

Threadneedle (Lux)

Informe anual y estados financieros auditados
Société d'Investissement à Capital Variable
31 de marzo de 2023

SICAV: Un organismo luxemburgués de inversión colectiva en valores mobiliarios de conformidad con la Parte I de la Ley del 17 de diciembre de 2010, en su versión modificada. Registro Mercantil de Luxemburgo n.º B-50.216

Contenidos

Información sobre la Sociedad	4	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	76
Informe de los Consejeros	5	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	77
Rendimiento	8	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	78
Informe de auditoría	9	Estados de la Cartera	
Estados financieros:		Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	80
Estados financieros agregados de Threadneedle (Lux)	12	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	89
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	13	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	95
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	15	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	104
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	17	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	109
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	19	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	116
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	20	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	123
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	22	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	127
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	23	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	133
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	24	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	137
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	25	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	146
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	26	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	150
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	28	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	152
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	30	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	155
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	31	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	170
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	32	Threadneedle (Lux) - Global Focus	172
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	34	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	174
Threadneedle (Lux) - Global Focus	35	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	177
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	37	Threadneedle (Lux) - Global Select	179
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	38	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	181
Threadneedle (Lux) - Global Select	40	Threadneedle (Lux) - American	183
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	41	Threadneedle (Lux) - American Select	184
Threadneedle (Lux) - American	43	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	185
Threadneedle (Lux) - American Select	45	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	187
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	47	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	189
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	48	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	191
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	49	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	193
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	50	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	195
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	51	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	197
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	53	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	199
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	55	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	201
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	57	Threadneedle (Lux) - European Select	203
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	58	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	205
Threadneedle (Lux) - European Select	60	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	207
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	62	Threadneedle (Lux) - Global Technology	209
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	63	Threadneedle (Lux) - UK Equities	210
Threadneedle (Lux) - Global Technology	64	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	211
Threadneedle (Lux) - UK Equities	65	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	212
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	67	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	214
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*	69	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	220
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	70	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	223
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	71	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	224
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	73	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	225
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	75	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	227

* Consulte la Nota 1.

Contenidos

(continuación)

Notas a los estados financieros	228
Exposición al riesgo global (sin auditar)	343
Información para los accionistas (sin auditar)	345
Información para inversores en Suiza (sin auditar)	348
Rendimiento de la Clase de Acciones (sin auditar)	349
Reglamento de operaciones de financiación de valores (sin auditar)	375
Reglamento sobre divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (SFDR) (sin auditar)	377
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond Fund	377
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	385
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	393
Threadneedle (Lux) - Global Focus	401
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	409
Threadneedle (Lux) - Global Select	418
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	426
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	434
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	443
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	452
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	461
Threadneedle (Lux) - European Select	469
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	477
Directorio	487

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

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

Información sobre la Sociedad

Sociedad

Threadneedle (Lux)
R.C.S. 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

Informe de los Consejeros

Los mercados financieros experimentaron 12 meses de volatilidad. Incluso antes de la invasión de Ucrania por parte de Rusia a finales de febrero de 2022, las presiones inflacionistas habían ido en aumento debido a las perturbaciones en las cadenas de suministro mundiales debido a la pandemia. En todo el mundo, la inflación continuó su ascenso, impulsada, esta vez, por una nueva subida en los precios de la energía a causa de la guerra.

Tras haber calificado los riesgos de inflación como meramente «transitorios» durante gran parte de 2021, los bancos centrales de EE. UU., Reino Unido y Europa aumentaron los tipos de interés de forma agresiva durante 2022 y el primer trimestre de 2023. En EE. UU., la Reserva Federal (Fed) subió los tipos desde un rango objetivo de entre 0,25% y el 0,50% a finales de marzo de 2022 hasta un rango entre el 4,75% y el 5,0%. En Reino Unido, el Banco de Inglaterra (BoE) aumentó el tipo básico del 0,75% al 4,25%; por su parte, el Banco Central Europeo (BCE) también aumentó los tipos. Por el contrario, el Banco de Japón mantuvo los tipos en el -0,1% durante todo el año, pero aumentó su límite sobre los rendimientos de los bonos gubernamentales a 10 años a finales de 2022. En general, esto se interpretó como el primer paso para abandonar su política monetaria ultralaxa.

Conforme avanzaba 2022, las perspectivas de recesión pesaron aún más en la confianza de los inversores. Los problemas de la cadena de suministro, la subida de los tipos de interés y la política de «cero COVID-19» de China contribuyeron a la desaceleración del crecimiento mundial. Además, la guerra en Ucrania provocó que los elevados precios de la energía aumentaran abruptamente en Europa, lo que causó estragos en los presupuestos de los consumidores y que los costes operativos de las empresas se dispararan. Hacia el final del periodo, la debilidad de los datos económicos mundiales y el enfriamiento de la inflación alimentaron las esperanzas de que los principales bancos centrales estuvieran a punto de terminar su ciclo actual de subidas de tipos.

