	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	204
	19/10/2022	USD	6	AUD	9	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) - Flexible Asian Bond (continuación)								
	19/10/2022	SGD	409	USD	289	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/10/2022	USD	1.384	EUR	1.399	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
	19/10/2022	USD	362	SGD	514	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2022	SGD	182	USD	129	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	USD	16.372	EUR	16.653	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	36
	19/10/2022	USD	14.676	EUR	15.131	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(167)
	19/10/2022	USD	5.133	SGD	7.358	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/10/2022	USD	10.242	EUR	10.560	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(117)
	19/10/2022	USD	213.248	EUR	219.863	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.426)
	19/10/2022	USD	11	GBP	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	13	SGD	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	11	AUD	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	6	AUD	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	11	SEK	121	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	2	SGD	4	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	2.482	EUR	2.553	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23)
	19/10/2022	USD	494	SGD	708	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	SGD	243	USD	169	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	69	SGD	98	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	149	USD	144	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2022	USD	608	EUR	630	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/10/2022	USD	8.695	EUR	9.065	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(197)
	19/10/2022	USD	6.061	EUR	6.319	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(138)
	19/10/2022	USD	126.567	EUR	131.955	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.872)
	19/10/2022	USD	7	GBP	6	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	6	AUD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	7	AUD	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	6	SEK	71	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	SGD	2.644	USD	1.840	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2022	USD	841	EUR	873	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15)
	19/10/2022	USD	10.475	EUR	10.839	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(158)
	19/10/2022	USD	7.044	SGD	10.164	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40)
	19/10/2022	USD	464	SGD	669	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2022	USD	7.283	EUR	7.537	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(110)
	19/10/2022	USD	153.263	EUR	158.600	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.314)
	19/10/2022	USD	8	GBP	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	17	SGD	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	8	AUD	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	7	AUD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	8	SEK	87	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	SGD	670	USD	466	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	EUR	1.810	USD	1.745	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30
	19/10/2022	SGD	2.085	USD	1.452	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	SGD	10	USD	7	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	4.974	USD	4.863	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
	26/10/2022	USD	855.113	PHP	47.965.836	Operaciones comerciales	Barclays	39.778
	26/10/2022	THB	14.852.150	USD	421.338	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(27.071)

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)								
	26/10/2022	USD	426.677	MYR	1.909.591	Operaciones comerciales	Barclays	15.889
	26/10/2022	THB	15.146.976	USD	426.355	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(24.262)
								(353.877) USD
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return								
	15/12/2022	EUR	542.012	USD	553.000	Operaciones comerciales	Barclays	(19.172)
	15/12/2022	JPY	113.650.000	EUR	788.970	Operaciones comerciales	Barclays	14.746
	15/12/2022	EUR	3.641.570	GBP	3.173.000	Operaciones comerciales	Barclays	44.069
	15/12/2022	EUR	674.128	USD	677.000	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(12.827)
	15/12/2022	EUR	1.500.000	JPY	210.124.995	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	13.986
	15/12/2022	EUR	98.973	USD	96.000	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	1.582
								42.384 EUR
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return								
	19/10/2022	EUR	7.310.659	USD	7.338.110	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(166.646)
	19/10/2022	EUR	1.729.220	USD	1.735.713	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(39.418)
	19/10/2022	EUR	735.623	USD	738.385	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16.769)
	19/10/2022	GBP	317.061	USD	366.301	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12.217)
	19/10/2022	EUR	708	USD	711	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16)
	19/10/2022	SEK	7.101	USD	669	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(29)
	19/10/2022	USD	7.406	GBP	6.481	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	168
	19/10/2022	USD	22.537	EUR	22.501	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	464
	19/10/2022	USD	151.002	EUR	153.496	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	428
	19/10/2022	USD	36.258	EUR	36.857	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	103
	19/10/2022	USD	15.232	EUR	15.484	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	43
	19/10/2022	USD	14	EUR	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	14	SEK	152	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	8.549	GBP	7.625	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	33
	19/10/2022	USD	23	EUR	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	230	EUR	236	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2022	USD	191.636	EUR	198.399	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.982)
	19/10/2022	USD	45.604	EUR	47.214	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(710)
	19/10/2022	USD	20.192	EUR	20.905	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(314)
	19/10/2022	USD	6.748	GBP	6.245	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(226)
	19/10/2022	USD	19	EUR	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	17	SEK	192	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	2.920	EUR	3.031	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(53)
	19/10/2022	USD	29.701	EUR	30.380	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(100)
	19/10/2022	EUR	17	USD	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	15/12/2022	JPY	418.140.000	USD	2.964.334	Operaciones comerciales	Lloyds	(49.827)
	15/12/2022	USD	1.143.481	EUR	1.120.000	Operaciones comerciales	Lloyds	39.347
	15/12/2022	USD	1.800.000	JPY	253.893.420	Operaciones comerciales	UBS	30.052
								(218.671) 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 Multi Asset Income								
	19/10/2022	EUR	10.794.889	USD	10.835.424	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(246.070)
	19/10/2022	SGD	6.531	USD	4.648	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(96)
	19/10/2022	EUR	173.399	USD	174.050	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.953)
	19/10/2022	CHF	813	USD	848	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21)
	19/10/2022	EUR	28.620.361	USD	28.727.831	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(652.401)
	19/10/2022	EUR	16.043.505	USD	16.103.749	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(365.712)
	19/10/2022	EUR	708	USD	711	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16)
	19/10/2022	EUR	2.225.385	USD	2.233.741	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(50.728)
	19/10/2022	SGD	148.856	USD	105.938	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.180)
	19/10/2022	USD	5.554	EUR	5.532	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	127
	19/10/2022	USD	14.360	EUR	14.333	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	300
	19/10/2022	EUR	99.990	USD	100.183	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.096)
	19/10/2022	USD	99	SGD	140	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2022	USD	2.258	SGD	3.183	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	39
	19/10/2022	USD	46.609	EUR	46.534	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	961
	19/10/2022	USD	4.791	EUR	4.784	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	99
	19/10/2022	USD	17.215	EUR	17.128	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	413
	19/10/2022	USD	9.914	EUR	9.864	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	238
	19/10/2022	USD	42.999	EUR	42.860	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	954
	19/10/2022	USD	39.265	EUR	39.138	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	871
	19/10/2022	USD	4.964	EUR	4.948	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	110
	19/10/2022	USD	32.221	EUR	32.177	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	656
	19/10/2022	USD	25.241	EUR	25.508	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	218
	19/10/2022	USD	23.323	EUR	23.570	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	202
	19/10/2022	USD	280.362	EUR	286.005	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(197)
	19/10/2022	USD	108	SGD	154	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	4.490	EUR	4.581	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2022	USD	22	CHF	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	747.621	EUR	762.670	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(526)
	19/10/2022	USD	420.177	EUR	428.634	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(296)
	19/10/2022	USD	18	EUR	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	58.883	EUR	60.068	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(41)
	19/10/2022	USD	2.470	SGD	3.510	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24
	19/10/2022	USD	5.242	EUR	5.332	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
	19/10/2022	USD	25.629	EUR	26.365	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(234)
	19/10/2022	USD	56.063	EUR	57.675	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(513)
	19/10/2022	USD	245.407	EUR	254.068	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.819)
	19/10/2022	USD	105	SGD	150	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	3.976	EUR	4.116	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(62)
	19/10/2022	USD	19	CHF	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	923.185	EUR	955.768	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14.365)
	19/10/2022	USD	517.645	EUR	535.915	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.055)
	19/10/2022	USD	23	EUR	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	51.288	EUR	53.098	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(798)
	19/10/2022	USD	3.374	SGD	4.840	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	15.109	EUR	15.636	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(230)
	19/10/2022	EUR	4.680	USD	4.523	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	69
	19/10/2022	SGD	62	USD	43	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 Multi Asset Income (continuación)								
	19/10/2022	EUR	99	USD	95	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2022	USD	16.605	EUR	17.223	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(290)
	19/10/2022	EUR	4.389	USD	4.291	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
	19/10/2022	EUR	6.670	USD	6.521	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
	19/10/2022	SGD	1.100	USD	766	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	21/10/2022	GBP	2.622	USD	3.153	Operaciones comerciales	HSBC	(224)
	21/10/2022	MXN	83.462	USD	4.114	Operaciones comerciales	UBS	20
	21/10/2022	USD	4.296	JPY	586.837	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	233
	21/10/2022	USD	2.326	EUR	2.331	Operaciones comerciales	HSBC	39
	21/10/2022	GBP	3.496	USD	4.122	Operaciones comerciales	HSBC	(217)
	21/10/2022	GBP	3.980	USD	4.713	Operaciones comerciales	HSBC	(268)
	21/10/2022	USD	32.182	GBP	27.224	Operaciones comerciales	UBS	1.777
	03/10/2022	USD	4.309.716	EUR	4.294.120	Operaciones comerciales	Lloyds	102.300
	03/10/2022	USD	59.705	CAD	78.278	Operaciones comerciales	Barclays	2.736
	03/10/2022	USD	1.444.292	GBP	1.240.943	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	58.955
	05/10/2022	USD	4.255.569	GBP	3.677.925	Operaciones comerciales	Lloyds	149.482
	05/10/2022	USD	25.334.203	EUR	25.314.230	Operaciones comerciales	Lloyds	527.103
	03/10/2022	CAD	404	USD	306	Operaciones comerciales	HSBC	(13)
	21/10/2022	USD	3.815	EUR	3.794	Operaciones comerciales	HSBC	93
	21/10/2022	GBP	3.191	USD	3.702	Operaciones comerciales	HSBC	(138)
	21/10/2022	USD	339.098	CNY	2.336.518	Operaciones comerciales	HSBC	11.253
	21/10/2022	USD	4.417	MXN	90.305	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(56)
	05/10/2022	GBP	18.530	USD	21.412	Operaciones comerciales	Barclays	(725)
	05/10/2022	EUR	223.705	USD	223.442	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(4.219)
	03/10/2022	CAD	2.991	USD	2.274	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(98)
	03/10/2022	GBP	7.323	USD	8.461	Operaciones comerciales	Barclays	(286)
	05/10/2022	USD	66.275	EUR	66.647	Operaciones comerciales	HSBC	964
	03/10/2022	USD	2.054	CAD	2.704	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	86
	03/10/2022	USD	11.517	GBP	10.000	Operaciones comerciales	HSBC	353
	05/10/2022	GBP	16.693	USD	19.329	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(692)
	05/10/2022	EUR	145.283	USD	144.972	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(2.600)
	03/10/2022	EUR	24.902	USD	24.845	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(446)
	05/10/2022	USD	76.464	EUR	76.968	Operaciones comerciales	HSBC	1.038
	03/10/2022	CAD	2.939	USD	2.231	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(92)
	03/10/2022	USD	24.907	EUR	25.000	Operaciones comerciales	Lloyds	411
	21/10/2022	USD	4.982	EUR	5.017	Operaciones comerciales	UBS	59
	21/10/2022	GBP	3.961	USD	4.537	Operaciones comerciales	UBS	(113)
	03/10/2022	USD	1.327	CAD	1.745	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	57
	05/10/2022	USD	162.232	EUR	160.475	Operaciones comerciales	Barclays	4.971
	05/10/2022	USD	15.398	GBP	13.252	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	602
	03/10/2022	CAD	1.837	USD	1.414	Operaciones comerciales	Barclays	(76)
	03/10/2022	EUR	50.000	USD	50.514	Operaciones comerciales	Barclays	(1.524)
	05/10/2022	USD	97.078	EUR	95.275	Operaciones comerciales	UBS	3.711
	03/10/2022	USD	1.126	CAD	1.462	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	62
	15/12/2022	USD	3.496.719	GBP	2.985.000	Operaciones comerciales	Lloyds	160.655
	05/10/2022	USD	11.809	GBP	10.069	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	568

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)								
	05/10/2022	USD	141.854	EUR	139.572	Operaciones comerciales	Barclays	5.077
	05/10/2022	EUR	70.739	USD	70.720	Operaciones comerciales	Lloyds	(1.399)
	03/10/2022	CAD	1.762	USD	1.338	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(56)
	03/10/2022	EUR	150.000	USD	149.873	Operaciones comerciales	Credit Suisse	(2.903)
	21/10/2022	USD	2.433	EUR	2.430	Operaciones comerciales	HSBC	49
	05/10/2022	GBP	16.364	USD	18.838	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(569)
	05/10/2022	EUR	130.176	USD	130.196	Operaciones comerciales	Lloyds	(2.629)
	03/10/2022	USD	880	CAD	1.159	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	37
	03/10/2022	USD	299.771	EUR	299.730	Operaciones comerciales	HSBC	6.093
	21/10/2022	MXN	647.944	USD	32.128	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(31)
	21/10/2022	CHF	3.665	USD	3.826	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(95)
	21/10/2022	JPY	15.355.061	USD	107.368	Operaciones comerciales	HSBC	(1.073)
	21/10/2022	USD	38.970	GBP	33.877	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	1.135
	21/10/2022	EUR	130.775	USD	131.005	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(2.702)
	21/10/2022	SEK	41.518	USD	3.885	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(140)
	21/10/2022	CAD	3.223	USD	2.442	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(97)
	03/10/2022	USD	51.899	GBP	45.380	Operaciones comerciales	HSBC	1.238
	05/10/2022	EUR	195.130	USD	195.563	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(4.344)
	05/10/2022	GBP	20.988	USD	24.010	Operaciones comerciales	HSBC	(579)
	03/10/2022	GBP	7.418	USD	8.486	Operaciones comerciales	HSBC	(205)
	03/10/2022	USD	637	CAD	846	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	21
	21/10/2022	USD	14.376	CNY	100.339	Operaciones comerciales	HSBC	297
	05/10/2022	EUR	75.557	USD	74.974	Operaciones comerciales	HSBC	(932)
	05/10/2022	GBP	9.081	USD	10.298	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(160)
	03/10/2022	USD	718	CAD	961	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	19
	21/10/2022	GBP	4.036	USD	4.581	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(73)
	21/10/2022	USD	3.485	EUR	3.509	Operaciones comerciales	UBS	42
	05/10/2022	EUR	85.789	USD	84.704	Operaciones comerciales	Credit Suisse	(634)
	03/10/2022	GBP	9.129	USD	10.319	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(127)
	03/10/2022	USD	1.800	CAD	2.427	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	34
	21/10/2022	KRW	79.474.929	USD	60.708	Operaciones comerciales	HSBC	(5.387)
	21/10/2022	IDR	355.453.455	USD	23.877	Operaciones comerciales	HSBC	(624)
	21/10/2022	CNY	3.053.469	USD	452.869	Operaciones comerciales	HSBC	(24.431)
	21/10/2022	THB	602.030	USD	17.017	Operaciones comerciales	HSBC	(1.039)
	21/10/2022	NZD	14.125	USD	8.913	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(922)
	21/10/2022	CAD	12.254	USD	9.515	Operaciones comerciales	Lloyds	(598)
	21/10/2022	AUD	53.268	USD	37.165	Operaciones comerciales	Lloyds	(2.908)
	21/10/2022	NOK	48.675	USD	5.036	Operaciones comerciales	Barclays	(569)
	21/10/2022	CHF	25.255	USD	26.761	Operaciones comerciales	HSBC	(1.053)
	21/10/2022	SEK	215.418	USD	21.313	Operaciones comerciales	HSBC	(1.883)
	21/10/2022	JPY	65.790.807	USD	490.065	Operaciones comerciales	Barclays	(34.628)
	21/10/2022	SGD	16.213	USD	11.777	Operaciones comerciales	Barclays	(476)
	21/10/2022	MXN	819.823	USD	40.037	Operaciones comerciales	HSBC	575
	21/10/2022	USD	226.875	GBP	187.212	Operaciones comerciales	Barclays	17.785
	21/10/2022	EUR	584.390	USD	601.349	Operaciones comerciales	Barclays	(28.005)
	21/10/2022	USD	4.197	JPY	556.815	Operaciones comerciales	HSBC	342
	21/10/2022	USD	5.478	EUR	5.328	Operaciones comerciales	HSBC	251

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>	05/10/2022	GBP	13.682	USD	15.132	Operaciones comerciales	Lloyds	143
	03/10/2022	EUR	25.628	USD	25.033	Operaciones comerciales	Lloyds	77
	03/10/2022	CAD	2.734	USD	2.019	Operaciones comerciales	HSBC	(30)
	21/10/2022	USD	3.922	EUR	4.005	Operaciones comerciales	HSBC	(8)
	21/10/2022	GBP	272.594	USD	302.408	Operaciones comerciales	UBS	2.030
	21/10/2022	USD	3.947	JPY	562.200	Operaciones comerciales	Lloyds	55
	21/10/2022	USD	3.682	CNY	26.020	Operaciones comerciales	HSBC	31
	05/10/2022	GBP	30.199	USD	32.568	Operaciones comerciales	UBS	1.147
	05/10/2022	EUR	182.849	USD	177.362	Operaciones comerciales	HSBC	1.823
	03/10/2022	USD	826	CAD	1.123	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	9
	03/10/2022	GBP	21.850	USD	23.563	Operaciones comerciales	UBS	829
	05/10/2022	EUR	234.439	USD	225.958	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	3.783
	05/10/2022	GBP	49.519	USD	53.532	Operaciones comerciales	HSBC	1.752
	03/10/2022	CAD	3.333	USD	2.437	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(11)
	03/10/2022	GBP	14.628	USD	15.819	Operaciones comerciales	Barclays	510
	21/10/2022	USD	2.457	GBP	2.272	Operaciones comerciales	HSBC	(80)
	05/10/2022	GBP	10.256	USD	10.969	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	481
	21/10/2022	USD	1.590	GBP	1.486	Operaciones comerciales	HSBC	(70)
	21/10/2022	USD	2.328	JPY	335.950	Operaciones comerciales	HSBC	2
	21/10/2022	USD	2.315	EUR	2.413	Operaciones comerciales	HSBC	(52)
	21/10/2022	USD	1.510	AUD	2.361	Operaciones comerciales	HSBC	(9)
	05/10/2022	GBP	28.764	USD	31.032	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	1.080
	05/10/2022	EUR	257.437	USD	248.407	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	3.872
	03/11/2022	USD	57.042	CAD	78.231	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	112
	03/11/2022	USD	1.337.173	GBP	1.228.820	Operaciones comerciales	HSBC	(35.473)
	03/11/2022	USD	4.210.350	EUR	4.334.460	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(46.053)
	21/10/2022	JPY	571.817	USD	3.960	Operaciones comerciales	UBS	(1)
	21/10/2022	EUR	4.171	USD	4.058	Operaciones comerciales	UBS	35
	21/10/2022	GBP	3.620	USD	3.926	Operaciones comerciales	UBS	117
	15/12/2022	GBP	2.985.000	USD	3.241.856	Operaciones comerciales	Lloyds	94.028
	03/11/2022	EUR	24.057	USD	23.741	Operaciones comerciales	HSBC	(117)
	03/11/2022	CAD	3.331	USD	2.437	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(13)
	21/10/2022	USD	8.038	MXN	162.243	Operaciones comerciales	UBS	1
	21/10/2022	CNY	17.575	USD	2.479	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(13)
	21/10/2022	USD	1.768	CAD	2.426	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	3
								(389.911) USD
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities								
	19/10/2022	EUR	797	USD	800	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	19/10/2022	USD	33	EUR	33	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	34	EUR	34	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	33	EUR	33	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	19	EUR	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	15	EUR	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	1.374	EUR	1.395	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2022	USD	15	EUR	15	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) - Emerging Market ESG Equities								
(continuación)	19/10/2022	USD	15	EUR	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	786	USD	789	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	19/10/2022	EUR	74.174	USD	74.452	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.692)
	19/10/2022	EUR	811	USD	814	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	19/10/2022	EUR	807	USD	810	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	19/10/2022	USD	3.090	EUR	3.093	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	55
	19/10/2022	USD	34	EUR	34	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	19	EUR	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	1.787	EUR	1.816	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2022	USD	19	EUR	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	19	EUR	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	25	EUR	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	2.403	EUR	2.478	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(27)
	19/10/2022	USD	26	EUR	27	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	26	EUR	27	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	26	EUR	27	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	15	EUR	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								(1.723) USD
Threadneedle (Lux) - Global Focus								
	19/10/2022	EUR	77.218.884	USD	77.508.841	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.760.204)
	19/10/2022	EUR	22.744.968	USD	22.830.376	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(518.472)
	19/10/2022	EUR	53.067.747	USD	53.267.017	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.209.679)
	19/10/2022	EUR	2.018.128	USD	2.025.706	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(46.003)
	19/10/2022	CHF	762	USD	795	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	19/10/2022	SGD	55.057	USD	39.183	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(806)
	19/10/2022	USD	3.252.797	EUR	3.255.248	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	59.450
	19/10/2022	USD	958.583	EUR	959.306	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17.519
	19/10/2022	USD	2.234.171	EUR	2.235.854	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	40.833
	19/10/2022	USD	84.968	EUR	85.032	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.553
	19/10/2022	USD	26	CHF	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	1.269	SGD	1.783	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26
	19/10/2022	USD	7.828	EUR	7.798	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	179
	19/10/2022	USD	20.877	EUR	20.795	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	477
	19/10/2022	EUR	43.960	USD	44.132	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.009)
	19/10/2022	USD	193.783	EUR	193.410	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.050
	19/10/2022	EUR	4.344	USD	4.352	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(91)
	19/10/2022	EUR	61.670	USD	61.789	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.293)
	19/10/2022	EUR	42.967	USD	43.037	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(888)
	19/10/2022	EUR	15.470	USD	15.495	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(320)
	19/10/2022	USD	1.811.379	EUR	1.813.710	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	32.159
	19/10/2022	USD	536.076	EUR	536.766	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9.517
	19/10/2022	USD	1.247.503	EUR	1.249.108	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22.148
	19/10/2022	USD	47.346	EUR	47.407	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	841
	19/10/2022	USD	19	CHF	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	918	SGD	1.293	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2022	USD	76.451	EUR	76.065	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.832