En marzo, la volatilidad del mercado repuntó tras la noticia de la quiebra de Silicon Valley Bank (SVB) y los problemas de otros dos prestamistas estadounidenses pequeños. Los rendimientos de los bonos gubernamentales (que evolucionan de forma inversa al precio) experimentaron algunas de las mayores caídas en décadas, especialmente en los bonos con vencimientos a más corto plazo, ya que los inversores preveían menos subidas de los tipos de interés. Los diferenciales de crédito (las primas de rendimiento sobre los bonos gubernamentales «libres de riesgo») se ampliaron en marzo tras reducirse en los dos primeros meses del año, especialmente en el crédito de alto rendimiento (AR).

El pánico bancario desatado en el SVB y su posterior cierre y adquisición por parte de la Federal Deposit Insurance Corporation hicieron temblar a todo el sector bancario y centró su atención en las pérdidas en las Carteras de bonos de los bancos debido a los tipos de interés más altos. Las acciones bancarias cayeron, sobre todo las de los prestamistas menos consolidados. En Suiza, las autoridades reguladoras facilitaron la adquisición de Credit Suisse, sumida en una turbulenta situación por parte de su mayor competidor, UBS. Hacia finales de marzo, las acciones bancarias se estabilizaron y, en el momento de redactar este informe, existen indicios que apuntan a que se han contenido los temores de contagio iniciales.

La repercusión más inmediata de la crisis fue reducir las expectativas sobre la trayectoria de los tipos de interés, en parte ante la suposición de que los bancos centrales se mostrarían reacios a asumir mayores riesgos en el sector bancario. La inestabilidad bancaria, en particular en Estados Unidos, también debería conducir a un endurecimiento de las condiciones crediticias y, por lo tanto, limitar el crecimiento y la inflación. Según declaraciones del presidente de la Fed, Jerome Powell, es probable que esta situación tenga el mismo impacto que un aumento de los tipos.

En Reino Unido, la preocupación por la situación financiera nacional llegó a su punto álgido en septiembre, cuando el excanciller Kwasi Kwarteng entregó un «minipresupuesto» de reducción de impuestos. Los inversores se mostraron inquietos por la falta de información sobre la financiación o las proyecciones independientes habituales de la Oficina de Responsabilidad Presupuestaria («Office for Budget Responsibility»). En consecuencia, la renta variable se precipitó, los rendimientos de los gilts se dispararon y la libra prácticamente alcanzó la paridad con el dólar. El repentino aumento de los rendimientos de los gilts supuso un grave riesgo para una serie de fondos de pensiones del Reino Unido. El BoE intervino para calmar los mercados comprometiéndose a comprar hasta 65 millones de libras en gilts con vencimiento a largo plazo. En octubre, la libra repuntó y los rendimientos de los gilts cayeron cuando la primera ministra, Liz Truss, destituyó a Kwasi Kwarteng como canciller antes de que ella misma fuera reemplazada sin demora por Rishi Sunak. El nuevo canciller, Jeremy Hunt, revirtió la mayor parte de las promesas de su predecesor y anunció subidas de impuestos y recortes de gastos. La siguiente primavera, el presupuesto de Hunt escondía pocas sorpresas. El canciller declaró que Reino Unido probablemente evitaría una recesión en 2023 y reiteró la promesa del Gobierno de reducir la inflación a la mitad, fortalecer las finanzas públicas e impulsar el crecimiento económico.

En esta compleja coyuntura, el MSCI ACWI obtuvo una rentabilidad del -5,1% en divisa local durante el periodo de 12 meses analizado.

Entre las principales regiones de renta variable, Europa (excepto el Reino Unido) y Japón obtuvieron los mejores resultados en divisa local y registraron rentabilidades positivas. Estos mercados, caracterizados por tener un elevado volumen de exportaciones, se vieron favorecidos por la debilidad de sus respectivas divisas frente al dólar estadounidense. Hacia el final del periodo, la renta variable de Europa (excepto el Reino Unido) también se benefició de la mejora de las perspectivas económicas de la región. La renta variable británica también avanzó durante el año gracias a la debilidad de la libra frente al dólar. La considerable exposición del mercado a las acciones de los sectores energético y minero también resultó ventajosa, dados los fuertes aumentos de los precios de las materias primas subyacentes a raíz de la invasión rusa.