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)								
	19/10/2022	EUR	5.047	USD	5.073	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(122)
	19/10/2022	EUR	1.890	USD	1.900	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(46)
	19/10/2022	EUR	26.025	USD	26.157	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(628)
	19/10/2022	USD	35.230	EUR	35.116	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	781
	19/10/2022	USD	4.777	EUR	4.762	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	106
	19/10/2022	USD	160.789	EUR	160.271	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.566
	19/10/2022	EUR	34.918	USD	35.031	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(778)
	19/10/2022	USD	24.216	EUR	24.182	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	493
	19/10/2022	USD	2.236	EUR	2.233	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	46
	19/10/2022	USD	16.967	EUR	16.944	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	346
	19/10/2022	USD	169.092	EUR	168.859	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.443
	19/10/2022	USD	1.771.256	EUR	1.800.509	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.022
	19/10/2022	USD	525.775	EUR	534.459	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.491
	19/10/2022	USD	1.215.143	EUR	1.235.211	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.445
	19/10/2022	USD	45.482	EUR	46.233	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	129
	19/10/2022	USD	18	CHF	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	892	SGD	1.268	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2022	EUR	1.662	USD	1.645	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	19/10/2022	EUR	38.185	USD	37.785	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(327)
	19/10/2022	EUR	32.484	USD	32.144	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(278)
	19/10/2022	USD	92	EUR	93	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	EUR	14.485	USD	14.241	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(31)
	19/10/2022	USD	41.760	EUR	42.477	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	92
	19/10/2022	USD	2.816	EUR	2.864	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2022	EUR	24.505	USD	24.091	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(53)
	19/10/2022	USD	2.236.388	EUR	2.305.764	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(25.442)
	19/10/2022	USD	662.391	EUR	682.939	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.535)
	19/10/2022	USD	1.539.720	EUR	1.587.484	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17.516)
	19/10/2022	USD	55.625	EUR	57.351	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(633)
	19/10/2022	USD	23	CHF	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	1.149	SGD	1.647	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	45.392	EUR	46.697	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(415)
	19/10/2022	USD	20.309	EUR	20.893	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(186)
	19/10/2022	USD	9.801.374	EUR	10.083.101	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(89.626)
	19/10/2022	EUR	3.111	USD	3.024	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	28
	19/10/2022	USD	929.884	EUR	962.356	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14.132)
	19/10/2022	USD	13.894	EUR	14.380	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(211)
	19/10/2022	USD	1.187.285	EUR	1.228.747	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18.042)
	19/10/2022	EUR	1.375	USD	1.328	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
	19/10/2022	EUR	34.349	USD	33.091	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	604
	19/10/2022	USD	5.175	EUR	5.372	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(94)
	19/10/2022	EUR	8.058	USD	7.763	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	142
	19/10/2022	USD	14.006	EUR	14.538	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(255)
	19/10/2022	SGD	15.000	USD	10.436	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
	19/10/2022	EUR	72.285	USD	69.690	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.218
	19/10/2022	EUR	38.787	USD	37.395	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	654
	19/10/2022	EUR	54.384	USD	52.432	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	916
	19/10/2022	EUR	82.122	USD	80.286	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	272

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								
<i>(continuación)</i>	19/10/2022	USD	11.471	EUR	11.734	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(39)
	19/10/2022	EUR	77.447	USD	75.716	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	256
	19/10/2022	EUR	1.956	USD	1.912	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
								(3.501.473) USD
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities								
	19/10/2022	EUR	918	USD	919	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	19/10/2022	USD	290	EUR	289	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2022	EUR	3.493	USD	3.498	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(72)
	19/10/2022	USD	9.840	EUR	10.003	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	28
	19/10/2022	USD	20.900	EUR	21.245	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	59
	19/10/2022	USD	1.774	EUR	1.805	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/10/2022	USD	12.922	EUR	13.322	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(147)
	19/10/2022	USD	27.370	EUR	28.219	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(311)
	19/10/2022	USD	21.309	EUR	21.970	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(242)
	19/10/2022	EUR	9	USD	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	8.127	EUR	8.252	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	32
	19/10/2022	USD	17.268	EUR	17.533	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	69
	19/10/2022	USD	13.344	EUR	13.548	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	53
	19/10/2022	EUR	383.629	USD	385.069	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.745)
	19/10/2022	EUR	823.134	USD	826.225	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18.763)
	19/10/2022	EUR	640.882	USD	643.289	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14.609)
	19/10/2022	USD	17.023	EUR	17.035	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	311
	19/10/2022	USD	36.542	EUR	36.569	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	668
	19/10/2022	USD	28.423	EUR	28.444	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	519
	19/10/2022	USD	16.074	EUR	16.339	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	46
								(41.113) USD
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income								
	19/10/2022	SGD	4.562.782	USD	3.247.238	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(66.809)
	19/10/2022	SGD	829.856	USD	590.592	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12.150)
	19/10/2022	SGD	517.421	USD	368.238	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.576)
	19/10/2022	AUD	86.363	USD	58.553	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.014)
	19/10/2022	EUR	45.911	USD	46.083	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.047)
	19/10/2022	EUR	728	USD	731	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	19/10/2022	USD	24	EUR	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	1.177	AUD	1.741	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	57
	19/10/2022	USD	927	EUR	929	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
	19/10/2022	USD	205	SGD	288	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/10/2022	USD	95.985	SGD	135.305	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.672
	19/10/2022	USD	17.457	SGD	24.609	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	304
	19/10/2022	USD	10.898	SGD	15.362	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	190
	19/10/2022	SGD	1.587	USD	1.127	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21)
	19/10/2022	SGD	99	USD	70	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	USD	7.666	SGD	10.797	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	140
	19/10/2022	SGD	293	USD	209	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/10/2022	USD	1.557	AUD	2.339	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	53

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 Equity Income <i>(continuación)</i>								
	19/10/2022	USD	1.242	EUR	1.253	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/10/2022	USD	20	EUR	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	91.058	SGD	129.457	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	821
	19/10/2022	USD	16.557	SGD	23.539	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	149
	19/10/2022	USD	10.099	SGD	14.358	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	91
	19/10/2022	USD	1.212	AUD	1.833	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	33
	19/10/2022	USD	976	EUR	996	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	USD	15	EUR	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	99.948	SGD	143.286	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	73
	19/10/2022	USD	18.174	SGD	26.054	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/10/2022	USD	11.086	SGD	15.893	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2022	USD	1.236	AUD	1.895	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2022	USD	976	EUR	1.006	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2022	USD	15	EUR	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	57.645	SGD	82.697	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2022	USD	822	EUR	851	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2022	USD	13	EUR	13	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	SGD	675	USD	471	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	SGD	44	USD	31	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	10.502	SGD	15.184	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(82)
	19/10/2022	USD	1.015	AUD	1.587	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/10/2022	SGD	140	USD	98	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	SGD	694	USD	483	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								(87.096) USD
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies								
	19/10/2022	GBP	290	EUR	332	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2022	GBP	96	EUR	110	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	EUR	19	CHF	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	77.923	GBP	70.311	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.124)
	19/10/2022	EUR	669.200	CHF	638.890	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.346
	19/10/2022	EUR	820.803	CHF	788.656	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.568
	19/10/2022	EUR	19	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	50	EUR	56	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	CHF	791	EUR	822	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	GBP	3.016.184	EUR	3.471.098	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(37.338)
	19/10/2022	CHF	28.296.963	EUR	29.410.070	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(51.828)
	19/10/2022	GBP	630	EUR	725	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	19/10/2022	GBP	4.569	EUR	5.284	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(83)
	19/10/2022	EUR	18	CHF	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	74.081	GBP	64.924	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	169
	19/10/2022	EUR	643.941	CHF	620.394	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	279
	19/10/2022	EUR	15	GBP	13	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	20	CHF	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	83.422	GBP	72.940	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	384
	19/10/2022	EUR	718.587	CHF	686.464	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.374
	19/10/2022	EUR	17	GBP	15	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 Smaller Companies (continuación)								
	19/10/2022	GBP	1.931	EUR	2.203	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/10/2022	EUR	16	GBP	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	172	EUR	193	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2022	EUR	1.197	GBP	1.072	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23)
	19/10/2022	GBP	4.370	EUR	4.889	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	86
	19/10/2022	EUR	65.693	CHF	62.537	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	810
	19/10/2022	CHF	16	EUR	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	60.821	EUR	67.820	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.420
	19/10/2022	CHF	562.474	EUR	592.244	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.674)
	19/10/2022	GBP	13	EUR	14	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	23	CHF	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	93.353	GBP	82.234	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(266)
								(81.913) EUR
Threadneedle (Lux) - American								
	19/10/2022	EUR	2.848	USD	2.818	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24)
	19/10/2022	EUR	22.580	USD	22.343	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(193)
	19/10/2022	USD	11.232	EUR	11.351	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	97
	19/10/2022	USD	100.372	EUR	102.094	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	221
	19/10/2022	USD	4.403	EUR	4.479	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/10/2022	USD	1.566	EUR	1.593	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2022	USD	427.326	EUR	440.583	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.861)
	19/10/2022	USD	52.555	EUR	54.185	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(598)
	19/10/2022	USD	835.816	EUR	861.744	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9.508)
	19/10/2022	USD	642.859	EUR	662.801	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.313)
	19/10/2022	USD	65.399	EUR	67.428	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(744)
	19/10/2022	USD	16.487	EUR	16.999	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(188)
	19/10/2022	USD	20	EUR	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	4.670	EUR	4.804	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(43)
	19/10/2022	USD	2.625	EUR	2.700	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24)
	19/10/2022	EUR	35.436	USD	34.445	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	315
	19/10/2022	USD	12.978	EUR	13.431	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(197)
	19/10/2022	EUR	1.874	USD	1.811	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	28
	19/10/2022	USD	8.124	EUR	8.408	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(123)
	19/10/2022	USD	51	EUR	53	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	USD	175	EUR	182	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2022	EUR	26.142	USD	25.184	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	460
	19/10/2022	EUR	7.681	USD	7.405	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	129
	19/10/2022	USD	292	EUR	303	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	19/10/2022	EUR	4.840	USD	4.666	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	82
	19/10/2022	EUR	1.378	USD	1.328	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	19/10/2022	EUR	214	USD	209	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	425	EUR	435	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	EUR	399.659	USD	390.727	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.322
	19/10/2022	USD	12.217	EUR	12.497	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(41)
	19/10/2022	EUR	16.575.259	USD	16.637.499	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(377.833)
	19/10/2022	EUR	2.025.417	USD	2.033.023	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(46.169)

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) - American (continuación)								
	19/10/2022	EUR	32.287.519	USD	32.408.759	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(735.993)
	19/10/2022	EUR	24.724.173	USD	24.817.012	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(563.588)
	19/10/2022	EUR	2.534.574	USD	2.544.091	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(57.776)
	19/10/2022	EUR	636.747	USD	639.138	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14.515)
	19/10/2022	EUR	774	USD	777	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	19/10/2022	USD	635.353	EUR	635.832	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11.612
	19/10/2022	USD	77.643	EUR	77.702	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.419
	19/10/2022	USD	1.236.613	EUR	1.237.545	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22.601
	19/10/2022	USD	947.004	EUR	947.718	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17.308
	19/10/2022	USD	97.135	EUR	97.208	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.775
	19/10/2022	USD	24.387	EUR	24.405	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	446
	19/10/2022	USD	30	EUR	30	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	3.332	EUR	3.319	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	76
	19/10/2022	USD	9.146	EUR	9.111	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	209
	19/10/2022	USD	24.522	EUR	24.475	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	512
	19/10/2022	USD	808	EUR	807	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2022	EUR	7.840	USD	7.855	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(164)
	19/10/2022	USD	14.664	EUR	14.640	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	302
	19/10/2022	USD	399	EUR	399	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2022	EUR	2.115	USD	2.118	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(44)
	19/10/2022	USD	343.868	EUR	344.311	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.105
	19/10/2022	USD	42.191	EUR	42.245	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	749
	19/10/2022	USD	669.245	EUR	670.106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11.882
	19/10/2022	USD	513.032	EUR	513.692	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9.108
	19/10/2022	USD	52.733	EUR	52.800	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	936
	19/10/2022	USD	13.202	EUR	13.219	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	234
	19/10/2022	USD	16	EUR	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	565	USD	567	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	19/10/2022	EUR	49.973	USD	50.227	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.205)
	19/10/2022	EUR	16.486	USD	16.540	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(367)
	19/10/2022	EUR	2.630	USD	2.638	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(59)
	19/10/2022	EUR	12.460	USD	12.501	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(278)
	19/10/2022	USD	772	EUR	769	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2022	USD	469	EUR	468	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/10/2022	USD	1.403	EUR	1.401	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29
	19/10/2022	USD	357	EUR	357	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/10/2022	USD	366.535	EUR	372.589	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.039
	19/10/2022	USD	44.946	EUR	45.688	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	127
	19/10/2022	USD	711.317	EUR	723.064	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.017
	19/10/2022	USD	546.813	EUR	555.843	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.550
	19/10/2022	USD	56.110	EUR	57.037	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	159
	19/10/2022	USD	14.030	EUR	14.261	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	40
	19/10/2022	USD	17	EUR	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	550	EUR	556	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
								(1.728.899) 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) - American Select								
	19/10/2022	EUR	561.550	USD	563.658	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12.801)
	19/10/2022	EUR	302.547	USD	303.683	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.897)
	19/10/2022	EUR	499.641	USD	501.517	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11.389)
	19/10/2022	EUR	722	USD	725	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16)
	19/10/2022	EUR	306.794	USD	307.946	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.993)
	19/10/2022	EUR	10.045	USD	10.082	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(229)
	19/10/2022	EUR	16.159	USD	16.220	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(368)
	19/10/2022	USD	19.541	EUR	19.556	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	357
	19/10/2022	USD	10.551	EUR	10.559	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	193
	19/10/2022	USD	17.344	EUR	17.357	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	317
	19/10/2022	USD	25	EUR	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	10.671	EUR	10.679	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	195
	19/10/2022	USD	349	EUR	349	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2022	USD	561	EUR	562	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/10/2022	USD	2.953	EUR	2.942	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	67
	19/10/2022	EUR	3.000	USD	3.006	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(63)
	19/10/2022	EUR	289	USD	289	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/10/2022	USD	13.241	EUR	13.258	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	235
	19/10/2022	USD	7.033	EUR	7.042	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	125
	19/10/2022	USD	11.672	EUR	11.687	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	208
	19/10/2022	USD	17	EUR	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	7.183	EUR	7.192	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	128
	19/10/2022	USD	235	EUR	235	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/10/2022	USD	378	EUR	378	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/10/2022	USD	12.121	EUR	12.321	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	34
	19/10/2022	USD	6.453	EUR	6.560	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
	19/10/2022	USD	10.671	EUR	10.847	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30
	19/10/2022	USD	15	EUR	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	6.577	EUR	6.686	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	19/10/2022	USD	215	EUR	218	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	345	EUR	351	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	EUR	25.948	USD	25.510	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(56)
	19/10/2022	USD	16.051	EUR	16.549	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(183)
	19/10/2022	USD	8.987	EUR	9.265	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(102)
	19/10/2022	USD	14.179	EUR	14.619	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(161)
	19/10/2022	USD	21	EUR	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	8.715	EUR	8.985	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(99)
	19/10/2022	USD	285	EUR	294	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2022	USD	459	EUR	473	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	19/10/2022	EUR	4.988	USD	4.848	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	44
	19/10/2022	EUR	64	USD	62	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	EUR	67.975	USD	65.681	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	999
	19/10/2022	USD	4.849	EUR	5.019	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(74)
	19/10/2022	EUR	4	USD	3	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	518	EUR	537	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/10/2022	EUR	2.500	USD	2.444	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
								(36.447) 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) - American Smaller Companies								
	19/10/2022	USD	22	SGD	32	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	21.189	EUR	21.798	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(194)
	19/10/2022	USD	13	SGD	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	100	USD	97	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	10.151	EUR	10.537	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(185)
	19/10/2022	SGD	36	USD	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	28.714	EUR	29.783	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(501)
	19/10/2022	USD	48.555	EUR	48.309	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.164
	19/10/2022	EUR	23.200	USD	23.318	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(560)
	19/10/2022	USD	200.951	EUR	200.303	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.456
	19/10/2022	USD	1.396.745	EUR	1.392.239	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30.973
	19/10/2022	USD	40.600	EUR	40.955	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	424
	19/10/2022	USD	8.129	EUR	8.200	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	85
	19/10/2022	USD	98.724	EUR	99.588	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.031
	19/10/2022	USD	11.560	EUR	11.661	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	121
	19/10/2022	USD	3.561.822	EUR	3.556.918	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	72.532
	19/10/2022	EUR	50	USD	50	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	USD	16	SGD	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	12.063	EUR	12.191	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	104
	19/10/2022	USD	48.427	EUR	49.402	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(34)
	19/10/2022	USD	10.397	EUR	10.607	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/10/2022	USD	5.653	EUR	5.766	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/10/2022	USD	14.924	EUR	15.224	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2022	USD	14	SGD	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	40.658	EUR	41.920	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(463)
	19/10/2022	USD	8.763	EUR	9.035	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(100)
	19/10/2022	USD	4.840	EUR	4.990	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(55)
	19/10/2022	USD	12.594	EUR	12.984	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(143)
	19/10/2022	EUR	1.955.389	USD	1.962.731	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(44.573)
	19/10/2022	EUR	364.006	USD	365.373	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.298)
	19/10/2022	EUR	5.356.131	USD	5.376.244	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(122.092)
	19/10/2022	EUR	523.571	USD	525.537	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11.934)
	19/10/2022	SGD	1.302	USD	926	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	19/10/2022	USD	50.684	EUR	50.722	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	926
	19/10/2022	USD	9.451	EUR	9.458	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	173
	19/10/2022	USD	138.284	EUR	138.388	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.527
	19/10/2022	USD	13.516	EUR	13.526	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	247
	19/10/2022	USD	34	SGD	48	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	EUR	18.818	USD	18.854	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(395)
	19/10/2022	USD	14.017	EUR	13.994	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	289
	19/10/2022	USD	16	SGD	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	16	SGD	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	23.375	USD	22.853	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	77
								(74.438) 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 Contrarian Equity								
	19/10/2022	EUR	558	USD	560	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2022	USD	9.049	SGD	12.717	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	185
	19/10/2022	USD	22	SGD	31	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	20	EUR	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	SGD	368.205	USD	262.044	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.392)
	19/10/2022	SGD	894	USD	636	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2022	SGD	7.839	USD	5.575	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(110)
	19/10/2022	SGD	19	USD	14	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	12	USD	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	210	SGD	295	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/10/2022	SGD	250	USD	178	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2022	SGD	529	USD	376	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/10/2022	USD	5.637	SGD	7.975	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	79
	19/10/2022	USD	14	SGD	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	12	EUR	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	5.640	SGD	8.019	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	51
	19/10/2022	USD	14	SGD	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	12	EUR	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	7.261	SGD	10.409	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2022	USD	18	SGD	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	15	EUR	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	SGD	100	USD	70	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	7.598	SGD	10.871	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21
	19/10/2022	USD	18	SGD	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	16	EUR	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								(5.193) USD
Threadneedle (Lux) - Asia Equities								
	19/10/2022	EUR	561	USD	563	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2022	EUR	558	USD	560	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	19/10/2022	USD	27	EUR	27	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	27	EUR	27	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	11	EUR	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	11	EUR	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	16	EUR	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	16	EUR	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	14	EUR	14	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	14	EUR	14	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								(25) USD
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities								
	19/10/2022	USD	17.837	EUR	17.767	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	407
	19/10/2022	USD	5.556	EUR	5.545	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	116
	19/10/2022	USD	1.725	EUR	1.722	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	36
	19/10/2022	USD	3.781	EUR	3.762	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	91
	19/10/2022	USD	2.924	EUR	2.909	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	70
	19/10/2022	USD	14.283	EUR	14.408	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	149