Los mercados emergentes (ME) registraron unos resultados desfavorables: en un primer momento, se vieron lastrados por la debilidad de las acciones chinas, ya que la política de «cero COVID-19» de Pekín perjudicó en gran medida la actividad económica. La confianza también se vio afectada por una floreciente crisis en el sector inmobiliario y por las continuas ofensivas normativas. Posteriormente en el periodo, las acciones chinas repuntaron con fuerza, ya que Pekín levantó la mayoría de sus restricciones por la COVID-19 y pareció aliviar la represión contra las grandes empresas. EE. UU. fue el país que registró peores resultados, perjudicado por los episodios de debilidad de las acciones de crecimiento, así como por un aluvión de beneficios corporativos decepcionantes en el último trimestre de 2022.

En cuanto a la renta fija, los rendimientos de los bonos gubernamentales principales se incrementaron de forma repentina durante el periodo ante la reacción de los inversores a las ingentes subidas de los tipos de interés de la Fed, el BoE y el BCE. El rendimiento de los bonos del Tesoro de EE. UU. a 10 años subió 113 puntos básicos (pb) hasta llegar al 3,47% en marzo de 2023. Los equivalentes británicos y alemanes aumentaron respectivamente 188 pb hasta el 3,49% y 174 pb hasta el 2,29%. Los mercados de bonos corporativos también se mostraron débiles durante gran parte del periodo; el impacto negativo de los mayores

Informe de los Consejeros

(continuación)

rendimientos de bonos se vio agravado por unos diferenciales de crédito más amplios. Sin embargo, los diferenciales se estrecharon a partir del cuarto trimestre de 2022, ante las menores preocupaciones ante un endurecimiento monetario; por su parte, los diferenciales mundiales de GI terminaron el año analizado casi 30 pb más amplios. Durante el periodo, los diferenciales de AR en euros también se ampliaron.

En el Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity Fund, las nuevas participaciones durante el periodo incluyeron Singapore Telecommunications Singtel, BYD y Parade Technologies. Singtel es el mayor proveedor de servicios de telecomunicaciones de Singapur y el segundo mayor de Australia a través de Optus, propiedad de Singtel. La compañía también tiene participaciones en otras empresas de telecomunicaciones de la región. Aparentemente, la valoración es atractiva y los beneficios, resistentes, mientras que las acciones ofrecen una buena rentabilidad por dividendo. BYD es uno de los principales fabricantes de automóviles de China y la marca de vehículos eléctricos (VE) líder en ventas. La empresa también es un importante proveedor de baterías y componentes para auriculares. Somos optimistas con respecto al aumento de los volúmenes de ventas de VE de BYD y existe la posibilidad de aumentar los márgenes, gracias a la mejora de la combinación de productos de la empresa. Las perspectivas para la empresa taiwanesa de semiconductores *fabless* (o «sin fábrica»), Parade Technologies parecen alentadoras, con el fin de la reducción de las existencias. En Tailandia, compramos Kasikornbank, uno de los cuatro principales grupos bancarios del país. Se espera que el banco se beneficie de la recuperación de la economía tailandesa, ya que sectores clave como el turismo y el comercio minorista se recuperarán con fuerza tras la pandemia de COVID-19. Salimos de la empresa china Baidu, ya que consideramos que la empresa podría verse afectada por las restricciones a la exportación de semiconductores estadounidenses. Además de Baidu, también vendimos OCBC y Sea en Singapur y Lotte Chilsung Beverage en Corea. Estas acciones se vendieron para aumentar las posiciones en China, como en Alibaba y China Construction Bank, cuyas valoraciones ofrecían margen para una nueva calificación dada la mejora de las perspectivas tras la reapertura posterior a la pandemia.

Durante el periodo, en el Threadneedle (Lux) - Global Select Fund, las nuevas posiciones durante el periodo incluyeron TotalEnergies, PepsiCo y Elevance Health. Favorecemos TotalEnergies por su heterogénea línea de productos, su gran presencia internacional y su consolidada posición en el mercado. Además, la empresa presenta una ventaja sobre sus homólogos con respecto al desarrollo de un negocio de energías renovables. PepsiCo es uno de los principales proveedores mundiales de alimentos, bebidas y aperitivos. Esperamos que su Cartera de marcas de alta calidad respalde un sólido crecimiento de los ingresos brutos con baja volatilidad. PepsiCo también disfruta de una alta cuota de mercado, la fidelidad de los clientes y poder de fijación de precios. Elevance Health es un proveedor líder de seguros de salud en Estados Unidos. La empresa cuenta con una de las marcas nacionales más reconocibles, así como con una escala significativa en el sector, lo que ayuda a generar ventajas de costes y garantiza la fidelidad de los clientes. También se beneficia del aumento de la demanda de seguros de salud. Mantenemos nuestras posiciones en SVB Financial y First Republic. Como líder en la provisión de financiación a la industria de capital riesgo y capital privado, SVB hizo gala de una amplia gama de ventajas competitivas y proporcionó una exposición bancaria diferenciada para la Cartera. Sin embargo, dados los desafíos en el sector tecnológico y el agotamiento de las nuevas rondas de financiación, el banco sufrió una fuga de depósitos, lo que causó un posible riesgo de liquidez en el balance contable y dio lugar a los acontecimientos de marzo. La quiebra de SVB y la consiguiente pérdida de confianza en los bancos regionales de Estados Unidos también afectaron a First Republic. Vendimos nuestra posición en esta última a mediados de marzo antes de que casi quebrara y JPMorgan la adquiriera en abril. También vendimos Samsung Electronics tras el sólido rendimiento de la acción y utilizamos los ingresos para abrir una participación en Micron Technology, que presenta un perfil de riesgo-rentabilidad superior.