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								
<i>(continuación)</i>	19/10/2022	USD	115.688	EUR	116.700	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.208
	19/10/2022	USD	20	CHF	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	17	GBP	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	20	EUR	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	1.514.183	SGD	2.142.053	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21.089
	19/10/2022	USD	3.796	EUR	3.790	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	77
	19/10/2022	USD	2.909	EUR	2.940	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25
	19/10/2022	USD	15.474	EUR	15.785	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2022	USD	126.367	EUR	128.911	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(89)
	19/10/2022	USD	21	CHF	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	18	GBP	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	22	EUR	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	1.651.070	SGD	2.345.943	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15.858
	19/10/2022	USD	4.215	EUR	4.288	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/10/2022	USD	12.602	EUR	12.965	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(115)
	19/10/2022	USD	16.748	EUR	17.339	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(261)
	19/10/2022	USD	136.308	EUR	141.119	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.121)
	19/10/2022	USD	23	CHF	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	20	GBP	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	USD	30	EUR	31	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	1.827.679	SGD	2.621.972	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	68
	19/10/2022	EUR	1.616	USD	1.561	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24
	19/10/2022	USD	6.638	EUR	6.891	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(121)
	19/10/2022	EUR	98	USD	94	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2022	USD	1.081	EUR	1.121	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	19/10/2022	EUR	633.149	USD	635.526	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14.433)
	19/10/2022	EUR	5.178.823	USD	5.198.269	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(118.050)
	19/10/2022	CHF	855	USD	892	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(22)
	19/10/2022	GBP	668	USD	771	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26)
	19/10/2022	EUR	886	USD	889	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/10/2022	SGD	97.814.758	USD	69.612.752	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.432.246)
	19/10/2022	USD	21.269	EUR	21.285	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	389
	19/10/2022	USD	173.021	EUR	173.152	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.162
	19/10/2022	USD	38	CHF	37	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	33	GBP	29	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	38	EUR	38	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	2.968.962	SGD	4.172.467	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	60.587
								(1.464.165) USD
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities								
	19/10/2022	EUR	798	USD	801	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	19/10/2022	EUR	21.209	USD	21.289	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(484)
	19/10/2022	EUR	811	USD	814	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/10/2022	CHF	879	USD	917	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(22)
	19/10/2022	EUR	808	USD	811	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	19/10/2022	CHF	888	USD	927	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) - US Disciplined Core Equities								
<i>(continuación)</i>	19/10/2022	EUR	791	USD	794	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	19/10/2022	USD	30	EUR	30	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	809	EUR	809	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
	19/10/2022	USD	31	EUR	31	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	35	CHF	33	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	31	EUR	31	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	35	CHF	34	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	30	EUR	30	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	17	EUR	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	446	EUR	450	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2022	USD	17	EUR	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	19	CHF	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	17	EUR	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	20	CHF	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	17	EUR	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	17	EUR	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	461	EUR	471	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	18	EUR	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	20	CHF	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	18	EUR	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	20	CHF	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	17	EUR	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	20	EUR	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	526	EUR	545	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	19/10/2022	USD	20	EUR	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	23	CHF	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	20	EUR	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	23	CHF	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	26	EUR	27	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								(587) USD
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities								
	19/10/2022	SGD	19.350.010	EUR	13.719.706	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29.770
	19/10/2022	USD	40.939	EUR	40.786	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	948
	19/10/2022	USD	124.378	EUR	123.913	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.879
	19/10/2022	EUR	11.702	SGD	16.507	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(27)
	19/10/2022	EUR	372.445	SGD	522.963	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	845
	19/10/2022	EUR	1.104	USD	1.102	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	19/10/2022	EUR	3.358	USD	3.352	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(59)
	19/10/2022	SGD	15.386	EUR	10.937	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/10/2022	SGD	41.016	EUR	29.073	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	71
	19/10/2022	EUR	319.777	SGD	450.067	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26)
	19/10/2022	EUR	950	USD	948	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	19/10/2022	EUR	2.889	USD	2.885	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(52)
	19/10/2022	SGD	7.540	EUR	5.334	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24
	19/10/2022	SGD	8.112	EUR	5.742	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) - Pan European ESG Equities								
<i>(continuación)</i>	19/10/2022	SGD	7.630	EUR	5.404	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2022	SGD	3.189	EUR	2.277	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2022	EUR	286.258	SGD	398.851	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.851
	19/10/2022	EUR	853	USD	836	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	EUR	2.602	USD	2.551	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2022	SGD	11.696	EUR	8.381	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(70)
	19/10/2022	SGD	32.327	EUR	23.279	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(309)
	19/10/2022	EUR	291.457	SGD	403.940	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.436
	19/10/2022	EUR	867	USD	837	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/10/2022	EUR	2.640	USD	2.550	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	41
	19/10/2022	SGD	8.817	EUR	6.362	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(97)
	19/10/2022	SGD	38.206	EUR	27.592	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(444)
	19/10/2022	SGD	3.439	EUR	2.478	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(35)
	19/10/2022	SGD	6.908	EUR	4.921	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
								40.737 EUR
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities								
	19/10/2022	SGD	11.657.806	EUR	8.265.715	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17.936
	19/10/2022	CHF	44.547	EUR	46.299	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(82)
	19/10/2022	USD	160.457	EUR	159.857	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.716
	19/10/2022	USD	12.904	EUR	12.856	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	299
	19/10/2022	EUR	127	SGD	180	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	190.062	SGD	266.873	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	431
	19/10/2022	EUR	1.082	CHF	1.038	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2022	EUR	3.676	USD	3.669	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(65)
	19/10/2022	EUR	297	USD	297	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	19/10/2022	EUR	23.945	SGD	33.686	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/10/2022	SGD	19.411	EUR	13.759	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	34
	19/10/2022	EUR	232.387	SGD	327.071	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	19/10/2022	EUR	1.313	CHF	1.267	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	EUR	4.513	USD	4.507	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(82)
	19/10/2022	EUR	363	USD	363	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/10/2022	SGD	2.661	EUR	1.883	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2022	EUR	34.801	SGD	49.164	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(134)
	19/10/2022	EUR	179.807	SGD	252.234	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	578
	19/10/2022	EUR	1.023	CHF	977	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/10/2022	EUR	3.501	USD	3.471	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(37)
	19/10/2022	EUR	283	USD	280	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2022	SGD	2.065	EUR	1.463	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2022	SGD	4.172	EUR	2.978	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	19/10/2022	EUR	7.827	SGD	10.923	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	65
	19/10/2022	EUR	304.962	SGD	424.165	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.568
	19/10/2022	EUR	1.709	CHF	1.632	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
	19/10/2022	EUR	6.005	USD	5.824	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	68
	19/10/2022	EUR	484	USD	469	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2022	SGD	882	EUR	635	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) - Pan European Small Cap Opportunities <i>(continuación)</i>								
	19/10/2022	SGD	1.203	EUR	868	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2022	SGD	6.077	EUR	4.389	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(71)
	19/10/2022	EUR	3.983	SGD	5.527	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	56
	19/10/2022	EUR	309.648	SGD	436.344	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(405)
	19/10/2022	EUR	1.755	CHF	1.686	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2022	EUR	6.107	USD	6.014	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(25)
	19/10/2022	EUR	493	USD	485	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2022	SGD	1.063	EUR	758	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
								25.839 EUR
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies								
	19/10/2022	CHF	2.381.542	EUR	2.475.224	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.362)
	19/10/2022	USD	18.811.148	EUR	18.740.776	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	435.487
	19/10/2022	CHF	6.743.323	EUR	7.008.582	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12.351)
	19/10/2022	USD	9.524.911	EUR	9.489.279	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	220.506
	19/10/2022	CHF	162.331	EUR	168.716	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(297)
	19/10/2022	USD	1.593.330	EUR	1.587.369	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	36.885
	19/10/2022	EUR	10.229	CHF	9.815	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	46
	19/10/2022	EUR	67.352	CHF	64.889	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29
	19/10/2022	EUR	497.675	USD	498.420	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10.433)
	19/10/2022	EUR	189.700	CHF	182.763	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	82
	19/10/2022	EUR	250.807	USD	251.182	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.258)
	19/10/2022	EUR	4.568	CHF	4.401	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2022	EUR	41.894	USD	41.957	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(878)
	19/10/2022	EUR	173.119	USD	173.999	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.263)
	19/10/2022	EUR	51.771	CHF	50.076	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(183)
	19/10/2022	EUR	384.604	USD	385.792	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.688)
	19/10/2022	EUR	145.794	CHF	141.020	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(514)
	19/10/2022	EUR	193.957	USD	194.556	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.381)
	19/10/2022	EUR	3.514	CHF	3.399	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
	19/10/2022	EUR	31.390	USD	31.487	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(709)
	19/10/2022	EUR	108.288	CHF	104.409	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(37)
	19/10/2022	EUR	40.128	CHF	38.244	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	450
	19/10/2022	EUR	79.817	CHF	76.520	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	427
	19/10/2022	EUR	618.715	USD	606.507	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	437
	19/10/2022	EUR	229.139	CHF	219.675	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.225
	19/10/2022	EUR	312.757	USD	306.586	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	221
	19/10/2022	EUR	5.551	CHF	5.321	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30
	19/10/2022	EUR	46.365	USD	45.450	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	33
	19/10/2022	EUR	106.276	USD	104.484	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(236)
	19/10/2022	EUR	689.802	USD	678.167	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.529)
	19/10/2022	EUR	50.516	CHF	48.228	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	479
	19/10/2022	EUR	410.732	USD	398.374	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.631
	19/10/2022	EUR	148.892	CHF	142.148	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.412
	19/10/2022	EUR	192.643	USD	186.847	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.173
	19/10/2022	EUR	3.611	CHF	3.448	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	34

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 <i>(continuación)</i>								
	19/10/2022	EUR	31.002	USD	30.069	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	350
	19/10/2022	EUR	151.025	USD	145.493	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.712
	19/10/2022	EUR	46	USD	45	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	EUR	21.941	USD	21.154	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	377
	19/10/2022	EUR	77.379	CHF	74.348	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	242
	19/10/2022	EUR	609.444	USD	600.242	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.452)
	19/10/2022	EUR	227.426	CHF	218.518	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	711
	19/10/2022	EUR	287.870	USD	283.523	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.158)
	19/10/2022	EUR	5.515	CHF	5.299	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2022	EUR	46.236	USD	45.538	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(186)
	19/10/2022	EUR	90.223	CHF	86.417	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	565
								651.637 EUR
Threadneedle (Lux) - European Select								
	19/10/2022	USD	2.083.355	EUR	2.075.561	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	48.231
	19/10/2022	USD	871	EUR	868	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
	19/10/2022	GBP	113.982	EUR	131.173	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.411)
	19/10/2022	GBP	5.954.852	EUR	6.852.989	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(73.717)
	19/10/2022	SGD	29.765.648	EUR	21.104.689	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	45.796
	19/10/2022	USD	4.547.533	EUR	4.530.520	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	105.278
	19/10/2022	EUR	49.947	USD	49.910	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(932)
	19/10/2022	EUR	21	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	3.177	GBP	2.763	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	32
	19/10/2022	EUR	165.838	GBP	144.206	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.669
	19/10/2022	EUR	511.989	SGD	719.123	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.005
	19/10/2022	EUR	109.005	USD	108.923	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.035)
	19/10/2022	EUR	53.078	GBP	46.122	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	571
	19/10/2022	SGD	512	EUR	363	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	EUR	402.165	GBP	347.729	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.300
	19/10/2022	EUR	209	SGD	293	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	15.000	EUR	17.221	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(144)
	19/10/2022	SGD	1.190	EUR	844	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2022	EUR	74.073	USD	73.977	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.342)
	19/10/2022	EUR	31	USD	31	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	EUR	4.678	GBP	4.100	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/10/2022	EUR	229.124	GBP	200.823	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	499
	19/10/2022	EUR	749.367	SGD	1.054.692	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(62)
	19/10/2022	EUR	161.632	USD	161.425	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.930)
	19/10/2022	EUR	55.009	GBP	48.327	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/10/2022	EUR	957	SGD	1.353	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/10/2022	EUR	41.091	GBP	36.116	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(25)
	19/10/2022	EUR	2.154	USD	2.161	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(49)
	19/10/2022	EUR	2.283	GBP	2.002	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/10/2022	EUR	52.633	USD	51.594	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	37
	19/10/2022	EUR	22	USD	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	3.271	GBP	2.862	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/10/2022	EUR	156.366	GBP	136.822	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	602

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>	19/10/2022	EUR	530.028	SGD	738.501	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.278
	19/10/2022	EUR	114.724	USD	112.460	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	81
	19/10/2022	EUR	226.827	SGD	316.553	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.897
	19/10/2022	EUR	17.192	GBP	15.327	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(257)
	19/10/2022	SGD	3.967	EUR	2.857	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(38)
	19/10/2022	EUR	30.842	GBP	27.605	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(586)
	19/10/2022	EUR	16.313	GBP	14.580	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(286)
	19/10/2022	EUR	3.163	SGD	4.380	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	51
	19/10/2022	EUR	1.050	GBP	941	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(22)
	19/10/2022	EUR	38.840	USD	38.254	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(156)
	19/10/2022	EUR	16	USD	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	2.429	GBP	2.140	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/10/2022	EUR	115.363	GBP	101.622	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(328)
	19/10/2022	EUR	388.799	SGD	547.882	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(508)
	19/10/2022	EUR	84.621	USD	83.343	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(340)
	19/10/2022	GBP	550	EUR	621	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
								132.193 EUR
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies								
	19/10/2022	CHF	727	EUR	756	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	CHF	8.778.127	EUR	9.123.429	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16.078)
	19/10/2022	CHF	2.716	EUR	2.823	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	19/10/2022	EUR	20	CHF	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	246.797	CHF	236.622	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.300
	19/10/2022	EUR	76	CHF	73	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	26	CHF	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	309.622	CHF	298.738	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(320)
	19/10/2022	EUR	96	CHF	92	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	29	CHF	28	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	351.905	CHF	337.370	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.881
	19/10/2022	EUR	109	CHF	104	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	EUR	28	CHF	27	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	335.502	CHF	322.362	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.050
	19/10/2022	EUR	104	CHF	100	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	CHF	110.244	EUR	115.100	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(721)
								(12.893) EUR
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income								
	19/10/2022	EUR	1.084.830	USD	1.088.904	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24.729)
	19/10/2022	GBP	153.077	USD	176.850	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.898)
	19/10/2022	USD	70.372	EUR	70.425	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.286
	19/10/2022	USD	36.247	EUR	36.274	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	662
	19/10/2022	USD	5.707	GBP	4.965	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	162
	19/10/2022	EUR	47.571	USD	47.484	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(819)
	19/10/2022	EUR	24.705	USD	24.660	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(425)
	19/10/2022	GBP	3.466	USD	3.997	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(126)
	19/10/2022	EUR	100	USD	100	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) - Asian Equity Income <i>(continuación)</i>								
	19/10/2022	EUR	10.000	USD	10.014	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(204)
	19/10/2022	EUR	96	USD	96	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2022	USD	72.038	EUR	73.228	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	204
	19/10/2022	USD	37.152	EUR	37.765	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	105
	19/10/2022	USD	5.910	GBP	5.264	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	31
	19/10/2022	EUR	2.091.315	USD	2.099.168	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(47.673)
	19/10/2022	EUR	6.000	USD	5.899	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2022	USD	50.368	EUR	51.931	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(573)
	19/10/2022	USD	25.923	EUR	26.727	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(295)
	19/10/2022	USD	4.143	GBP	3.853	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(160)
	19/10/2022	EUR	1.000	USD	972	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/10/2022	EUR	799	USD	772	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
	19/10/2022	USD	39.650	EUR	41.338	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(900)
	19/10/2022	USD	20.366	EUR	21.233	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(462)
	19/10/2022	USD	3.213	GBP	3.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(137)
	19/10/2022	EUR	4.988	USD	4.876	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
								(79.930) USD
Threadneedle (Lux) - Global Technology								
	19/10/2022	EUR	2.694.680	USD	2.704.799	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(61.425)
	19/10/2022	EUR	34.837.535	USD	34.968.350	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(794.122)
	19/10/2022	EUR	35.935.835	USD	36.070.774	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(819.157)
	19/10/2022	EUR	1.252.795	USD	1.257.499	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28.557)
	19/10/2022	CHF	858.032	USD	895.068	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21.805)
	19/10/2022	USD	114.712	EUR	114.799	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.097
	19/10/2022	USD	1.480.606	EUR	1.481.722	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	27.060
	19/10/2022	USD	1.523.843	EUR	1.524.992	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	27.850
	19/10/2022	USD	53.139	EUR	53.179	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	971
	19/10/2022	USD	37.810	CHF	36.271	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	893
	19/10/2022	EUR	15.069	USD	15.128	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(346)
	19/10/2022	EUR	7.369	USD	7.398	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(169)
	19/10/2022	EUR	8.020	USD	8.051	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(184)
	19/10/2022	USD	16.371	EUR	16.307	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	374
	19/10/2022	CHF	93	USD	97	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2022	EUR	36.930	USD	37.001	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(774)
	19/10/2022	EUR	28.679	USD	28.734	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(601)
	19/10/2022	USD	7.937	EUR	7.925	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	164
	19/10/2022	USD	54.714	EUR	54.785	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	971
	19/10/2022	USD	692.305	EUR	693.196	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12.291
	19/10/2022	USD	711.076	EUR	711.991	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12.624
	19/10/2022	USD	24.462	EUR	24.494	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	434
	19/10/2022	USD	17.605	CHF	17.002	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	300
	19/10/2022	EUR	5.988	USD	6.018	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(144)
	19/10/2022	USD	2.800	EUR	2.786	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	67
	19/10/2022	USD	41	EUR	41	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	701	EUR	699	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
	19/10/2022	USD	673.895	EUR	671.721	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14.944