Durante el periodo, en el Threadneedle (Lux) - Global Focus Fund, iniciamos una serie de posiciones, incluidas HDFC Bank, Legrand y Waste Connections. Compramos HDFC, el principal banco del sector privado indio, después de vender ICICI Bank porque queríamos concentrar nuestra exposición al sector en una única posición, y, en nuestra opinión, HDFC tiene un mejor historial de préstamos a largo plazo. Legrand es líder en equipos eléctricos de baja tensión y disfruta de una cuota de mercado muy alta, especialmente en mercados de bajo crecimiento como Italia y Francia. Nos decantamos por Legrand dada su presencia internacional, que consideramos que aumentará con el tiempo, especialmente en EE. UU. y los ME. Waste Connections es una empresa norteamericana de servicios integrados de tratamiento de residuos que ofrece servicios de recogida, transferencia, eliminación y reciclaje de residuos. Ostenta una posición líder en el mercado estadounidense y cuenta con el mejor historial a largo plazo entre sus homólogos. Además, la empresa dispone de una estrategia operativa sólida dirigida a las comunidades rurales y de los suburbios en lugar de a las ciudades, lo que le otorga un mayor poder de negociación junto con la economía de escala y las ventajas de costes. Las ventas incluyeron Amazon, Adobe y Tryg.

Las nuevas participaciones en el Threadneedle (Lux) - Global Equity Income Fund incluyeron AbbVie, PNC y SMC. AbbVie investiga y desarrolla productos farmacéuticos. Los nuevos productos de la compañía disfrutaron de un fuerte crecimiento, entre los que destacan dos fármacos de primer nivel: el medicamento para la psoriasis Skyrizi y el medicamento para la inflamación Rinvoq. AbbVie también ostenta una posición dominante en el mercado estético, por lo que cuenta con otro factor favorable al crecimiento y la diversificación. PNC es una empresa de servicios financieros diversificados, que goza de una buena gestión, con una sólida y creciente presencia en Estados Unidos. La empresa se beneficia de su amplia gama de productos, su sólida tecnología y su consolidada reputación. Además, las acciones de la empresa ofrecen un elevado rendimiento por dividendo. SMC es el mayor fabricante de equipos neumáticos del mundo. La demanda de sus productos está creciendo, especialmente en el sector de la automatización. SMC también se beneficia de una gran posición en el mercado, una amplia gama de productos, un gran alcance de distribución y plazos de entrega rápidos. Entre las ventas se incluyó Valero Energy, ya que queríamos reducir nuestra exposición cíclica. También salimos de Crown Castle porque creemos que la empresa tendrá dificultades para mantener el crecimiento de sus dividendos en un entorno más inflacionista. Otras ventas incluyeron Disco Corporation y Manulife Financial.

En el Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies Fund, abrimos nuevas posiciones en Nemetschek y Rémy Cointreau. Nemetschek es líder mundial en varias regiones y segmentos del sector de la construcción. La empresa cuenta con una base de ingresos diversificada, un equipo de gestión sólido y experimentado y una posición de mercado consolidada. También optamos por Nemetschek dado su liderazgo en el ámbito de la innovación. Rémy Cointreau fabrica y distribuye vinos y licores de primera calidad en todo el mundo. La excelente Cartera de marcas de Rémy le brinda una ventaja competitiva y un gran poder de fijación de precios. En nuestra opinión, la empresa está bien posicionada para beneficiarse del cambio en las preferencias de los consumidores hacia marcas de gama alta. También abrimos una posición en Acushnet, una empresa dedicada a la fabricación y distribución de productos de golf. Acushnet probablemente se beneficie de la mayor demanda de pelotas de golf, además de contar con una significativa Cartera de pedidos pendientes, unos niveles reducidos de inventarios en canales y unos niveles de producción en continuo crecimiento. Vendimos de forma rentable Evoqua Water Technologies después de que la empresa recibiera una oferta de adquisición con prima de Xylem. Otras ventas incluyeron Ritchie Bros Auctioneers e Inter Parfums.

Informe de los Consejeros

(continuación)

En el Threadneedle (Lux) - UK Equities Fund, las nuevas participaciones incluyeron SSE, Ashtead y Spectris. SSE es líder en desarrollo y operador de energía renovable e infraestructuras de bajas emisiones de carbono para la transmisión y distribución de electricidad. La empresa opera una Cartera equilibrada de activos que incluye redes eléctricas, así como energías renovables, lo que le permite desenvolverse adecuadamente en condiciones de mercado volátiles. La empresa de alquiler de equipos Ashtead presentaba una valoración atractiva; también cuenta con sólidos fundamentales y sus ingresos aumentan gracias a las adquisiciones adicionales. Reabrimos una posición en Spectris (cuyas acciones vendimos de forma rentable a finales de 2021) después de que la empresa vendiera su división Omega a un precio superior al esperado. El resto de la actividad de la empresa es de excelente calidad, con un balance contable neto de efectivo. A principios del periodo, también abrimos una posición en la empresa de software Aveva. Posteriormente, las acciones repuntaron tras una oferta de Schneider Electric y, posteriormente, vendimos las acciones con beneficios. Otras ventas incluyeron Smiths Group, Imperial Brands, BAE y Hunting.

En el Threadneedle (Lux) - UK Equity Income Fund, iniciamos posiciones en Smith & Nephew, Hikma Pharmaceuticals y Travis Perkins. Las acciones del fabricante de dispositivos médicos Smith & Nephew estaban infravaloradas con respecto a sus homólogos y el valor potencial de sus divisiones totales. Ante el lanzamiento de nuevos productos por parte de la empresa, somos optimistas con respecto a sus perspectivas a medio y largo plazo. Hikma es líder en los segmentos de medicamentos inyectables y de marca, que presentan importantes obstáculos de entrada y un fuerte potencial de crecimiento, además de ofrecer buenos resultados. La empresa también está ampliando su enfoque a áreas como el segmento de productos farmacéuticos especializados, la fabricación por contrato y los biosimilares. El minorista de suministros para la construcción Travis Perkins cuenta con un balance contable sólido y no tiene deuda financiera. El rendimiento por dividendo es atractivo y cuenta con la protección de una cómoda cobertura de beneficios. Vendimos JD Wetherspoon debido a las preocupaciones sobre el balance contable de la empresa y la independencia de los consejeros. También vendimos United Utilities para financiar una nueva posición en SSE, un promotor y operador líder de energía renovable e infraestructuras con bajas emisiones de carbono.

En el Threadneedle (Lux) - American Fund y el Threadneedle (Lux) - American Select Fund, las nuevas participaciones incluyeron Intuitive Surgical y Procter & Gamble. Intuitive Surgical fabrica equipos robóticos para cirugía mínimamente invasiva y ofrece una oportunidad más atractiva en comparación con sus homólogos de gran capitalización en la categoría de dispositivos médicos, debido al enorme mercado potencial de la empresa en el ámbito de la cirugía de tejidos blandos. Procter & Gamble ofrece un perfil de beneficios defensivo a corto plazo e históricamente ha constituido uno de los mejores factores de beneficios de su clase. La mejora del perfil de crecimiento de la empresa ofrece un mayor apalancamiento operativo, que debería favorecer el crecimiento de los beneficios junto con el potencial de rentabilidad para los accionistas si los costes transitorios y los problemas derivados de las divisas disminuyen. Las ventas incluyeron CVS Health, Cisco Systems y Mirati Therapeutics.

En el Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies Fund, las nuevas posiciones incluyeron Applied Industrial Technologies, Cable One y Stanley Black & Decker. Applied Industrial Technologies es un distribuidor industrial centrado en sistemas de control de movimiento y automatización. La empresa se enfrenta a una gran oportunidad de aumentar los ingresos, los márgenes y el flujo de caja libre debido al incremento constante de su cuota de mercado, la eficiencia operativa y la tendencia hacia la relocalización de la fabricación. Cable One se ha diferenciado de sus homólogos de gran capitalización al centrarse principalmente en la provisión de banda ancha en zonas rurales y en el menor énfasis en la televisión por cable/vídeo. La empresa también cuenta con importantes credenciales de inversión responsable. Stanley Black & Decker se ha esforzado en reducir su Cartera en los últimos años y centrarse en herramientas eléctricas y elementos de fijación, así como en marcas conocidas y con un buen apoyo de los distribuidores. La empresa también cuenta con sólidas credenciales de inversión responsable, incluida una estrategia bien definida y la divulgación de información al respecto. Las ventas incluyeron Lamb Weston, Natus Medical y EVO Payments.