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)								
	19/10/2022	USD	125	EUR	124	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2022	EUR	1.000	USD	1.001	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/10/2022	USD	142.230	EUR	142.034	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.896
	19/10/2022	EUR	50	USD	50	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	USD	57.624	EUR	58.575	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	163
	19/10/2022	USD	710.253	EUR	721.983	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.014
	19/10/2022	USD	746.358	EUR	758.685	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.116
	19/10/2022	USD	25.676	EUR	26.100	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	73
	19/10/2022	USD	18.672	CHF	17.976	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	376
	19/10/2022	EUR	13.304	USD	13.165	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(114)
	19/10/2022	USD	3.105	EUR	3.138	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	27
	19/10/2022	USD	263	EUR	266	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2022	USD	4.027	EUR	4.096	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/10/2022	USD	13.394	EUR	13.624	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30
	19/10/2022	USD	262	EUR	267	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	81.107	EUR	83.623	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(923)
	19/10/2022	USD	995.504	EUR	1.026.386	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11.326)
	19/10/2022	USD	1.051.575	EUR	1.084.196	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11.963)
	19/10/2022	USD	36.161	EUR	37.282	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(411)
	19/10/2022	USD	25.940	CHF	25.527	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40)
	19/10/2022	USD	320	EUR	330	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2022	EUR	9.102	USD	8.847	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	81
	19/10/2022	USD	5.584	EUR	5.779	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(85)
	19/10/2022	USD	1.559	EUR	1.613	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24)
	19/10/2022	USD	203.461	EUR	210.567	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.092)
	19/10/2022	EUR	100	USD	97	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	EUR	595	USD	573	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/10/2022	USD	29.648	EUR	30.775	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(541)
	19/10/2022	EUR	16.030	USD	15.455	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	270
	19/10/2022	USD	23.401	EUR	24.272	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(408)
	19/10/2022	EUR	6.781	USD	6.538	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	114
	19/10/2022	EUR	25.906	USD	24.977	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	437
	19/10/2022	EUR	3.036	USD	2.968	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/10/2022	USD	22.008	EUR	22.511	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(74)
	19/10/2022	EUR	25.090	USD	24.529	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	83
								(1.646.538) USD
Threadneedle (Lux) - UK Equities								
	19/10/2022	CHF	67.909	GBP	61.331	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	557
	19/10/2022	EUR	6.198.916	GBP	5.386.501	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	58.573
	19/10/2022	EUR	3.243.063	GBP	2.818.034	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30.642
	19/10/2022	USD	624.127	GBP	540.229	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18.640
	19/10/2022	EUR	958.334	GBP	832.737	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9.055
	19/10/2022	CHF	38.828	GBP	35.067	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	318
	19/10/2022	EUR	1.078.730	GBP	937.355	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10.193
	19/10/2022	EUR	5.204.457	GBP	4.522.373	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	49.176
	19/10/2022	CHF	92.001	GBP	83.089	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	755

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)								
	19/10/2022	USD	4.106.763	GBP	3.554.712	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	122.648
	19/10/2022	EUR	31.898	GBP	27.718	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	301
	19/10/2022	CHF	62.595	GBP	56.531	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	513
	19/10/2022	USD	966	GBP	837	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29
	19/10/2022	EUR	799	GBP	694	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2022	CHF	884	GBP	798	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/10/2022	USD	973	GBP	842	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29
	19/10/2022	EUR	798	GBP	694	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2022	CHF	883	GBP	797	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/10/2022	USD	972	GBP	842	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29
	19/10/2022	GBP	43.101	EUR	49.601	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(468)
	19/10/2022	GBP	2.000	CHF	2.217	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/10/2022	GBP	175.333	EUR	202.570	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.601)
	19/10/2022	GBP	91.110	EUR	105.264	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.351)
	19/10/2022	GBP	17.491	USD	20.171	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(571)
	19/10/2022	GBP	27.119	EUR	31.332	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(402)
	19/10/2022	GBP	1.142	CHF	1.266	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2022	GBP	30.599	EUR	35.353	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(454)
	19/10/2022	GBP	147.209	EUR	170.078	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.184)
	19/10/2022	GBP	2.705	CHF	2.998	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(27)
	19/10/2022	GBP	115.057	USD	132.686	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.756)
	19/10/2022	GBP	902	EUR	1.042	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2022	GBP	1.841	CHF	2.040	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	19/10/2022	GBP	27	USD	31	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	GBP	23	EUR	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	26	CHF	29	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	27	USD	31	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	GBP	23	EUR	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	26	CHF	29	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	27	USD	31	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	GBP	3.074	EUR	3.529	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26)
	19/10/2022	GBP	1.600	EUR	1.837	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	19/10/2022	GBP	1.206	CHF	1.318	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2022	GBP	103.199	EUR	118.029	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(477)
	19/10/2022	GBP	53.563	EUR	61.261	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(247)
	19/10/2022	GBP	15.921	EUR	18.210	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(74)
	19/10/2022	GBP	685	CHF	749	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2022	GBP	18.216	EUR	20.834	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(84)
	19/10/2022	GBP	86.626	EUR	99.075	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(400)
	19/10/2022	GBP	1.622	CHF	1.773	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2022	GBP	531	EUR	607	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2022	GBP	1.103	CHF	1.206	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/10/2022	GBP	13	EUR	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	16	CHF	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	13	EUR	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	16	CHF	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	30.164	EUR	34.403	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(55)

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)								
	19/10/2022	GBP	14.261	EUR	16.265	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26)
	19/10/2022	GBP	12.927	EUR	14.744	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24)
	19/10/2022	EUR	8.630	GBP	7.532	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	49
	19/10/2022	GBP	6.405	EUR	7.339	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(41)
	19/10/2022	GBP	643	EUR	736	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/10/2022	GBP	22.317	EUR	25.571	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(144)
	19/10/2022	GBP	15.950	USD	17.882	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(63)
	19/10/2022	GBP	104.816	USD	117.514	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(412)
	19/10/2022	GBP	25	USD	28	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	25	USD	28	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	25	USD	28	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	130.005	GBP	113.424	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	771
	19/10/2022	GBP	4.362	EUR	5.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30)
	19/10/2022	GBP	3.371	EUR	3.863	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23)
	19/10/2022	GBP	1.441	CHF	1.525	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	51
	19/10/2022	GBP	128.333	EUR	142.227	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.399
	19/10/2022	GBP	65.149	EUR	72.202	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.726
	19/10/2022	GBP	19.597	EUR	21.719	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	519
	19/10/2022	GBP	822	CHF	870	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29
	19/10/2022	GBP	22.273	EUR	24.685	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	590
	19/10/2022	GBP	105.831	EUR	117.288	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.803
	19/10/2022	GBP	1.947	CHF	2.061	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	69
	19/10/2022	GBP	609	EUR	675	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
	19/10/2022	GBP	1.324	CHF	1.402	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	47
	19/10/2022	GBP	16	EUR	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	19	CHF	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	GBP	16	EUR	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	19	CHF	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	EUR	57.776	GBP	51.713	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(963)
	19/10/2022	GBP	7.961	EUR	8.894	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	148
	19/10/2022	GBP	2.284	EUR	2.555	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	39
	19/10/2022	GBP	75.003	USD	80.842	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.614
	19/10/2022	GBP	20.485	EUR	22.840	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	423
	19/10/2022	GBP	12.023	EUR	13.404	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	248
	19/10/2022	GBP	1.247.129	EUR	1.390.468	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25.729
	19/10/2022	GBP	13.908	EUR	15.506	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	287
	19/10/2022	GBP	1.392	CHF	1.518	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/10/2022	GBP	123.502	EUR	140.202	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	350
	19/10/2022	GBP	60.927	EUR	69.165	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	172
	19/10/2022	GBP	19.253	USD	21.519	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16)
	19/10/2022	GBP	18.252	EUR	20.720	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	52
	19/10/2022	GBP	792	CHF	864	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2022	GBP	21.093	EUR	23.946	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	60
	19/10/2022	GBP	77.412	EUR	87.880	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	219
	19/10/2022	GBP	1.874	CHF	2.044	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
	19/10/2022	GBP	125.294	USD	140.043	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(106)
	19/10/2022	GBP	281	EUR	319	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) - UK Equities (continuación)								
	19/10/2022	GBP	1.275	CHF	1.390	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2022	GBP	30	USD	33	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	15	EUR	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	18	CHF	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	30	USD	33	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	15	EUR	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	18	CHF	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	30	USD	33	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	5.895	EUR	6.655	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	49
	19/10/2022	GBP	892	EUR	1.007	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
								326.899 GBP
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income								
	19/10/2022	EUR	1.924.043	GBP	1.671.882	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18.180
	19/10/2022	EUR	52.781	GBP	45.864	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	499
	19/10/2022	EUR	259.733	GBP	225.693	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.454
	19/10/2022	CHF	119.448	GBP	107.878	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	980
	19/10/2022	USD	5.609.980	GBP	4.855.859	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	167.543
	19/10/2022	SGD	1.341	GBP	826	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
	19/10/2022	EUR	548.324	GBP	476.462	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.181
	19/10/2022	EUR	115.257	GBP	100.152	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.089
	19/10/2022	EUR	226.470	GBP	196.789	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.140
	19/10/2022	USD	1.894.864	GBP	1.640.147	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	56.590
	19/10/2022	USD	1.038	GBP	899	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	31
	19/10/2022	EUR	2.950.543	GBP	2.563.851	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	27.879
	19/10/2022	CHF	333.259	GBP	300.977	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.734
	19/10/2022	USD	1.146.071	GBP	992.011	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	34.228
	19/10/2022	CHF	334.446	GBP	302.049	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.743
	19/10/2022	CHF	949	GBP	857	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2022	USD	3.114.788	GBP	2.696.083	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	93.023
	19/10/2022	EUR	1.596.982	GBP	1.387.685	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15.090
	19/10/2022	USD	27.238	GBP	23.576	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	813
	19/10/2022	EUR	497.827	GBP	432.583	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.704
	19/10/2022	GBP	61.460	EUR	71.007	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(912)
	19/10/2022	GBP	1.688	EUR	1.950	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(25)
	19/10/2022	GBP	5.039	EUR	5.822	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(75)
	19/10/2022	GBP	3.963	CHF	4.392	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(39)
	19/10/2022	GBP	177.722	USD	204.952	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.802)
	19/10/2022	GBP	30	SGD	49	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	17.515	EUR	20.236	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(260)
	19/10/2022	GBP	3.686	EUR	4.258	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(55)
	19/10/2022	GBP	7.226	EUR	8.349	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(107)
	19/10/2022	GBP	59.962	USD	69.149	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.958)
	19/10/2022	GBP	19	USD	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	GBP	94.230	EUR	108.869	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.398)
	19/10/2022	GBP	11.067	CHF	12.264	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(110)
	19/10/2022	GBP	36.299	USD	41.860	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.185)

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)								
	19/10/2022	GBP	6.716	CHF	7.443	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(67)
	19/10/2022	GBP	31	CHF	35	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	98.541	USD	113.639	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.217)
	19/10/2022	GBP	30.922	EUR	35.726	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(459)
	19/10/2022	GBP	510	USD	588	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	19/10/2022	GBP	15.880	EUR	18.347	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(236)
	19/10/2022	GBP	11.960	EUR	13.833	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(190)
	19/10/2022	USD	23.896	GBP	20.622	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	775
	19/10/2022	EUR	10.000	GBP	8.710	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	74
	19/10/2022	GBP	17.301	EUR	19.863	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(146)
	19/10/2022	GBP	29.239	EUR	33.283	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2022	GBP	32.117	EUR	36.732	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(148)
	19/10/2022	GBP	891	EUR	1.019	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/10/2022	GBP	4.157	EUR	4.754	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	19/10/2022	GBP	2.109	CHF	2.305	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2022	GBP	16	SGD	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	8.874	EUR	10.149	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(41)
	19/10/2022	GBP	1.946	EUR	2.226	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/10/2022	GBP	3.777	EUR	4.320	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	19/10/2022	GBP	49.450	EUR	56.556	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(228)
	19/10/2022	GBP	5.913	CHF	6.463	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	19/10/2022	GBP	5.991	CHF	6.548	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	19/10/2022	GBP	17	CHF	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	27.016	EUR	30.898	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(125)
	19/10/2022	GBP	8.289	EUR	9.481	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(38)
	19/10/2022	USD	105.834	GBP	92.665	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.103
	19/10/2022	GBP	122.555	USD	137.403	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(481)
	19/10/2022	GBP	41.138	USD	46.122	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(162)
	19/10/2022	GBP	23	USD	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	25.004	USD	28.033	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(98)
	19/10/2022	GBP	68.670	USD	76.990	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(270)
	19/10/2022	GBP	601	USD	674	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2022	GBP	32.152	EUR	35.633	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	852
	19/10/2022	GBP	896	EUR	993	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24
	19/10/2022	GBP	4.203	EUR	4.659	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	111
	19/10/2022	GBP	8.931	EUR	9.898	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	237
	19/10/2022	GBP	1.956	EUR	2.168	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	52
	19/10/2022	GBP	3.822	EUR	4.236	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	101
	19/10/2022	GBP	49.910	EUR	55.313	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.322
	19/10/2022	GBP	27.341	EUR	30.301	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	724
	19/10/2022	GBP	8.395	EUR	9.304	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	222
	19/10/2022	GBP	68.413	EUR	76.741	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.004
	19/10/2022	GBP	21.007	EUR	23.564	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	308
	19/10/2022	GBP	21	SGD	33	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	GBP	291.751	EUR	325.956	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.429
	19/10/2022	GBP	173.730	USD	187.555	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.788
	19/10/2022	GBP	97.968	USD	105.764	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.264