De cara al futuro, la inflación ya parece haber superado su punto álgido en EE. UU. La reciente anticipación del mercado con respecto a los recortes de los tipos de interés en EE. UU. a finales de este año parece justificada y creemos que hay margen para presuponer más recortes. Entre los riesgos relativos a este punto de vista se incluye la persistente rigidez del mercado laboral estadounidense. Si el aumento de los salarios no se ralentiza significativamente, la Fed puede seguir subiendo los tipos. Por su parte, en Europa y Reino Unido, la bajada en los precios de la energía está incrementando la confianza de los consumidores, lo que debería trasladarse a la confianza de las empresas. El ahorro acumulado durante la pandemia no se ha reducido en la misma medida que en EE. UU., lo que mejora aún más la fortaleza relativa de los consumidores de Reino Unido y Europa. Si la inflación continúa ralentizándose y el enfoque en las subidas de tipos se reduce, las perspectivas económicas de ambas regiones deberían continuar mejorando a lo largo de 2023.

A nivel mundial, la política china de «cero COVID-19» constituyó un obstáculo constante en 2022. Ahora que se ha levantado esta política, los problemas de la cadena de suministro, que han sido una importante fuente de inflación y compresión de los márgenes en todo el mundo, deberían continuar menguando. La relajación de las restricciones también debería suponer un factor catalizador para los beneficios empresariales en todo el mundo. Probablemente las principales beneficiarias sean determinadas empresas de Asia y Europa, dada la importante demanda china de semiconductores y artículos de lujo.

Un flujo constante de datos económicos más halagüeños apunta, cada vez más, a un «aterrizaje suave» en EE. UU., la zona euro y Reino Unido, lo que implica una contracción de los beneficios menor de lo que se temía en un primer momento. Persiste la posibilidad de recesión en las principales economías este año, con los riesgos a la baja derivados del peligro de que la inflación salarial implique que los bancos centrales mantengan una postura excesivamente conservadora. Los riesgos al alza incluyen la posibilidad de que el ajuste monetario previo y la bajada en los precios de la energía, respectivamente, repercutan en la reducción de la inflación y el aumento de la confianza de los consumidores en mayor medida de lo previsto actualmente.

En general, creemos que aún hay valor en determinados activos de riesgo, especialmente las acciones y los bonos de aquellas empresas con flujos de efectivo relativamente defensivos.

El Consejo de Administración

20 de junio de 2023

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

Rendimiento

Rendimientos de las Carteras de Threadneedle (Lux) durante el ejercicio cerrado a 31 de marzo de 2023:

Cartera	1 año de rendimiento*	
	Clase de acciones principal	
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	ZU	-5,74%
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	ZE	-8,14%
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	ZE	-5,56%
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	ZE	-0,21%
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	ZE	-8,95%
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	AE	-7,58%
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	AU	-3,29%
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	ZU	-5,90%
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	AU	-2,67%
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	ZU	-2,81%
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	ZU	-4,76%
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	AE	-6,30%
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	AU	-7,20%
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	ZU	-4,27%
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	ZE	-13,54%
Threadneedle (Lux) - Global Focus	ZU	-8,44%
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	ZU	-14,13%
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	ZU	-3,61%
Threadneedle (Lux) - Global Select	ZU	-11,01%
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	ZE	-6,61%
Threadneedle (Lux) - American	ZU	-9,38%
Threadneedle (Lux) - American Select	ZU	-11,98%
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	ZU	-8,02%
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	ZU	-11,33%
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	ZU	-14,36%
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	ZU	-9,62%
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	ZU	-7,20%
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	AE	0,00%
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	ZE	3,57%
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	ZE	-12,46%
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	ZE	-10,49%
Threadneedle (Lux) - European Select	AE	2,27%
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	ZE	-5,25%
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	ZUP	-10,29%
Threadneedle (Lux) - Global Technology	ZU	-10,94%
Threadneedle (Lux) - UK Equities	ZG	6,01%
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	ZG	4,10%
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity**	ZU	-5,05%
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	ZU	-1,58%
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	ZE	-4,52%
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	ZE	-5,23%
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	ZE	2,20%
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	ZU	-14,12%
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	ZU	-11,74%
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	ZU	-10,07%

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

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

** Consulte la Nota 1.



Informe de auditoría

Para los Accionistas de
Threadneedle (Lux)

Nuestra opinión

En nuestra opinión, los estados financieros adjuntos ofrecen una imagen fiel de la situación financiera de Threadneedle (Lux) (el «Fondo») y de cada uno de sus subfondos a 31 de marzo de 2023, así como de los resultados de sus operaciones y de la evolución de su patrimonio neto durante el ejercicio finalizado en dicha fecha, con arreglo a las disposiciones legales y reglamentarias luxemburguesas relativas a la elaboración y presentación de los estados financieros.

Lo que hemos auditado

Los estados financieros del Fondo comprenden:

- el estado consolidado del patrimonio neto del Fondo y el estado del patrimonio neto de cada uno de los subfondos a 31 de marzo de 2023;
- el estado consolidado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto del Fondo y el estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto de cada uno de los subfondos durante el ejercicio cerrado;
- el estado de la cartera a 31 de marzo de 2023, y
- las notas a los estados financieros, que incluyen un resumen de las políticas contables significativas.