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)								
	19/10/2022	GBP	3.181	CHF	3.371	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	109
	19/10/2022	GBP	155.423	USD	166.462	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.369
	19/10/2022	GBP	8.610	EUR	9.614	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	164
	19/10/2022	GBP	36.772	USD	39.384	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.507
	19/10/2022	GBP	22	USD	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	GBP	8.905	CHF	9.437	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	305
	19/10/2022	GBP	23.620	USD	25.297	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	968
	19/10/2022	GBP	9.031	CHF	9.570	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	309
	19/10/2022	GBP	25	CHF	27	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	GBP	65.535	USD	70.189	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.686
	19/10/2022	GBP	568	USD	608	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	19/10/2022	GBP	2.159	EUR	2.408	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	44
	19/10/2022	GBP	40.705	EUR	46.209	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	115
	19/10/2022	GBP	1.489	EUR	1.690	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/10/2022	GBP	6.978	EUR	7.922	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
	19/10/2022	GBP	2.419	CHF	2.638	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
	19/10/2022	GBP	108.952	USD	121.777	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(92)
	19/10/2022	GBP	28	SGD	45	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	10.113	EUR	11.480	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29
	19/10/2022	GBP	1.909	EUR	2.167	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2022	GBP	6.346	EUR	7.204	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
	19/10/2022	GBP	33.169	USD	37.073	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28)
	19/10/2022	GBP	21	USD	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	82.886	EUR	94.094	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	235
	19/10/2022	GBP	6.758	CHF	7.368	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	43
	19/10/2022	GBP	22.490	USD	25.137	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	19/10/2022	GBP	6.874	CHF	7.495	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	43
	19/10/2022	GBP	19	CHF	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	61.475	USD	68.712	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(52)
	19/10/2022	GBP	44.666	EUR	50.706	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	126
	19/10/2022	GBP	542	USD	606	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	13.936	EUR	15.821	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	39
	19/10/2022	GBP	295	EUR	333	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2022	GBP	49.091	EUR	55.426	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	404
	19/10/2022	GBP	30.237	EUR	34.140	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	249
								454.109 GBP
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha								
	19/10/2022	EUR	107.510	USD	107.914	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.451)
	19/10/2022	EUR	2.450.162	USD	2.459.363	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(55.851)
	19/10/2022	GBP	1.878.133	USD	2.169.809	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(72.368)
	19/10/2022	GBP	10.743.256	USD	12.411.696	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(413.960)
	19/10/2022	GBP	28.790	USD	33.261	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.109)
	19/10/2022	EUR	798	USD	801	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	19/10/2022	USD	43.398	EUR	43.315	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	907
	19/10/2022	USD	9.988	EUR	9.955	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	221
	19/10/2022	EUR	985	USD	988	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) - American Absolute Alpha								
<i>(continuación)</i>	19/10/2022	EUR	3.301	USD	3.306	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(67)
	19/10/2022	EUR	2.401	USD	2.376	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21)
	19/10/2022	USD	15.597	EUR	15.911	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2022	USD	241	CHF	236	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	2.366	EUR	2.414	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2022	USD	50.079	EUR	51.087	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(35)
	19/10/2022	USD	17	EUR	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	450	GBP	400	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/10/2022	EUR	8.530	USD	8.387	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	19/10/2022	USD	338	GBP	314	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2022	USD	52.039	GBP	48.401	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.014)
	19/10/2022	USD	284.093	GBP	264.237	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10.994)
	19/10/2022	USD	802	GBP	746	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(31)
	19/10/2022	USD	450	EUR	466	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/10/2022	EUR	10.052	USD	9.684	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	177
	19/10/2022	USD	8.533	EUR	8.851	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(149)
	19/10/2022	EUR	2.399	USD	2.346	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2022	EUR	716.029	USD	718.718	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16.322)
	19/10/2022	CHF	10.470	USD	10.922	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(266)
	19/10/2022	GBP	12.636	USD	14.599	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(487)
								(574.899) USD
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities								
	19/10/2022	USD	2.010.299	EUR	2.002.779	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	46.539
	19/10/2022	GBP	312.850	EUR	360.036	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.873)
	19/10/2022	GBP	7.055.004	EUR	8.119.071	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(87.337)
	19/10/2022	GBP	2.525.298	EUR	2.906.175	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(31.262)
	19/10/2022	GBP	1.676.387	EUR	1.929.227	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20.753)
	19/10/2022	GBP	685	EUR	788	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	19/10/2022	GBP	76.725	EUR	88.297	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(950)
	19/10/2022	GBP	95	EUR	110	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	EUR	4.820	GBP	4.188	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	52
	19/10/2022	EUR	940	GBP	813	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
	19/10/2022	EUR	33	GBP	28	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	EUR	115	GBP	100	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	GBP	34	EUR	39	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	371	EUR	369	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2022	EUR	18.281	GBP	16.068	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2022	GBP	1.061	EUR	1.210	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2022	EUR	61	GBP	53	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	10	USD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	6.329	GBP	5.524	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	41
	19/10/2022	EUR	45	GBP	39	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	3.220	EUR	3.691	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(25)
	19/10/2022	EUR	10.938	GBP	9.751	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(163)
	19/10/2022	EUR	51	GBP	45	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	GBP	17	EUR	19	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)								
	19/10/2022	EUR	1.326	USD	1.278	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24
	19/10/2022	GBP	7.351	EUR	8.225	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	144
	19/10/2022	EUR	29.703	USD	28.704	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	443
	19/10/2022	EUR	4.970	GBP	4.457	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(104)
	19/10/2022	EUR	111.725	GBP	100.194	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.342)
	19/10/2022	EUR	39.236	GBP	35.186	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(822)
	19/10/2022	EUR	27.175	GBP	24.370	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(570)
	19/10/2022	EUR	11	GBP	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	1.216	GBP	1.091	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(25)
	19/10/2022	EUR	149	GBP	133	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2022	USD	608	EUR	622	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2022	EUR	447	GBP	396	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	05/10/2022	EUR	124.432.840	USD	124.640.892	Operaciones comerciales	Lloyds	(2.757.808)
	05/10/2022	EUR	147.080.882	GBP	127.195.841	Operaciones comerciales	Lloyds	2.174.766
	05/10/2022	GBP	580.750	EUR	669.917	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(8.303)
	05/10/2022	GBP	389.634	EUR	450.384	Operaciones comerciales	Barclays	(6.498)
	05/10/2022	GBP	761.880	EUR	882.342	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(14.378)
	05/10/2022	GBP	373.015	EUR	432.947	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(7.993)
	05/10/2022	USD	402.403	EUR	405.087	Operaciones comerciales	Barclays	5.545
	05/10/2022	USD	5.000.000	EUR	4.992.852	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	109.397
	05/10/2022	GBP	6.250.000	EUR	7.202.369	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(82.119)
	05/10/2022	EUR	488.993	GBP	425.342	Operaciones comerciales	Lloyds	4.427
	05/10/2022	USD	1.000.000	EUR	989.642	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	30.808
	05/10/2022	GBP	3.000.000	EUR	3.462.168	Operaciones comerciales	Lloyds	(44.448)
	05/10/2022	USD	1.000.000	EUR	999.738	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	20.712
	05/10/2022	GBP	324.393	EUR	370.211	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(650)
	05/10/2022	USD	1.009.661	EUR	1.007.425	Operaciones comerciales	Barclays	22.883
	05/10/2022	EUR	459.199	USD	455.665	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(5.786)
	05/10/2022	GBP	602.023	EUR	689.597	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(3.748)
	05/10/2022	USD	359.187	EUR	363.787	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	2.745
	05/10/2022	GBP	823.810	EUR	916.063	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	22.454
	05/10/2022	GBP	772.941	EUR	866.968	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	13.597
	05/10/2022	USD	899.598	EUR	932.858	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(14.863)
	05/10/2022	USD	342.380	EUR	358.277	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(8.895)
	05/10/2022	GBP	500.000	EUR	556.478	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	13.142
	05/10/2022	GBP	1.090.707	EUR	1.219.671	Operaciones comerciales	Lloyds	22.907
	05/10/2022	GBP	1.947.750	EUR	2.177.339	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	41.616
								(571.480) EUR
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities								
	19/10/2022	GBP	701	EUR	807	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/10/2022	USD	966	EUR	962	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
	19/10/2022	GBP	702	EUR	808	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/10/2022	USD	972	EUR	969	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	19/10/2022	GBP	707	EUR	813	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/10/2022	USD	965	EUR	962	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 Investment Grade Credit Opportunities (continuación)								
	19/10/2022	CHF	880	EUR	914	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2022	GBP	697	EUR	802	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/10/2022	USD	970	EUR	967	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
	19/10/2022	GBP	707	EUR	814	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/10/2022	SEK	8.181	EUR	768	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16)
	19/10/2022	NOK	8.259	EUR	819	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(46)
	19/10/2022	NOK	8.320	EUR	825	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(46)
	19/10/2022	GBP	23.452.446	EUR	26.989.647	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(290.326)
	19/10/2022	USD	975	EUR	971	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	19/10/2022	EUR	570.270	GBP	500.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.048
	19/10/2022	EUR	10	CHF	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	CHF	883	EUR	917	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2022	USD	5.981	EUR	5.959	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	138
	03/10/2022	GBP	250.000	EUR	288.129	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(3.288)
	03/10/2022	USD	250.000	EUR	248.614	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	6.539
	03/10/2022	GBP	130.000	EUR	148.335	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(218)
	03/10/2022	USD	73.189	EUR	73.038	Operaciones comerciales	Barclays	1.660
	03/10/2022	GBP	42.957	EUR	49.212	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(268)
	03/10/2022	GBP	44.580	EUR	49.549	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	1.244
	03/10/2022	GBP	50.223	EUR	56.350	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	872
	03/10/2022	USD	56.309	EUR	58.400	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(930)
	03/11/2022	EUR	8.331.943	USD	8.096.803	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	87.080
	03/11/2022	EUR	6.121.848	GBP	5.464.040	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(93.763)
	03/10/2022	EUR	8.373.440	USD	8.401.812	Operaciones comerciales	Barclays	(201.576)
	03/10/2022	EUR	7.063.860	GBP	6.090.737	Operaciones comerciales	Barclays	124.307
	03/10/2022	GBP	38.500	EUR	44.693	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(827)
	03/10/2022	USD	60.490	EUR	60.902	Operaciones comerciales	Barclays	835
	03/10/2022	EUR	135.958	USD	134.980	Operaciones comerciales	Barclays	(1.805)
								(369.323) EUR
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha								
	19/10/2022	USD	976	EUR	972	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	19/10/2022	GBP	201.987	EUR	232.452	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.500)
	19/10/2022	GBP	10.821.211	EUR	12.453.313	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(133.960)
	19/10/2022	GBP	704	EUR	811	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/10/2022	CHF	859	EUR	893	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2022	EUR	19	USD	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	243.356	GBP	213.274	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	556
	19/10/2022	EUR	497	GBP	436	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	EUR	30	USD	30	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	7.116	GBP	6.227	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	27
	19/10/2022	EUR	377.139	GBP	330.001	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.452
	19/10/2022	EUR	25	GBP	22	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) - Pan European Absolute Alpha								
(continuación)	19/10/2022	EUR	29	CHF	28	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	GBP	455	EUR	510	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
								(134.404) EUR
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha								
	19/10/2022	EUR	30	USD	30	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	USD	8.561	EUR	8.545	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	179
	19/10/2022	EUR	721	USD	722	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15)
	19/10/2022	USD	49.710	EUR	49.773	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	883
	19/10/2022	USD	276	EUR	276	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2022	USD	80	EUR	80	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	EUR	5	USD	5	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	54.722	EUR	55.823	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(39)
	19/10/2022	USD	303	EUR	309	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	88	EUR	89	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	34.398	EUR	35.465	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(391)
	19/10/2022	USD	191	EUR	196	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2022	USD	55	EUR	57	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	EUR	1.899.881	USD	1.907.016	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(43.308)
	19/10/2022	EUR	10.477	USD	10.517	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(239)
	19/10/2022	EUR	3.023	USD	3.035	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(69)
	19/10/2022	USD	64.832	EUR	64.881	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.185
	19/10/2022	USD	358	EUR	358	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/10/2022	USD	103	EUR	103	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
								(41.803) USD
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha								
	19/10/2022	EUR	326	USD	327	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/10/2022	USD	17	EUR	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	3.774	EUR	3.836	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
	19/10/2022	USD	23	EUR	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	5.886	EUR	6.068	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(67)
	19/10/2022	EUR	127.986	USD	128.466	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.917)
	19/10/2022	EUR	165.992	USD	166.615	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.784)
	19/10/2022	USD	3.719	EUR	3.722	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	68
	19/10/2022	USD	4.831	EUR	4.834	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	88
	19/10/2022	USD	3.899	EUR	3.904	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	69
	19/10/2022	USD	5.063	EUR	5.069	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	90
	19/10/2022	USD	120.450	EUR	120.062	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.671
								(3.778) USD
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities								
	19/10/2022	EUR	3.905.093	USD	3.919.756	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(89.017)
	19/10/2022	CHF	2.143.063	USD	2.235.566	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(54.462)

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)								
	19/10/2022	GBP	839.814	USD	970.238	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32.360)
	19/10/2022	EUR	1.827.613	USD	1.834.475	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(41.660)
	19/10/2022	EUR	6.623.603	USD	6.648.474	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(150.985)
	19/10/2022	GBP	51.818.122	USD	59.865.534	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.996.662)
	19/10/2022	SGD	9.382.301	USD	6.677.191	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(137.380)
	19/10/2022	GBP	3.541.560	USD	4.091.569	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(136.464)
	19/10/2022	EUR	280.987	USD	282.042	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.405)
	19/10/2022	CHF	1.142	USD	1.192	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(29)
	19/10/2022	USD	12.123	EUR	12.076	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	277
	19/10/2022	EUR	3.403	USD	3.416	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(78)
	19/10/2022	EUR	9.213	USD	9.249	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(212)
	19/10/2022	GBP	62	USD	72	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2022	USD	739.610	SGD	1.039.182	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15.259
	19/10/2022	USD	86.637	GBP	74.989	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.891
	19/10/2022	EUR	4.115	USD	4.123	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(86)
	19/10/2022	USD	67	GBP	58	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2022	USD	169.554	SGD	238.075	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.607
	19/10/2022	USD	96.807	GBP	83.544	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.506
	19/10/2022	USD	88.343	EUR	88.211	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.809
	19/10/2022	USD	50.525	CHF	48.606	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.055
	19/10/2022	USD	21.908	GBP	19.173	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	497
	19/10/2022	USD	41.643	EUR	41.581	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	853
	19/10/2022	USD	150.198	EUR	149.973	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.076
	19/10/2022	USD	1.350.339	GBP	1.181.719	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30.618
	19/10/2022	USD	131.816	SGD	185.815	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.296
	19/10/2022	USD	88.217	GBP	77.201	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.000
	19/10/2022	USD	6.365	EUR	6.355	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	130
	19/10/2022	USD	27	CHF	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	EUR	1.493	USD	1.495	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(31)
	19/10/2022	EUR	2.209	USD	2.212	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(46)
	19/10/2022	USD	887	GBP	772	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26
	19/10/2022	SGD	3.886	USD	2.759	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(50)
	19/10/2022	USD	1.798	GBP	1.563	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	52
	19/10/2022	EUR	4.990	USD	5.015	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(120)
	19/10/2022	USD	6.666	EUR	6.633	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	159
	19/10/2022	GBP	6.899	USD	7.893	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(188)
	19/10/2022	USD	195	SGD	274	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/10/2022	USD	7.048	GBP	6.160	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	168
	19/10/2022	EUR	12	USD	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	286	GBP	250	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2022	USD	5.572	EUR	5.564	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	113
	19/10/2022	USD	2.070	EUR	2.067	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	42
	19/10/2022	GBP	512	USD	585	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2022	USD	10.979	SGD	15.478	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	190
	19/10/2022	GBP	66.613	USD	76.079	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.688)
	19/10/2022	USD	42.832	EUR	43.540	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	121
	19/10/2022	USD	25.124	CHF	24.188	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	505

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)								
	19/10/2022	USD	10.499	GBP	9.352	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	54
	19/10/2022	USD	20.273	EUR	20.607	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	57
	19/10/2022	USD	72.608	EUR	73.807	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	206
	19/10/2022	USD	645.104	GBP	574.658	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.342
	19/10/2022	USD	60.995	SGD	86.717	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	550
	19/10/2022	USD	42.472	GBP	37.834	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	220
	19/10/2022	USD	3.077	EUR	3.128	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/10/2022	USD	13	CHF	13	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	531	GBP	469	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2022	EUR	2.490	USD	2.464	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21)
	19/10/2022	USD	377	EUR	381	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2022	USD	4.676	SGD	6.619	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	63
	19/10/2022	GBP	200	USD	227	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2022	EUR	5.259	USD	5.170	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2022	EUR	500	USD	492	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2022	USD	381	EUR	388	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	2.884	GBP	2.559	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26
	19/10/2022	USD	129.815	EUR	133.842	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.477)
	19/10/2022	USD	73.521	CHF	72.350	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(112)
	19/10/2022	USD	31.563	GBP	29.357	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.221)
	19/10/2022	USD	61.269	EUR	63.169	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(697)
	19/10/2022	USD	220.400	EUR	227.237	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.507)
	19/10/2022	USD	1.948.690	GBP	1.812.491	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(75.413)
	19/10/2022	USD	191.600	SGD	274.678	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	140
	19/10/2022	USD	129.399	GBP	120.355	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.008)
	19/10/2022	USD	9.350	EUR	9.640	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(106)
	19/10/2022	USD	39	CHF	39	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	38.820	EUR	39.936	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(355)
	19/10/2022	USD	100	GBP	91	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2022	USD	34.744	GBP	31.864	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(840)
	19/10/2022	USD	67.775	EUR	70.167	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.055)
	19/10/2022	USD	39.808	CHF	39.316	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(205)
	19/10/2022	USD	17.004	GBP	15.737	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(570)
	19/10/2022	USD	32.353	EUR	33.495	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(503)
	19/10/2022	USD	116.209	EUR	120.310	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.808)
	19/10/2022	USD	1.049.024	GBP	970.859	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(35.187)
	19/10/2022	USD	101.524	SGD	145.646	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/10/2022	USD	68.994	GBP	63.853	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.314)
	19/10/2022	USD	4.930	EUR	5.104	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(77)
	19/10/2022	USD	21	CHF	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	2.037	EUR	2.108	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(31)
	19/10/2022	USD	4.253	GBP	3.939	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(146)
	19/10/2022	USD	18.890	EUR	19.550	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(287)
	19/10/2022	USD	251.412	EUR	260.192	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.821)
	19/10/2022	USD	3.955	SGD	5.672	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2022	USD	53.307	GBP	49.377	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.835)
	19/10/2022	USD	15.356	SGD	22.073	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(29)

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								
<i>(continuación)</i>	19/10/2022	USD	15.718	GBP	14.582	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(567)
	19/10/2022	USD	62.034	EUR	64.393	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.131)
	19/10/2022	EUR	73.356	USD	70.888	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.072
	19/10/2022	CHF	40.572	USD	41.280	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
	19/10/2022	GBP	16.142	USD	17.409	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	618
	19/10/2022	EUR	34.575	USD	33.412	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	505
	19/10/2022	EUR	120.662	USD	116.602	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.763
	19/10/2022	GBP	1.003.003	USD	1.081.711	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	38.411
	19/10/2022	SGD	154.460	USD	107.053	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	611
	19/10/2022	GBP	64.600	USD	69.669	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.474
	19/10/2022	EUR	4.019	USD	3.884	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	59
	19/10/2022	CHF	22	USD	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	EUR	29.085	USD	28.041	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	490
	19/10/2022	CHF	1.543	USD	1.574	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/10/2022	GBP	100	USD	107	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/10/2022	USD	2.248	EUR	2.332	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(39)
	19/10/2022	EUR	16.797	USD	16.194	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	283
	19/10/2022	GBP	4	USD	5	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2022	USD	8.496	SGD	12.227	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(27)
	19/10/2022	USD	26.208	GBP	24.381	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.020)
	19/10/2022	USD	27.321	EUR	27.946	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(92)
	19/10/2022	USD	828	EUR	847	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2022	USD	269.580	EUR	275.742	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(911)
	19/10/2022	USD	10.005	SGD	14.366	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/10/2022	USD	21.541	GBP	19.515	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(252)
								(2.667.386) USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

A 30 de septiembre 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	(6.004)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Venta	EUR	1.770.000	20/12/2026	196.123	0,04
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	580.000	20/12/2023	(12.832)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	200.000	20/12/2023	(4.425)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Glencore International	Venta	EUR	1.100.000	20/06/2026	110.369	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	17.825.000	20/06/2027	(648.966)	(0,12)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	17.825.000	20/06/2027	648.966	0,12
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	2.250.000	20/06/2027	(26.885)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	37.750.000	20/06/2027	(451.069)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	20.910.000	20/06/2027	249.850	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	1.815.000	20/06/2027	21.687	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	6.185.000	20/06/2027	73.904	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	7.000.000	20/06/2027	83.642	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	11.000.000	20/06/2027	(131.437)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Venta	USD	30.000.000	20/06/2027	3.367	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	19.000.000	20/06/2027	(227.028)	(0,04)
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	4.650.000	20/06/2027	302.663	0,06
CDS	JPMorgan	SSE plc	Compra	EUR	1.400.000	20/06/2027	4.330	0,00
CDS	Barclays	Veolia Environment	Compra	EUR	2.000.000	20/06/2027	(16.442)	(0,00)
CDS	Barclays	Telia Co AB	Compra	EUR	2.500.000	20/06/2027	(45.380)	(0,01)
CDS	Barclays	Swedbank AB	Compra	EUR	2.330.000	20/06/2027	(28.056)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered plc	Compra	EUR	4.740.000	20/06/2027	32.951	0,01
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Compra	EUR	1.200.000	20/06/2027	28.827	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	3.250.000	20/06/2027	(38.834)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Venta	USD	4.000.000	20/06/2027	449	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	11.250.000	20/06/2027	134.425	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	10.000.000	20/06/2027	(119.488)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	34.000.000	20/06/2027	(406.261)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Venta	USD	32.000.000	20/06/2027	3.591	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	32.300.000	20/06/2027	385.948	0,07
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	3.796.190	20/06/2027	(45.360)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	22.956.190	20/06/2027	274.300	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	6.220.000	20/06/2027	(74.322)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Venta	USD	15.970.000	20/06/2027	1.792	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	2.700.000	20/06/2027	(32.262)	(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 USD	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Venta	USD	13.860.000	20/06/2027	1.556	0,00
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Compra	USD	11.200.000	20/06/2027	(1.257)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	5.120.000	20/06/2027	61.178	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	13.530.000	20/06/2027	161.668	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	8.900.000	20/06/2027	106.345	0,02
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Compra	USD	26.190.000	20/06/2027	(2.939)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	22.956.190	20/12/2027	(362.971)	(0,07)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	16.200.000	20/12/2027	849.660	0,16
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Venta	USD	49.850.000	20/12/2027	(179.220)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Compra	USD	58.440.000	20/06/2027	(6.559)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	5.750.000	20/12/2027	90.916	0,02
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Compra	USD	20.000.000	20/12/2027	71.904	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	10.000.000	20/12/2027	158.114	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	7.206.190	20/12/2027	113.940	0,02
							1.304.468 USD	0,26

A 30 de septiembre 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	JPMorgan	Glencore International	Venta	EUR	400.000	20/06/2026	40.968	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	466.000	20/06/2027	(5.684)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	934.000	20/06/2027	(11.392)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	398.000	20/06/2027	(4.854)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	398.000	20/06/2027	(4.854)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	633.000	20/06/2027	(7.721)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	4.201.000	20/12/2027	67.804	0,07
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	2.680.000	20/12/2027	143.481	0,15
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	4.201.000	20/06/2027	(51.240)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	2.950.000	20/06/2027	(109.634)	(0,12)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	820.000	20/12/2027	13.235	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	14.930.000	20/06/2027	182.102	0,19
CDS	JPMorgan	Commerzbank	Venta	EUR	600.000	20/06/2027	(7.885)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Airbus SE	Venta	EUR	600.000	20/06/2027	(15.271)	(0,02)

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 37	Compra	EUR	2.950.000	20/06/2027	109.634	0,12
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	2.900.000	20/06/2027	(35.371)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	1.700.000	20/06/2027	(20.735)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	850.000	20/06/2027	(10.368)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	2.450.000	20/06/2027	(29.883)	(0,03)
							242.331 EUR	0,23

A 30 de septiembre 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	(7.340)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Venta	EUR	900.000	20/06/2025	(4.243)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Glencore International	Venta	EUR	600.000	20/06/2026	61.452	0,04
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Compra	USD	800.000	20/06/2023	(23.188)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	1.000.000	20/06/2027	(37.164)	(0,02)
CDS	Barclays	Mercedes-Benz Group	Compra	EUR	537.500	20/06/2027	9.291	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	25.900.000	20/06/2027	962.545	0,64
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 37	Compra	EUR	4.340.000	20/06/2027	283.177	0,19
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	1.000.000	20/06/2027	(37.164)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	Coöperatieve Rabobank U.A.	Compra	EUR	730.000	20/06/2027	27.333	0,02
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	1.700.000	20/06/2027	112.949	0,08
CDS	JPMorgan	SSE plc	Compra	EUR	1.870.000	20/06/2027	5.904	0,00
CDS	Barclays	Veolia Environment	Compra	EUR	1.750.000	20/06/2027	(14.685)	(0,01)
CDS	Barclays	Telia Co AB	Compra	EUR	1.700.000	20/06/2027	(31.499)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	1.500.000	20/06/2027	(55.746)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	3.930.000	20/06/2027	(47.934)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	1.000.000	20/06/2027	(12.197)	(0,01)
CDS	Barclays	Swedbank AB	Compra	EUR	2.160.000	20/06/2027	(26.549)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered plc	Compra	EUR	2.190.000	20/06/2027	15.541	0,01
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Compra	EUR	800.000	20/06/2027	19.617	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	900.000	20/06/2027	(33.448)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	500.000	20/06/2027	(18.582)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	26.200.000	20/06/2027	(973.694)	(0,65)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	5.200.000	20/06/2027	193.252	0,13
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	3.400.000	20/06/2027	(41.470)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	32.524.466	20/06/2027	396.703	0,26