Fundamento de la opinión

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

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

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

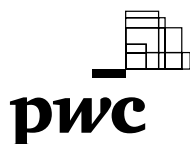
Información adicional

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

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

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

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



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

Responsabilidades del Consejo de Administración en relación con los estados financieros

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

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

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

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

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

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



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

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

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Representada por

Luxemburgo, 21 de junio de 2023

Serene Shtayyeh

Estados financieros agregados de Threadneedle (Lux)

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2, 18	16.556.964.184
Efectivo en el banco	2	179.121.736
Depósitos a plazo	2, 19	14.974.756
Por cobrar para la venta de inversiones		55.870.265
Suscripciones por cobrar		15.613.347
Interés por cobrar en swaps	2	7.298.009
Dividendo por cobrar en swaps	2	206.059
Interés y dividendos por cobrar, neto		46.016.138
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	15.232.547
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	3.092.456
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	410.364
Otros activos	20	18.554.447
Total de activos		16.913.354.308
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(45)
Opciones vendidas al valor de mercado	2, 12	(377.061)
Pagadero por inversiones adquiridas		(61.428.459)
Reembolsos pagaderos		(20.430.368)
Interés pagadero en swaps	2	(2.695.192)
Dividendo pagadero en swaps	2	(391.625)
Pago por adelantado cobrado en swaps	2	(57.508)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(1.868.149)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(8.496.516)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(10.099.036)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(14.232.573)
Impuesto por pagar	3	(25.824)
Otros pasivos		(2.504.147)
Total de pasivos		(122.606.503)
Total de patrimonio neto		16.790.747.805

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		20.624.583.517
Ingresos		
Dividendos, neto	2	202.616.366
Interés sobre bonos, neto	2	104.565.914
Interés bancario	2	3.691.072
Ingresos por dividendos en swaps		700
Ingresos por intereses en swaps		11.160.168
Ingresos por intereses en contratos de futuros		745.046
Otros ingresos		1.446.413
Total de ingresos		324.225.679
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(170.403.469)
Interés bancario	2	(744.885)
Dividendos pagados en swaps		(2.065.012)
Gastos por intereses en swaps		(28.319.317)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(707.995)
Gastos operativos	3, 5	(31.043.025)
Comisiones varias	4	(1.752)
Total de gastos		(233.285.455)
Ingresos netos de inversiones		90.940.224
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(456.297.502)
(Pérdida) neta realizada en swaps		(20.930.559)
Ganancia neta realizada en opciones		365.179
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(49.452.671)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		93.828.629
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(9.977.161)
(Pérdida) neta realizada en reembolso de impuestos		(68)
(Pérdida) neta realizada		(442.464.153)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(1.129.292.925)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		1.286.803
Cambio en la ganancia neta no realizada en opciones		24.932
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(9.946.578)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(35.560.181)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(1.173.487.949)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(1.525.011.878)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		4.757.553.155
Reembolsos de acciones		(6.729.787.549)
Dividendos	7	(51.678.952)
Total de movimientos de capital		(2.023.913.346)
Diferencias de cambio	2	(307.250.585)
Cambio en las inversiones cruzadas en las Carteras	18	22.340.097
Patrimonio neto al final del ejercicio		16.790.747.805

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	795.139.447
Efectivo en el banco	2	17.657.236
Por cobrar para la venta de inversiones		28.189.947
Suscripciones por cobrar		1.422.255
Interés por cobrar en swaps	2	108.086
Interés y dividendos por cobrar, neto		7.131.944
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	4.390.217
Total de activos		854.039.132
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(17.649.418)
Reembolsos pagaderos		(1.139.392)
Interés pagadero en swaps	2	(125.440)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(39.609)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(709.109)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(180.908)
Otros pasivos		(69.951)
Total de pasivos		(19.913.827)
Total de patrimonio neto		834.125.305

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	1.582.554,099
Clase AEH	1.232.059,977
Clase AKH	70,000
Clase ANH	788,000
Clase AU	850.426,238
Clase AUP	119.079,612
Clase DEC	84.212,698
Clase DEH	221.583,196
Clase DU	195.901,800
Clase DUP	54.784,490
Clase IEC	9.947.624,918
Clase IEH	1.820.155,984
Clase IEP	74,000
Clase IGC	616,000
Clase IGH	1.390.517,542
Clase IKH	80.378,000
Clase INH	785,000
Clase IU	137.275,508
Clase IUP	278.252,656
Clase NEC	458.377,092
Clase NEH	115.600,495
Clase NGC	37.860.342,347
Clase NGH	2.569.628,591
Clase NU	1.760.849,599
Clase NUP	115.563,000
Clase XEH	84,000
Clase XFH	92,000
Clase XGH	9.880.474,395
Clase XU	100,000
Clase ZEH	4.267.530,750
Clase ZFH	93,000
Clase ZGH	47.023,907
Clase ZU	619.444,588