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 37	Venta	EUR	1.700.000	20/06/2027	(20.735)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	20.500.000	20/06/2027	(250.040)	(0,17)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	1.994.466	20/06/2027	(24.327)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	32.524.466	20/12/2027	(524.941)	(0,35)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	26.200.000	20/12/2027	1.402.687	0,94
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	1.120.000	20/12/2027	18.077	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 37	Venta	EUR	4.340.000	20/06/2027	(283.177)	(0,19)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 38	Compra	EUR	3.700.000	20/12/2027	285.837	0,19
							1.326.242 EUR	0,89

A 30 de septiembre 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	20/06/2027	(131.067)	(0,38)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Venta	USD	3.340.000	20/06/2027	375	0,00
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Compra	USD	3.340.000	20/06/2027	(375)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	800.000	20/06/2027	29.126	0,09
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	350.000	20/06/2027	12.743	0,04
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	2.080.000	20/06/2027	75.728	0,22
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	370.000	20/06/2027	13.471	0,04
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Venta	USD	3.340.000	20/12/2027	(12.008)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	2.080.000	20/12/2027	(109.093)	(0,32)
							(121.100) USD	(0,35)

A 30 de septiembre 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	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Venta	USD	300.000	20/12/2027	(1.079)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Compra	USD	350.000	20/06/2027	(39)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	100.000	20/12/2023	(5.238)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	870.000	20/12/2026	(6.781)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	870.000	20/12/2026	6.781	0,01
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Venta	EUR	40.000	20/12/2026	4.432	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	880.000	20/06/2027	10.515	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	770.000	20/06/2027	(9.201)	(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 USD	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	110.000	20/06/2027	(1.314)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	1.600.000	20/06/2027	(19.118)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	510.000	20/06/2027	6.094	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	250.000	20/06/2027	(2.987)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	500.000	20/06/2027	5.974	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	400.000	20/06/2027	4.780	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	170.000	20/06/2027	(2.031)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	170.000	20/06/2027	(2.031)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	330.000	20/06/2027	(3.943)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	400.000	20/06/2027	4.780	0,00
CDS	JPMorgan	SSE plc	Compra	EUR	70.000	20/06/2027	217	0,00
CDS	Barclays	Veolia Environment	Compra	EUR	70.000	20/06/2027	(575)	(0,00)
CDS	Barclays	Telia Co AB	Compra	EUR	90.000	20/06/2027	(1.634)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered plc	Compra	EUR	130.000	20/06/2027	904	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	255.000	20/06/2027	(9.284)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	255.000	20/06/2027	9.284	0,01
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Venta	USD	500.000	20/06/2027	56	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	370.000	20/06/2027	4.421	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	200.000	20/06/2027	2.390	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	130.000	20/06/2027	1.553	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	270.000	20/06/2027	3.226	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	160.000	20/06/2027	(1.912)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	500.000	20/06/2027	(5.974)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Compra	USD	150.000	20/06/2027	(17)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	640.000	20/12/2027	(10.119)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	230.000	20/12/2027	12.061	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	400.000	20/06/2027	4.780	0,00
							(1.029) USD	(0,02)

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

A 30 de septiembre 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 13 acciones y recibe US-1M- LIBOR.	USD	3.522.853	20/04/2023	232.992	0,57
SRT	UBS	North America Equity Basket	Paga US-1M-LIBOR +0,30% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 11 acciones. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 37 acciones y recibe US-1M- LIBOR.	USD	13.229.184	26/06/2023	826.303	2,00
							1.059.295 USD	2,57

A 30 de septiembre 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	JPMorgan	General Motors Company	Compra	USD	21.150.000	20/12/2022	(191.618)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	Arcelormittal	Compra	EUR	7.500.000	20/12/2023	(337.025)	(0,05)
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Venta	EUR	4.000.000	20/12/2026	452.423	0,07
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Venta	EUR	3.950.000	20/06/2025	(18.623)	(0,00)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Compra	USD	600.000	20/12/2022	(5.436)	(0,00)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Compra	USD	1.200.000	20/12/2022	(10.872)	(0,00)
CDS	Barclays	Mercedes-Benz Group	Compra	EUR	19.355.000	20/06/2027	334.578	0,05
CDS	JPMorgan	Societe Generale SA	Compra	EUR	19.000.000	20/12/2026	263.273	0,04
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	196.750.000	20/06/2027	7.311.998	1,18
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	24.500.000	20/06/2027	(910.516)	(0,15)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	25.000.000	20/06/2027	929.098	0,15
CDS	BNP Paribas	British Telecommunications plc	Compra	EUR	15.000.000	20/06/2027	339.615	0,05
CDS	BNP Paribas	Monitchem Holdco 3 S.A.	Compra	EUR	10.000.000	20/06/2027	(81.338)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Compra	USD	277.070.000	20/06/2027	(31.742)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Venta	USD	103.470.000	20/06/2027	11.854	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 37	Compra	EUR	22.180.000	20/06/2027	375.535	0,06
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 37	Compra	EUR	25.090.000	20/06/2027	1.637.077	0,26
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	34.680.000	20/06/2027	(422.994)	(0,07)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	3.660.000	20/06/2027	(44.641)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	3.660.000	20/06/2027	(44.641)	(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	TRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	4.460.000	20/06/2027	(54.399)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	4.460.000	20/06/2027	(54.399)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	6.400.000	20/06/2027	(78.061)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Venta	USD	92.430.000	20/06/2027	10.589	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 37	Venta	EUR	3.300.000	20/06/2027	(215.319)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 37	Venta	EUR	657.000	20/06/2027	(42.868)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 37	Venta	EUR	1.209.000	20/06/2027	(78.885)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 37	Venta	EUR	1.234.000	20/06/2027	(80.516)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	14.300.000	20/06/2027	(531.444)	(0,09)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	3.900.000	20/06/2027	(47.568)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	HSBC Holdings	Compra	EUR	22.210.000	20/06/2027	776.041	0,12
CDS	Goldman Sachs	Coöperatieve Rabobank U.A.	Compra	EUR	18.800.000	20/06/2027	703.913	0,11
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	12.700.000	20/06/2027	843.798	0,14
CDS	Goldman Sachs	ING Groep NV	Compra	EUR	7.500.000	20/06/2027	312.378	0,05
CDS	Goldman Sachs	TRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	200.000.000	21/12/2022	(3.929.205)	(0,63)
CDS	Goldman Sachs	TRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	200.000.000	21/12/2022	10.744.112	1,73
CDS	JPMorgan	Barclays plc	Compra	EUR	5.690.000	20/06/2027	418.843	0,07
CDS	Barclays	Veolia Environment	Compra	EUR	16.100.000	20/06/2027	(135.104)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings	Compra	EUR	4.115.000	20/06/2027	22.173	0,00
CDS	JPMorgan	Barclays plc	Compra	EUR	9.830.000	20/06/2027	211.315	0,03
CDS	Barclays	Telia Co AB	Compra	EUR	15.800.000	20/06/2027	(292.760)	(0,05)
CDS	Barclays	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	6.720.000	20/06/2027	90.802	0,01
CDS	JPMorgan	Commerzbank	Venta	EUR	8.400.000	20/06/2027	(110.386)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	Faurecia Se	Venta	EUR	3.200.000	20/06/2027	(103.680)	(0,02)
CDS	Barclays	Swedbank AB	Compra	EUR	18.560.000	20/06/2027	(228.127)	(0,04)
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered plc	Compra	EUR	13.500.000	20/06/2027	95.798	0,02
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Compra	EUR	9.700.000	20/06/2027	237.856	0,04
CDS	Citigroup Global Markets	Westpac banking Corp.	Compra	USD	17.000.000	20/06/2027	(168.582)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Casino Guichard Perrachon SA	Venta	EUR	2.110.000	20/06/2027	(1.028.268)	(0,17)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	16.600.000	20/06/2027	(616.921)	(0,10)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	1.700.000	20/06/2027	(63.179)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	1.700.000	20/06/2027	(63.179)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	156.950.000	20/06/2027	(5.832.875)	(0,94)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	6.000.000	20/06/2027	(222.983)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	100.820.000	20/06/2027	1.229.707	0,20

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 37	Venta	EUR	39.600.000	20/06/2027	(483.003)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Compra	USD	51.400.000	20/06/2027	(5.889)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Compra	USD	15.400.000	20/06/2027	(1.764)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	88.370.000	20/12/2027	(1.426.283)	(0,23)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	29.000.000	20/12/2027	(468.057)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	122.080.000	20/12/2027	6.535.878	1,05
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Venta	USD	147.970.000	20/06/2027	16.952	0,00
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Compra	USD	126.220.000	20/12/2027	463.210	0,07
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 38	Compra	EUR	17.840.000	20/12/2027	394.871	0,06
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 37	Venta	EUR	22.180.000	20/06/2027	(375.535)	(0,06)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Compra	EUR	16.700.000	20/12/2027	601.904	0,10
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	24.200.000	20/12/2027	(390.585)	(0,06)
CDS	Goldman Sachs	Bayerische Motoren Werke AG	Compra	EUR	10.860.000	20/12/2027	186.653	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 37	Venta	EUR	18.690.000	20/06/2027	(1.219.489)	(0,20)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 38	Compra	EUR	15.920.000	20/12/2027	1.229.878	0,20
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	54.800.000	20/12/2027	(884.466)	(0,14)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	5.000.000	20/12/2027	80.700	0,01
							15.529.597 EUR	2,44

A 30 de septiembre 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	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Compra	EUR	60.000	20/06/2023	(219)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Pearson PLC	Compra	EUR	40.000	20/06/2023	(217)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banca Popolare Di Milano	Compra	EUR	30.000	20/06/2023	(406)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues	Compra	EUR	30.000	20/06/2023	(532)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Compra	EUR	80.000	20/06/2023	(292)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Venta	EUR	350.000	20/06/2025	(1.650)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Tescp plc	Compra	EUR	60.000	20/06/2023	(219)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues	Compra	EUR	30.000	20/06/2023	(532)	(0,00)
CDS	JPMorgan	United Utilities Group	Compra	EUR	80.000	20/12/2023	(733)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	30.000	20/06/2023	(406)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	145.000	20/12/2023	(3.275)	(0,01)
CDS	Barclays	Tesco plc	Compra	EUR	100.000	20/12/2023	(457)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Compra	EUR	260.000	20/12/2023	(1.188)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	250.000	20/12/2023	(5.646)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Venta	EUR	190.000	20/12/2026	21.490	0,07
CDS	Barclays	Mercedes-Benz Group	Compra	EUR	1.077.500	20/06/2027	18.626	0,06

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	JPMorgan	Societe Generale SA	Compra	EUR	1.000.000	20/12/2026	13.856	0,04
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	2.910.000	20/06/2027	(108.147)	(0,34)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	2.910.000	20/06/2027	108.147	0,34
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Compra	USD	13.670.000	20/06/2027	(1.566)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 37	Compra	EUR	1.250.000	20/06/2027	21.164	0,07
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 38	Compra	EUR	3.810.000	20/06/2027	248.596	0,79
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Venta	USD	2.780.000	20/06/2027	318	0,00
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Venta	USD	4.280.000	20/06/2027	490	0,00
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Venta	USD	2.000.000	20/06/2027	229	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 37	Venta	EUR	530.000	20/06/2027	(34.582)	(0,11)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 37	Compra	EUR	500.000	20/06/2027	32.624	0,10
CDS	Citigroup Global Markets	HSBC Holdings	Compra	EUR	1.450.000	20/06/2027	50.665	0,16
CDS	Goldman Sachs	Coöperatieve Rabobank U.A.	Compra	EUR	1.210.000	20/06/2027	45.305	0,14
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	1.700.000	20/06/2027	112.949	0,36
CDS	Goldman Sachs	ING Groep NV	Compra	EUR	640.000	20/06/2027	26.656	0,08
CDS	JPMorgan	Barclays plc	Compra	EUR	590.000	20/06/2027	43.430	0,14
CDS	JPMorgan	SSE plc	Compra	EUR	960.000	20/06/2027	3.031	0,01
CDS	Barclays	Veolia Environment	Compra	EUR	830.000	20/06/2027	(6.965)	(0,02)
CDS	Barclays	Natural Energy Group SA	Compra	EUR	800.000	20/06/2027	6.534	0,02
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings	Compra	EUR	735.000	20/06/2027	3.960	0,01
CDS	JPMorgan	Barclays plc	Compra	EUR	350.000	20/06/2027	7.524	0,02
CDS	Barclays	Telia Co AB	Compra	EUR	900.000	20/06/2027	(16.676)	(0,05)
CDS	Barclays	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	700.000	20/06/2027	9.459	0,03
CDS	JPMorgan	Commerzbank	Venta	EUR	500.000	20/06/2027	(6.571)	(0,02)
CDS	Barclays	Swedbank AB	Compra	EUR	850.000	20/06/2027	(10.448)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered plc	Compra	EUR	1.300.000	20/06/2027	9.225	0,03
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Compra	EUR	650.000	20/06/2027	15.939	0,05
CDS	Citigroup Global Markets	Westpac banking Corp.	Compra	USD	1.570.000	20/06/2027	(15.569)	(0,05)
CDS	Barclays	TRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	40.000.000	21/12/2022	(366.529)	(1,16)
CDS	Barclays	TRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	40.000.000	21/12/2022	682.589	2,17
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Compra	USD	6.700.000	20/06/2027	(768)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Compra	EUR	750.000	20/06/2027	9.148	0,03
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	750.000	20/06/2027	(9.148)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	750.000	20/12/2027	(12.105)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	2.640.000	20/12/2027	141.339	0,45
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Compra	USD	9.650.000	20/12/2027	35.414	0,11
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Venta	USD	11.310.000	20/06/2027	1.296	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 38	Compra	EUR	1.010.000	20/12/2027	22.355	0,07
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 37	Venta	EUR	1.250.000	20/06/2027	(21.164)	(0,07)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	410.000	20/12/2027	6.617	0,02
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Compra	EUR	450.000	20/12/2027	16.219	0,05

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	Goldman Sachs	Bayerische Motoren Werke AG	Compra	EUR	600.000	20/12/2027	10.312	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSUB 37	Venta	EUR	3.780.000	20/06/2027	(246.638)	(0,78)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSUB 38	Compra	EUR	3.220.000	20/12/2027	248.757	0,79
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	2.700.000	20/12/2027	(43.577)	(0,14)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	1.600.000	20/12/2027	(25.822)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	500.000	20/12/2027	8.072	0,03
							1.040.288 EUR	3,31

A 30 de septiembre 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	4.452.141	del 04/05/2027 al 24/10/2029	40.519	0,04
SRT	Goldman Sachs	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la acción subyacente y recibe 1M SONIA -0,35%.	GBP	778.860	18/05/2029	51.371	0,05
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones y recibe LIBOR CHF.	CHF	402.176	07/02/2024	6.517	0,01
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 3 acciones y recibe 1M DKDRA.	DKK	5.081.127	07/02/2024	25.973	0,03
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 20 acciones y recibe 1M EONIA.	EUR	23.226.059	07/02/2024	542.891	0,58
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la acción subyacente y recibe 1M NIBOR.	NOK	9.088.289	07/02/2024	31.189	0,03
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 6 acciones y recibe 1M STIBOR.	SEK	83.988.947	07/02/2024	(1.276)	(0,00)
							697.184 EUR	0,74

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

A 30 de septiembre 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 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 US-1M-LIBOR +0,30% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 4 acciones. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 13 acciones y recibe US-1M-LIBOR.	USD	18.127.459	20/04/2023	(279.143)	(0,34)
SRT	UBS	North America Equity Basket	Paga US-1M-LIBOR +0,30% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 11 acciones. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 37 acciones y recibe US-1M-LIBOR.	USD	25.024.457	26/06/2023	1.249.632	1,50
							970.489 USD	1,16

A 30 de septiembre 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 nacional	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 acción subyacente y recibe AUD 1M LIBOR +0,40%.	AUD	1.210.911	10/01/2025	46.870	0,06
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga 1M CDOR01 +0,35% y recibe el rendimiento de la acción subyacente.	CAD	1.067.913	03/06/2024	(26.333)	(0,04)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga 1M CIBOR +0,35% y recibe el rendimiento de la acción subyacente.	CHF	1.502.109	01/12/2022	(79.954)	(0,11)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga DKDRA +0,30% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones.	DKK	2.819.787	10/01/2025	(15.481)	(0,02)
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 cesta subyacente de 2 acciones y recibe 1M-EONIA.	EUR	2.341.868	10/01/2025	138.797	0,19

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 el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones y recibe GBP 1M-LIBOR.	GBP	1.260.443	10/01/2025	(30.794)	(0,04)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la acción subyacente y recibe NOK 1M LIBOR.	NOK	12.403.131	10/03/2025	55.641	0,07
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga y recibe el rendimiento de la acción subyacente.	SEK	6.021.762	10/01/2025	(162.264)	(0,22)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga US 1M LIBOR +0,35% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 26 acciones. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 17 acciones y recibe US 1M LIBOR.	USD	41.764.084	10/01/2025	(1.299.995)	(1,75)
							(1.373.513) USD	(1,86)

A 30 de septiembre 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	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
SRT	Credit Suisse	North America Commodities Basket	Paga el 0,25% y recibe el rendimiento de BCOMF3 Index.	USD	43.901.087	03/10/2022	(2.247.483)	(0,65)
SRT	Goldman Sachs	North America Commodities Basket	Paga el 0,11% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 3 índices. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 5 índices y recibe el 0,11%.	USD	203.654.350	03/10/2022	(6.740.305)	(1,94)
SRT	JPMorgan	North America Commodities Basket	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 24 índices y recibe entre el 0% y el 0,28%. Paga del 0% al 0,28% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 30 índices.	USD	1.082.352.921	03/10/2022	(4.273.392)	(1,23)
SRT	Macquarie	North America Commodities Basket	Paga el 0,17% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 2 índices. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 4 índices y recibe el 0,17%.	USD	136.853.118	03/10/2022	(5.707.452)	(1,64)
							(18.968.632) USD	(5,46)

Notas a los estados financieros

(continuación)

11 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE FUTUROS

A 30 de septiembre de 2022, la contraparte de los contratos de futuros pendientes es UBS.

A 30 de septiembre 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
10-Year US Treasury Note	Compras	1	USD	96.328	20/12/2022	(5.625)	(0,00)
5-Year US Treasury Note	Compras	162	USD	15.214.078	30/12/2022	(576.563)	(0,11)
2-Year US Treasury Note	Compras	21	USD	4.209.844	30/12/2022	(63.820)	(0,01)
10-Year MSE Canada Treasury Bond Future	Compras	61	CAD	5.486.726	19/12/2022	(51.449)	(0,01)
10-Year US Ultra Treasury Note Future	Ventas	(124)	USD	(14.692.063)	20/12/2022	917.922	0,17
US Treasury Bond Future	Compras	32	USD	3.453.500	20/12/2022	(343.250)	(0,06)
Euro-BOBL Future	Ventas	(52)	EUR	(4.968.965)	08/12/2022	24.530	0,00
Euro-BUND Future	Ventas	(285)	EUR	(23.659.988)	08/12/2022	1.625.513	0,30
Euro-BUXL 30 Year Future	Ventas	(21)	EUR	(3.016.773)	08/12/2022	281.845	0,05
Euro-OAT Future	Ventas	(25)	EUR	(3.235.784)	08/12/2022	155.275	0,03
10-Year Japan Treasury Bond Future	Ventas	(4)	JPY	(2.744.541)	13/12/2022	6.080	0,00
Long GILT Future	Ventas	(65)	GBP	(6.994.736)	28/12/2022	844.559	0,16
10-Year Australian Treasury Bond Future	Compras	10	AUD	753.000	15/12/2022	(17.799)	(0,00)
						2.797.218 USD	0,52

A 30 de septiembre 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	Ventas	(10)	USD	(983.289)	20/12/2022	43.638	0,05
5-Year US Treasury Note	Ventas	(12)	USD	(1.150.376)	30/12/2022	45.456	0,05
10-Year US Ultra Treasury Note Future	Ventas	(11)	USD	(1.330.398)	20/12/2022	87.195	0,09
US Treasury Bond Future	Ventas	(4)	USD	(440.654)	20/12/2022	57.817	0,06
Euro-BOBL Future	Compras	45	EUR	4.389.390	08/12/2022	128.648	0,14
Euro-BUND Future	Ventas	(31)	EUR	(2.627.002)	08/12/2022	206.473	0,22
Euro-BUXL 30 Year Future	Ventas	(9)	EUR	(1.319.760)	08/12/2022	(141.300)	(0,15)
						427.927 EUR	0,46

Notas a los estados financieros

(continuación)

11 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE FUTUROS

(continuación)

A 30 de septiembre de 2022, Threadneedle (Lux) - European High Yield 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	Ventas	(23)	USD	(2.261.564)	20/12/2022	135.364	0,04
						135.364 EUR	0,04

A 30 de septiembre 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
10-Year US Treasury Note	Ventas	(36)	USD	(3.539.839)	20/12/2022	208.143	0,06
5-Year US Treasury Note	Ventas	(16)	USD	(1.533.835)	30/12/2022	60.608	0,02
2-Year US Treasury Note	Ventas	(4)	USD	(818.530)	30/12/2022	12.313	0,00
Euro-BOBL Future	Ventas	(13)	EUR	(1.268.046)	08/12/2022	(9.490)	(0,00)
Euro-BTP Future	Ventas	(4)	EUR	(447.920)	08/12/2022	20.760	0,01
Short Euro-BTP Future	Ventas	(1)	EUR	(1.152.404)	08/12/2022	1.270	0,00
Long GILT Future	Ventas	(107)	GBP	(11.753.611)	28/12/2022	1.650.868	0,47
						1.944.472 EUR	0,56

A 30 de septiembre 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
10-Year US Treasury Note	Compras	128	USD	12.586.094	20/12/2022	(734.956)	(0,49)
5-Year US Treasury Note	Compras	91	USD	8.723.684	30/12/2022	(333.753)	(0,22)
Long GILT Future	Ventas	(42)	GBP	(4.613.567)	28/12/2022	(28.268)	(0,02)
10-Year US Ultra Treasury Note Future	Compras	153	USD	18.504.630	20/12/2022	(320.909)	(0,21)
US Treasury Bond Future	Compras	24	USD	2.643.922	20/12/2022	11.484	0,01
Euro-BOBL Future	Ventas	(470)	EUR	(45.844.740)	08/12/2022	1.456.360	0,97
Euro-BUND Future	Ventas	(117)	EUR	(9.914.814)	08/12/2022	751.925	0,50
Euro-BUXL 30 Year Future	Ventas	(16)	EUR	(2.346.240)	08/12/2022	212.160	0,14
Euro-SCHATZ Future	Ventas	(5)	EUR	(488.435)	08/12/2022	4.900	0,00
10-Year Japan Treasury Bond Future	Ventas	(10)	JPY	(7.000.368)	13/12/2022	15.514	0,01
						1.034.457 EUR	0,69

Notas a los estados financieros

(continuación)

11 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE FUTUROS

(continuación)

A 30 de septiembre de 2022, Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds 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	Ventas	(43)	USD	(4.142.109)	20/12/2022	231.125	0,68
						231.125 USD	0,68

A 30 de septiembre de 2022, Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt 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 Ultra Treasury Note Future	Ventas	(6)	USD	(710.906)	20/12/2022	44.391	0,16
						44.391 USD	0,16

A 30 de septiembre de 2022, Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds 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
5-Year US Treasury Note	Compras	87	USD	8.170.523	30/12/2022	(313.336)	(0,49)
10-Year US Treasury Note	Ventas	(58)	USD	(5.587.031)	20/12/2022	311.750	0,49
						(1.586) USD	(0,00)

A 30 de septiembre de 2022, Threadneedle (Lux) - Flexible Asian 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	Ventas	(20)	USD	(1.926.563)	20/12/2022	107.500	0,27
						107.500 USD	0,27

A 30 de septiembre 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
TOPIX Index	Compras	6	JPY	776.628	08/12/2022	(32.158)	(0,10)
KOSPI 200 Index	Compras	7	KRW	350.944	08/12/2022	(39.705)	(0,12)
S&P 500 Future	Compras	12	USD	2.205.782	16/12/2022	(323.595)	(0,99)

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
FTSE 100 Index	Compras	21	GBP	1.654.591	16/12/2022	(124.856)	(0,38)
SGX MSCI Taiwan Index Future	Compras	5	USD	260.960	28/10/2022	(10.164)	(0,03)
						(530.478) EUR	(1,62)

A 30 de septiembre 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/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
TOPIX Index	Compras	22	JPY	2.791.087	08/12/2022	(115.513)	(0,34)
S&P 500 Future	Ventas	(58)	USD	(10.444.350)	16/12/2022	1.532.215	4,49
SGX MSCI Taiwan Index Future	Compras	2	USD	102.260	28/10/2022	(3.983)	(0,01)
KOSPI 200 Index	Compras	2	KRW	98.858	08/12/2022	(11.113)	(0,03)
FTSE 100 Index	Compras	16	GBP	1.234.985	16/12/2022	(93.192)	(0,27)
Euro Stoxx Future	Ventas	(90)	EUR	(2.922.786)	16/12/2022	257.010	0,75
						1.565.424 USD	4,59

A 30 de septiembre 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
10-Year US Treasury Note	Compras	5	USD	481.641	20/12/2022	(28.125)	(0,03)
5-Year US Treasury Note	Compras	9	USD	845.227	30/12/2022	(32.766)	(0,03)
Long GILT Future	Ventas	(3)	GBP	(322.834)	28/12/2022	45.344	0,04
2-Year US Treasury Note	Compras	2	USD	400.938	30/12/2022	(6.078)	(0,01)
Euro-BUND Future	Ventas	(4)	EUR	(382.228)	08/12/2022	11.364	0,01
Euro-BOBL Future	Ventas	(5)	EUR	(415.088)	08/12/2022	33.014	0,03
Euro-OAT Future	Ventas	(1)	EUR	(129.431)	08/12/2022	6.211	0,01
S&P 500 Future	Compras	25	USD	4.501.875	16/12/2022	(326.995)	(0,32)
10-Year MSE Canada Treasury Bond Future	Compras	2	CAD	179.893	19/12/2022	(1.704)	(0,00)
10-Year US Ultra Treasury Note Future	Ventas	(1)	USD	(118.484)	20/12/2022	7.765	0,01
US Treasury Bond Future	Ventas	(1)	USD	(107.922)	20/12/2022	10.688	0,01
						(281.282) USD	(0,28)

Notas a los estados financieros

(continuación)

11 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE FUTUROS

(continuación)

A 30 de septiembre de 2022, Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha 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
S&P 500 Future	Ventas	(105)	USD	(18.907.875)	16/12/2022	2.090.428	5,07
						2.090.428 USD	5,07

A 30 de septiembre 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
10-Year US Treasury Note	Ventas	(134)	USD	(13.176.067)	20/12/2022	774.751	0,12
5-Year US Treasury Note	Compras	235	USD	22.528.195	30/12/2022	(832.201)	(0,13)
Long GILT Future	Ventas	(359)	GBP	(39.435.014)	28/12/2022	5.538.895	0,89
US Ultra Treasury Bond Future	Ventas	(19)	USD	(2.657.064)	20/12/2022	202.145	0,03
10-Year US Ultra Treasury Note Future	Ventas	(139)	USD	(16.811.396)	20/12/2022	1.101.822	0,18
US Treasury Bond Future	Ventas	(42)	USD	(4.626.863)	20/12/2022	458.199	0,07
Euro-BOBL Future	Ventas	(1.064)	EUR	(103.784.688)	08/12/2022	3.326.040	0,53
Euro-BUXL 30 Year Future	Ventas	(54)	EUR	(7.918.560)	08/12/2022	822.654	0,13
Euro-OAT Future	Ventas	(185)	EUR	(24.442.200)	08/12/2022	1.174.296	0,19
Euro-BUND Future	Ventas	(333)	EUR	(28.219.086)	08/12/2022	2.079.918	0,33
						14.646.519 EUR	2,34

A 30 de septiembre 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
10-Year US Treasury Note	Ventas	(1)	USD	(98.329)	20/12/2022	4.418	0,01
5-Year US Treasury Note	Compras	4	USD	383.459	30/12/2022	(14.865)	(0,05)
Long GILT Future	Ventas	(19)	GBP	(2.087.090)	28/12/2022	293.145	0,93
US Treasury Bond Future	Ventas	(3)	USD	(419.536)	20/12/2022	33.781	0,11
10-Year US Ultra Treasury Note Future	Ventas	(17)	USD	(2.056.070)	20/12/2022	134.755	0,43
Euro-BOBL Future	Ventas	(40)	EUR	(3.901.680)	08/12/2022	121.360	0,39
Euro-BUND Future	Ventas	(32)	EUR	(2.711.744)	08/12/2022	201.422	0,64
Euro-BUXL 30 Year Future	Ventas	(4)	EUR	(586.560)	08/12/2022	57.869	0,18
Euro-OAT Future	Ventas	(7)	EUR	(924.840)	08/12/2022	44.380	0,14

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
Euro-SCHATZ Future	Ventas	(2)	EUR	(195.374)	08/12/2022	2.050	0,01
						878.315 EUR	2,79

12 OPCIONES AL VALOR DE MERCADO

A 30 de septiembre 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	3.920,000	USD	(52)	14/10/2022	1.283.568*	(16.120)	(0,02)
Call DJ Euro Stoxx 50	UBS	3.550,000	EUR	(60)	21/10/2022	201.345*	(6.642)	(0,01)
Call FTSE 100 Index	UBS	7.400,000	GBP	(33)	21/10/2022	169.366*	(3.500)	(0,00)
						(26.262) USD	(0,03)	

* 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 30 de septiembre de 2022, la SICAV no tenía una agrupación de activos. Sin embargo, la cartera Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return Portfolio 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.

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 Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity* Portfolio, 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 discrecional de la dilución si, en su opinión, dicha acción redundaría en el interés de

Notas a los estados financieros

(continuación)

15 AJUSTE DE DILUCIÓN

(continuación)

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 Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio.

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 julio de 2022.

A 30 de septiembre de 2022, no se ha aplicado ningún Ajuste de dilución.

* Consulte la nota 22.

16 COSTES OPERATIVOS

Para el periodo 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 ¹	EUR	n/d
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 ¹	EUR	n/d
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	USD	10.560
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	USD	24.126
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	USD	3.558
Threadneedle (Lux) - Global Focus	USD	1.018.638
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	USD	429.465
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	USD	60.602
Threadneedle (Lux) - Global Select	USD	213.493
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	EUR	430.727
Threadneedle (Lux) - American	USD	118.137
Threadneedle (Lux) - American Select	USD	37.944
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	USD	92.351
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	USD	106.056
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	USD	155.802
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	USD	56.581
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	USD	8.992
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	EUR	654.383
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	EUR	77.712
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	EUR	90.239
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	EUR	180.504
Threadneedle (Lux) - European Select	EUR	378.442
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	EUR	138.059
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	USD	34.442
Threadneedle (Lux) - Global Technology	USD	67.601
Threadneedle (Lux) - UK Equities	GBP	219.729
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	GBP	128.580
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity ²	USD	n/d
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	USD	9.895
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities ¹	EUR	n/d
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities ¹	EUR	n/d
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	EUR	176.177
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	USD	24.475
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	USD	36.443
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities ¹	USD	n/d

Notas a los estados financieros

(continuación)

16 COSTES OPERATIVOS

(continuación)

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 periodo 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 22.

17 INFORMACIÓN SOBRE GARANTÍAS

La siguiente tabla muestra los saldos de garantía en efectivo recibidos y pagados por las Carteras a 30 de septiembre de 2022:

Carteras	Contraparte	Tipo de inversión	Divisa	Garantía en efectivo
Garantía recibida por la Cartera				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Barclays	Contratos a plazo y swaps	USD	6.940.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	USD	3.160.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Citigroup Global Markets	Contratos a plazo y swaps	USD	350.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Goldman Sachs	Contratos a plazo y swaps	USD	280.000
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	EUR	50.000
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	Lloyds	Contratos a plazo	EUR	880.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	JPM Securities	Contratos a plazo	EUR	390.000
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	HSBC	Contratos a plazo	EUR	250.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Citigroup Global Markets	Contratos a plazo y swaps	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	EUR	10.000
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	Barclays	Contratos a plazo	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Lloyds	Contratos a plazo	USD	1.170.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	USD	20.000
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	70.000
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	150.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	130.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	810.000
Threadneedle (Lux) - European Select	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	160.000
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	90.000
Threadneedle (Lux) - UK Equities	JPM Chase	Contratos a plazo	GBP	490.000
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	JPM Chase	Contratos a plazo	GBP	1.630.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	UBS	Swaps y futuros	USD	410.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Bank of America Merrill Lynch	Swaps	USD	110.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Goldman Sachs	Contratos a plazo y swaps	EUR	9.000.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Citigroup Global Markets	Contratos a plazo y swaps	EUR	1.760.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	BNP Paribas	Swaps	EUR	250.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	EUR	190.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Lloyds	Contratos a plazo	EUR	100.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Barclays	Contratos a plazo y swaps	EUR	250.000
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	Goldman Sachs	Swaps	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	UBS	Swaps	EUR	3.600.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Goldman Sachs	Swaps	EUR	890.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	UBS	Swaps	USD	620.000
Garantía pagada por la Cartera				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	UBS	Futuros	USD	179.880
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPM Chase	Contratos a plazo y swaps	USD	22.400.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	Barclays	Contratos a plazo	EUR	10.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	1.110.000
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	1.010.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	HSBC	Contratos a plazo	EUR	10.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Lloyds	Contratos a plazo	EUR	380.000

Notas a los estados financieros

(continuación)

17 INFORMACIÓN SOBRE GARANTÍAS

(continuación)

Carteras	Contraparte	Tipo de inversión	Divisa	Garantía en efectivo
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	680.000
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	720.000
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	1.630.000
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	410.000
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	Lloyds	Contratos a plazo	USD	10.000
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	330.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	HSBC	Contratos a plazo	USD	40.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPM Chase	Contratos a plazo y swaps	USD	1.530.000
Threadneedle (Lux) - Global Focus	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	3.920.000
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	50.000
Threadneedle (Lux) - American	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	1.970.000
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	120.000
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	1.540.000
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	50.000
Threadneedle (Lux) - Global Technology	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	1.870.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	750.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Royal Bank of Scotland	Contratos a plazo	EUR	160.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Barclays	Contratos a plazo y swaps	EUR	350.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	JPM Chase	Contratos a plazo y swaps	EUR	490.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	JPM Chase	Contratos a plazo y swaps	EUR	520.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	310.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Bank of America Merrill Lynch	Swaps	USD	160.000
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	UBS	Swaps	USD	1.260.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Macquarie	Swaps	USD	4.830.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Goldman Sachs	Swaps	USD	5.650.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	JPM Chase	Contratos a plazo y swaps	USD	6.600.000

En la tabla siguiente se recogen los valores entregados como garantía a 30 de septiembre de 2022:

Cartera	Contraparte	Tipo de inversión	Tipo de garantía	Emisor de garantía	Divisa	Importe de garantía
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Credit Suisse	Swaps	Bono	Gobierno estadounidense	USD	1.890.500

18 INVERSIÓN CRUZADA EN CARTERAS

A 30 de septiembre de 2022, Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return Portfolio 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 Portfolio	EUR	2.402.267	0,68
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	EUR	2.369.314	2,50
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	EUR	175.381	0,05
Threadneedle (Lux) - European Short Term High Yield Bond	EUR	2.836.039	3,51
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	EUR	403.400	0,62
Threadneedle (Lux) - Global Focus	EUR	2.462.176	0,14
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	EUR	3.131.127	9,95
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	EUR	533.721	0,08

Notas a los estados financieros

(continuación)

18 INVERSIÓN CRUZADA EN CARTERAS

(continuación)

A 30 de septiembre de 2022, Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return Portfolio 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 Portfolio	USD	2.600.130	0,75

El impacto de las transacciones de inversión cruzada ha sido 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.

19 DEPÓSITOS A PLAZO

La siguiente tabla muestra los depósitos a plazo que mantiene la SICAV a 30 de septiembre 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	1.389.973
	Mitsubishi UFJ Securities	EUR	1.600.331
	Sumitomo Bank Ltd London	EUR	1.250.021
	Total	EUR	4.240.325
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Sumitomo Bank Ltd London	EUR	25.005.695
	Total	EUR	25.005.695
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	ANZ Banking Group Ltd	USD	3.530.357
	Mitsubishi UFJ Securities	USD	3.778.121
	Total	USD	7.308.478

20 OTROS PASIVOS

Otros pasivos incluyen cualquier ajuste del valor razonable aplicado cuando ciertos mercados se cerraron al cierre del periodo para evitar la sincronización del mercado, basada en el procedimiento de fijación de precios a nivel del fondo en vigor.

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 para el periodo finalizado el 30 de septiembre de 2022 son los siguientes:

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	AEC	0,80%	
	AEH	0,80%	
	AKH	0,87%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	ANH	0,91%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond (continuación)	AU	0,80%	
	AUP	0,80%	
	DEC	1,55%	
	DEH	1,55%	
	DU	1,55%	
	DUP	1,55%	
	IEC	0,64%	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 agosto de 2022.
	IEH	0,62%	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 agosto de 2022.
	IEP	0,50%	
	IGC	0,65%	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 agosto de 2022.
	IGH	0,63%	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 agosto de 2022.
	IKH	0,63%	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 agosto de 2022.
	INH	0,50%	
	IU	0,64%	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 agosto de 2022.
	IUP	0,63%	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 agosto de 2022.
	NEC	0,40%	
	NEH	0,40%	
	NGC	0,40%	
	NGH	0,40%	
	NU	0,40%	
	NUP	0,40%	
	XEH	0,10%	
	XFH	0,10%	
	XGH	0,10%	
	XU	0,10%	
	ZEH	0,55%	
	ZFH	0,60%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	ZGH	0,55%	
	ZU	0,60%	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 agosto de 2022.
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	AE	1,13%	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 agosto de 2022.
	ANH	1,17%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	IE	0,58%	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 agosto de 2022.

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)	IEP	0,50%	
	INH	0,50%	
	XE	0,10%	
	XFH	0,10%	
	XGH	0,10%	
	XUH	0,10%	
	ZE	0,55%	
	ZFH	0,74%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	1E	1,19%	
	1G	1,19%	
	2E	0,58%	
	2G	0,51%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	3G	0,69%	
	4E	0,08%	
	4G	0,08%	
	8E	0,62%	
	8G	0,62%	
	9G	0,53%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	AE	1,55%	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 agosto de 2022.
	AKH	1,62%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	ANH	1,62%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	IE	0,83%	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 agosto de 2022.
	IEP	0,81%	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 agosto de 2022.
	IKH	0,65%	
	INH	0,71%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	XE	0,10%	
	ZE	0,88%	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 agosto de 2022.
	ZEP	0,89%	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 agosto de 2022.
	1E	1,38%	
	1EP	1,38%	
	1G	1,38%	
	1GP	1,38%	
	1UT	1,38%	
	2E	0,82%	

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)	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	0,70%	
	9EP	0,70%	
	9FC	0,56%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	9FH	0,70%	
	9G	0,60%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	9GP	0,60%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	AE	0,90%	
	AEP	0,90%	
	AKH	0,90%	
	ANH	0,90%	
	IE	0,50%	
	IEP	0,50%	
	IGC	0,50%	
	IGH	0,50%	
	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	0,50%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AKH	0,55%	
	ANH	0,55%	
	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.

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)	AUH	0,48%	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	0,46%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	INH	0,40%	
	ISC	0,50%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ISH	0,52%	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%	
	ZEP	0,45%	
	ZFH	0,45%	
	ZGC	0,45%	
	ZGH	0,45%	
	ZUH	0,45%	
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	AE	1,10%	
	AEP	1,10%	
	AKH	1,23%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	ANH	1,21%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	AUH	1,10%	
	DE	1,65%	
	DEP	1,65%	
	DUH	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	IE	0,50%	
	INH	0,50%	
	ZE	0,77%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	AEC	1,63%	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 agosto de 2022.
	AEH	1,64%	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 agosto de 2022.
	AKH	1,68%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds (continuación)	ANH	1,69%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	ASH	1,64%	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 agosto de 2022.
	AU	1,64%	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 agosto de 2022.
	AUP	1,64%	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 agosto de 2022.
	DEC	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 agosto de 2022.
	DEH	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 agosto de 2022.
	DU	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 agosto de 2022.
	IEC	0,84%	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 agosto de 2022.
	IEH	0,84%	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 agosto de 2022.
	IU	0,83%	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 agosto de 2022.
	W	1,28%	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 agosto de 2022.
	WEH	1,29%	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 agosto de 2022.
	XUP	0,10%	
	ZU	0,85%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	AEC	1,64%	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 agosto de 2022.
	AEH	1,64%	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 agosto de 2022.
	AKH	1,68%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	ANH	1,68%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	ASH	1,64%	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 agosto de 2022.
	AU	1,64%	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 agosto de 2022.
	AUP	1,64%	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 agosto de 2022.

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)	DEH	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 agosto de 2022.
	DU	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 agosto de 2022.
	IEH	0,84%	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 agosto de 2022.
	IU	0,84%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	SU	1,79%	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 agosto de 2022.
	SUP	1,79%	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 agosto de 2022.
	W	1,29%	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 agosto de 2022.
	XUP	0,10%	
	ZU	0,89%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	AEC	1,59%
AEH		1,59%	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 agosto de 2022.
AKH		1,62%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
ANH		1,63%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
ASC		1,55%	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 agosto de 2022.
ASH		1,58%	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 agosto de 2022.
AU		1,59%	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 agosto de 2022.
AUP		1,59%	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 agosto de 2022.
DEH		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 agosto de 2022.
DU		1,73%	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 agosto de 2022.
IE		0,84%	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 agosto de 2022.

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds (continuación)	IEH	0,84%	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 agosto de 2022.
	XU	0,10%	
	XUP	0,10%	
	ZEH	0,88%	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 agosto de 2022.
	ZU	0,85%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	AEC	1,54%	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 agosto de 2022.
	AEH	1,54%	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 agosto de 2022.
	AKH	1,56%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	ANH	1,55%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	ASH	1,56%	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 agosto de 2022 y a la significativa variación del VL medio.
	AU	1,53%	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 agosto de 2022.
	AUP	1,54%	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 agosto de 2022.
	DEC	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 agosto de 2022.
	DEH	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 agosto de 2022.
	DU	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 agosto de 2022.
	IEC	0,53%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IEH	0,65%	
	IKH	0,55%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	INH	0,56%	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	0,10%	
	ZFH	0,90%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	ZGH	0,92%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond (continuación)	ZU	0,83%	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 agosto de 2022 y a la significativa variación del VL medio.
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	AEH	1,10%	
	AKH	1,18%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	AS	1,15%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	ASC	1,10%	
	ASH	1,15%	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 agosto de 2022.
	AU	1,10%	
	AUP	1,10%	
	AVC	1,10%	
	AVH	1,20%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	DEH	1,40%	
	IEH	0,50%	
	IGH	0,50%	
	ISH	0,50%	
	IU	0,50%	
	XU	0,10%	
	ZU	0,63%	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 agosto de 2022.
	ZUP	0,69%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	AE	1,62%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 7 puntos básicos anualizados.
	AEP	1,74%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 7 puntos básicos anualizados.
	DE	2,37%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 7 puntos básicos anualizados.
	IE	0,92%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 7 puntos básicos anualizados.
	IEP	0,78%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 7 puntos básicos anualizados.
	LE	0,77%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 7 puntos básicos anualizados.
	LEP	0,61%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 7 puntos básicos anualizados.
	ZE	1,26%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 7 puntos básicos anualizados.
	ZEP	1,25%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 7 puntos básicos anualizados.

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	AEC	1,65%	
	AEH	1,65%	
	AKH	1,72%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AU	1,65%	
	AUP	1,65%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IEH	0,95%	
	IGH	0,95%	
	IU	0,95%	
	W	1,75%	
	ZU	1,12%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	AE	1,55%	
	AEC	1,55%	
	AEH	1,55%	
	AEP	1,55%	
	AS	1,69%	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	1,15%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZEH	1,05%	
	ZFH	1,10%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
ZU	1,05%		
ZUP	1,12%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	AE	1,81%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AEC	1,77%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AEH	1,79%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	AU	1,78%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase y a la significativa variación del VL medio.
	AUP	1,78%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,80%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
IEH	0,75%		

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities (continuación)	IG	0,81%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IU	0,75%	
	LE	0,45%	
	LG	0,45%	
	XU	0,10%	
	ZE	1,01%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZEC	1,07%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZEH	1,06%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	1,03%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	ZUP	1,06%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - Global Focus	AEH	1,79%	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 agosto de 2022.
	AEP	1,78%	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 agosto de 2022.
	ASH	1,59%	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 agosto de 2022, así como al reciente lanzamiento de la clase.
	AU	1,79%	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 agosto de 2022.
	AUP	1,78%	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 agosto de 2022.
	DEH	2,54%	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 agosto de 2022.
	DU	2,53%	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 agosto de 2022.
	IE	0,94%	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 agosto de 2022.
	IEH	0,93%	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 agosto de 2022.
	IU	0,94%	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 agosto de 2022.
	IUP	0,94%	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 agosto de 2022.
	W	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 agosto de 2022.
	XU	0,10%	
	ZE	1,03%	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 agosto de 2022.

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Focus (continuación)	ZEH	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 agosto de 2022.
	ZEP	1,03%	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 agosto de 2022.
	ZFH	1,04%	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 agosto de 2022.
	ZG	1,03%	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 agosto de 2022.
	ZU	1,04%	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 agosto de 2022.
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	AEH	1,79%	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 agosto de 2022.
	AU	1,79%	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 agosto de 2022.
	DEH	2,54%	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 agosto de 2022.
	DU	2,54%	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 agosto de 2022.
	IE	0,95%	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 agosto de 2022.
	IEH	0,94%	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 agosto de 2022.
	IU	0,94%	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 agosto de 2022.
	XU	0,10%	
	ZU	1,02%	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 agosto de 2022.
	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	1,85%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	DEC	2,30%	
	DUP	2,30%	
	IU	0,95%	
	TE	1,09%	
	ZU	1,05%	
	1E	1,68%	
	1EP	1,68%	

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)	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%	
	9EP	0,81%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9U	0,81%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	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	0,94%	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 agosto de 2022.
	ZU	1,02%	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 agosto de 2022.
	1E	1,68%	
	1U	1,68%	
	2E	1,07%	
	2U	1,07%	
	3U	0,90%	
	8E	1,11%	
	8U	1,11%	
	9U	0,85%	
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	0,07%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	XG	0,07%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	XGH	0,07%	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) - Global Smaller Companies (continuación)	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	1,06%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	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%	
	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%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	AEH	1,80%	
	ASH	1,87%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase y a su reciente lanzamiento.
	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	1,91%	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	1,80%	
	DE	2,55%	
	IF	0,88%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ISH	0,85%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IU	0,95%	
	XU	0,15%	
	XUP	0,15%	
	ZE	1,05%	
	ZEH	1,10%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZF	1,12%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
ZG	1,14%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
ZU	1,05%		
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	AE	1,91%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AEH	1,80%	
	DE	2,39%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	DEH	2,35%	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%		

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Asia Equities (continuación)	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	0,07%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	XSH	0,15%	
	ZEH	1,10%	
	ZFH	1,10%	
	ZGH	1,15%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	1,10%	
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	AE	0,70%	
	AEH	0,61%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AU	0,70%	
	AUP	0,63%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	DE	0,90%	
	DEH	0,90%	
	DU	0,90%	
	IE	0,35%	
	IEC	0,35%	
	IEH	0,35%	
	IFH	0,35%	
	IG	0,35%	
	IU	0,35%	
	NE	0,20%	
	NG	0,20%	
	NU	0,20%	
	XG	0,10%	
	ZEH	0,45%	
	ZFH	0,40%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	0,45%	
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	AE	1,50%	
	ASH	1,50%	
	AUH	1,50%	
	DE	1,70%	
	IE	0,75%	
	W	1,73%	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 agosto de 2022.
	XE	0,10%	
	ZE	0,98%	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 agosto de 2022.

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities (continuación)	ZUH	0,98%	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 agosto de 2022.
	1E	1,53%	
	1EP	1,53%	
	1G	1,53%	
	1GP	1,53%	
	2E	1,08%	
	2G	1,08%	
	2U	1,03%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	3E	0,94%	
	3G	0,94%	
	3GP	0,94%	
	4E	0,08%	
	4G	0,08%	
	8E	1,12%	
	8G	1,12%	
	8U	1,04%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9E	0,85%	
	9G	0,85%	
	9GP	0,85%	
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	AE	1,80%	
	AEP	1,80%	
	AUP	1,89%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	DE	2,15%	
	DEP	2,15%	
	IE	0,65%	
	IEP	0,65%	
	ZE	1,05%	
	ZEP	1,05%	
	1E	1,70%	
	1EP	1,70%	
	1G	1,70%	
	1GP	1,70%	
	2E	1,09%	
	2EP	1,01%	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%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
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	0,07%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	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	0,80%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
9FH	0,87%		
9G	0,87%		
9GP	0,79%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
9UH	0,87%		
Threadneedle (Lux) - European Select	AE	1,80%	
	AGH	1,80%	
	AUH	1,80%	
	DUH	2,35%	
	IE	0,95%	
	ZE	1,16%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	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%		

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - European Select (continuación)	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	1,14%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZGH	1,05%	
	ZGP	1,16%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	1,11%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZUP	1,05%	
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	1,15%	
	ZU	1,15%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
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	0,56%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	NFH	0,58%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	NG	0,68%	
	NGP	0,56%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	NUH	0,58%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	TEH	0,62%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	TFH	0,63%	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	0,61%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	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%		
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	AE	1,80%	
	AEC	1,80%	
	AEH	1,80%	
	AG	1,80%	
	ASC	1,86%	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	2,55%	
DEH	2,55%		

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income (continuación)	DG	2,61%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	DGP	2,62%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	IE	0,85%	
	IEH	0,85%	
	IG	0,85%	
	IGP	0,85%	
	IU	0,85%	
	IUH	0,69%	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	0,35%	
	ZU	0,35%	
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%	
	IU	0,95%	
	XGH	0,15%	
	ZE	1,05%/2,42%	
	ZEH	1,14%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZGH	1,05%	
	ZU	1,05%	
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	AE	1,01%
IE		0,50%	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%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities (continuación)	2E	0,56%	
	2EP	0,56%	
	2GC	0,47%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	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	1,17%	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 agosto de 2022.
	AFH	1,19%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	AKH	1,24%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	ANH	1,19%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	AUH	1,10%	
	DE	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 agosto de 2022.
	IE	0,54%	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 agosto de 2022.
	IEP	0,45%	
	IGH	0,45%	
	INH	0,45%	
	IU	0,45%	
	IUH	0,52%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	JE	0,44%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	JGH	0,43%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	JUH	0,48%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	LE	0,38%	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 agosto de 2022.
	LEP	0,14%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	LGH	0,14%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities (continuación)	XE	0,10%	
	XGH	0,10%	
	XUH	0,10%	
	YE	0,69%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	YGH	0,69%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	YUH	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	ZE	0,75%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	ZFH	0,72%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	ZGH	0,75%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	ZUH	0,70%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	AE	1,85%/1,72%	
	AEP	1,85%/1,52%	
	AUH	1,85%/1,59%	
	DE	2,35%	
	IE	0,95%	
	IGH	0,95%/1,03%	
	LE	0,58%/0,73%	
	XGH	0,15%	
	ZE	1,05%	
	ZF	1,18%/0,61%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZFH	1,05%/1,25%	
	ZGH	1,15%/1,31%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	AEH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IU	0,90%	
	ZU	1,10%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	1E	1,69%	
	1EH	1,69%	
	1U	1,69%	
	2E	0,83%	
	2U	0,83%	
	3U	0,94%	
	8E	0,87%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha (continuación)	8U	0,87%	
	9U	0,81%	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	1,15%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	1E	1,69%	
	1U	1,69%	
	2E	0,83%	
	2U	0,83%	
	8E	0,87%	
	8U	0,87%	
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	AEH	1,36%	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 agosto de 2022.
	AFH	1,36%	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 agosto de 2022.
	AGH	1,39%	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 agosto de 2022.
	ASH	1,39%	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 agosto de 2022.
	AU	1,32%	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 agosto de 2022.
	DEH	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 agosto de 2022.
	DU	1,63%	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 agosto de 2022.
	IEH	0,95%	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 agosto de 2022.
	IG	0,97%	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.
	IGH	0,95%	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 agosto de 2022.
	IU	0,98%	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 agosto de 2022.
	NG	0,61%	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 agosto de 2022.
	XU	0,10%	
	ZEH	0,99%	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 agosto de 2022.
	ZFH	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 agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase de acciones.

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities (continuación)	ZGH	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 agosto de 2022.
	ZU	1,06%	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 agosto de 2022.

¹ El IGT incluye la comisión de rendimiento.

* Incluidos únicamente los Gastos operativos, consulte la nota 22.

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. La incertidumbre en torno a la magnitud, la duración, el alcance, el coste y los efectos de la pandemia mundial, así como las acciones que las autoridades gubernamentales u otros organismos han emprendido o podrían emprender, presentan una serie de incógnitas que aún no se han desvelado. 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 impactos adversos graves en los mercados regionales y/o mundiales de valores y materias primas, incluidos los mercados de petróleo y gas natural. Estos impactos pueden incluir una reducción en la liquidez del mercado, dificultades en los mercados de crédito, una mayor perturbación de las cadenas de suministro mundiales, un mayor riesgo de inflación y un acceso limitado a las inversiones en determinados mercados y/o emisores internacionales. Estos hechos y otros relacionados podrían tener un impacto negativo en el rendimiento de la Cartera y en el valor de una inversión en las Carteras.

Con efecto a partir del 21 de mayo de 2021, Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity Portfolio 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 30 de septiembre de 2022, la Cartera tenía 24 posiciones nigerianas en naira a la espera de su conversión a USD.

Información para los accionistas

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 del 10 de agosto de 1915, en su versión modificada, y califica como 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 a partir del 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 de acuerdo con la legislación luxemburguesa y de acuerdo con 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 no auditado 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 ser autorizadas u ofrecidas 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.

Información para inversores en Suiza

El informe anual y los estados financieros auditados, el informe semestral no auditado, 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., 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.

Reglamento de operaciones de financiación de valores

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 30 de septiembre 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	1.059.295	2,57
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	SRT	699.736	0,74
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	SRT	1.528.775	1,84
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	SRT	1.856.129	2,50
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	SRT	18.968.632	5,46

Datos sobre la reutilización de garantías

No hubo reutilización de garantías durante el periodo finalizado el 30 de septiembre de 2022.

Datos de concentración

Todas las garantías recibidas con respecto a SRT a 30 de septiembre 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 (en función del volumen bruto de transacciones pendientes) con respecto a SRT mantenidas por cada Cartera a 30 de septiembre 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	826.303
		Bank of America Merrill Lynch	232.992
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	SRT	UBS	607.846
		Goldman Sachs	91.890
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	SRT	UBS	1.249.632
		Bank of America Merrill Lynch	279.143
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	SRT	UBS	1.856.129
		Goldman Sachs	6.740.305
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	SRT	Macquarie	5.707.452
		JPMorgan	4.273.392
		Credit Suisse	2.247.483

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.

Reglamento de operaciones de financiación de valores

(continuación)

La siguiente tabla muestra los depósitos a plazo que mantiene la SICAV a 30 de septiembre de 2022:

Nombre de la Cartera	Tipo de garantía	Contraparte	Divisa de garantía	Importe de garantía
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Efectivo	UBS	USD	410.000*
		Bank of America Merrill Lynch	USD	110.000
		Total	USD	520.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Efectivo	UBS	EUR	3.600.000
		Goldman Sachs	EUR	890.000
		Total	EUR	4.490.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Efectivo	UBS	USD	620.000
		Total	USD	620.000

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	de 3 meses a 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	de 3 meses a 1 año	Reino Unido	Bilateral	N/D – Efectivo
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Efectivo	Vencimiento abierto	USD	de 1 mes a 3 meses / más de 1 año	Reino Unido	Bilateral	N/D – Efectivo
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Efectivo	Vencimiento abierto	USD	de 1 día a 1 mes	Reino Unido	Bilateral	N/D – Efectivo
	Bono	de 1 día a 1 mes / de 1 mes a 3 meses	USD	de 1 día a 1 mes	Reino Unido	Bilateral	F1+u (Fitch)

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 concedido para SRT a 30 de septiembre de 2022 es el siguiente:

Nombre de la Cartera	Tipo de garantía	Contraparte	Divisa de garantía	Importe de garantía	% de garantía mantenida al cierre del periodo por categoría
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Efectivo	Bank of America Merrill Lynch	USD	160.000	0,19
		Total	USD	160.000	0,19
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Efectivo	UBS	USD	1.260.000	1,70
		Total	USD	1.260.000	1,70
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Efectivo	JPMorgan	USD	6.600.000*	1,90
		Goldman Sachs	USD	5.650.000	1,62
		Macquarie	USD	4.830.000	1,39
		Bono	Credit Suisse	USD	1.890.500
	Total	USD	18.970.500	5,45	

Rendimiento/Costes

El rendimiento y los costes operativos de SRT a 30 de septiembre 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».

* Este importe de garantía podrá estar relacionado con operaciones que no sean SRT que no están cubiertas por la divulgación del SFTR.

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
225 Franklin Street
Boston MA 02110
Estados Unidos de América

Threadneedle Asset
Management Limited
Cannon Place
78 Cannon Street
Londres EC4N 6AG
Reino Unido

Threadneedle Investments
Singapore (Pte.) Limited
3 Killiney Road
#07-07 Winsland House 1
Singapur 239519
Singapur

STANLIB Asset Management (Pty) Limited Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity⁷
17 Melrose Boulevard
Melrose Arch 2196
Johannesburgo
Sudáfrica

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 Commodities³

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity⁶

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 (a partir del 1 de agosto de 2022, con respecto a Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities).

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 22.

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 pago

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

Asesores 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 454278