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		512.857.786
Ingresos		
Dividendos, neto	2	412.859
Interés sobre bonos, neto	2	17.816.180
Interés bancario	2	453.223
Ingresos por intereses en swaps		2.439.164
Otros ingresos		15
Total de ingresos		21.121.441
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.711.049)
Interés bancario	2	(95.962)
Gastos por intereses en swaps		(2.677.206)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(230.322)
Gastos operativos	3, 5	(746.019)
Comisiones varias	4	(103)
Total de gastos		(5.460.661)
Ingresos netos de inversiones		15.660.780
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(46.351.334)
(Pérdida) neta realizada en swaps		(154.422)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(4.550.629)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		7.938.224
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(6.318.855)
(Pérdida) neta realizada		(49.437.016)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(9.766.807)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		1.447.518
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(2.781.504)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(2.383.300)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(13.484.093)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(47.260.329)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		519.839.894
Reembolsos de acciones		(139.300.262)
Dividendos	7	(12.011.784)
Total de movimientos de capital		368.527.848
Patrimonio neto al final del ejercicio		834.125.305

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	834.125.305	512.857.786	505.611.566

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEC	8,7274 ¹	9,8883 ¹	10,7710 ¹
Clase AEH	10,3414 ¹	11,3032 ¹	12,0116 ¹
Clase AKH	104,4023 ²	113,5556 ²	120,4075 ²
Clase ANH	9,3808 ³	10,1321 ³	10,6766 ³
Clase AU	12,0789	12,8471	13,5238
Clase AUP	10,2933	11,3413	12,2255
Clase DEC	7,8703 ¹	8,9807 ¹	9,8546 ¹
Clase DEH	9,7853 ¹	10,7729 ¹	11,5352 ¹
Clase DU	10,4059	11,1512	11,8269
Clase DUP	9,0388	10,0429	10,9155
Clase IEC	8,6087 ¹	9,7281 ¹	10,5732 ¹
Clase IEH	10,6546 ¹	11,6146 ¹	12,3172 ¹
Clase IEP	10,3441 ¹	11,0997 ¹	11,3003 ¹
Clase IGC	8,9969 ⁴	10,0201 ⁴	10,8060 ⁴
Clase IGH	11,5557 ⁴	12,4075 ⁴	13,0594 ⁴
Clase IKH	107,4977 ²	116,6619 ²	123,3018 ²
Clase INH	9,4739 ³	10,2127 ³	10,7232 ³
Clase IU	12,4379	13,1938	13,8609
Clase IUP	9,5805	10,5391	11,3406
Clase NEC	8,6991 ¹	9,8160 ¹	10,6452 ¹
Clase NEH	9,7048 ¹	10,5687 ¹	11,1857 ¹
Clase NGC	8,8347 ⁴	9,8219 ⁴	10,5683 ⁴
Clase NGH	10,2097 ⁴	10,9467 ⁴	11,4987 ⁴
Clase NU	10,8438	11,4874	12,0441
Clase NUP	9,6764	10,6244	11,4076
Clase XEH	8,5918 ¹	9,3311 ¹	9,8476 ¹
Clase XFH	8,4935 ⁵	9,2943 ⁵	9,8342 ⁵
Clase XGH	10,1116 ⁴	10,8105 ⁴	11,3216 ⁴
Clase XU	8,9631	9,4664	9,8938
Clase ZEH	9,7722 ¹	10,6577 ¹	11,2951 ¹
Clase ZFH	8,3827 ⁵	9,2148 ⁵	9,8121 ⁵
Clase ZGH	11,5218 ⁴	12,3692 ⁴	13,0122 ⁴
Clase ZU	12,4147	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 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	78.612.807
Efectivo en el banco	2	1.170.316
Por cobrar para la venta de inversiones		308.798
Suscripciones por cobrar		8.597
Interés por cobrar en swaps	2	11.207
Interés y dividendos por cobrar, neto		751.199
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	82.484
Otros activos		14.479
Total de activos		80.959.887
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(584.734)
Reembolsos pagaderos		(1)
Interés pagadero en swaps	2	(18.084)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(90.403)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(105.274)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(21.310)
Otros pasivos		(6.678)
Total de pasivos		(826.484)
Total de patrimonio neto		80.133.403

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	97.083,650
Clase ANH	825,000
Clase IE	1.129.373,041
Clase IEP	535.456,801
Clase INH	817,000
Clase XE	84,000
Clase XFH	92,000
Clase XGH	72,000
Clase XUH	100,000
Clase ZE	10.456,091
Clase ZFH	92,000
Clase 1E	6.012.518,163
Clase 1G	132.220,412
Clase 2E	2.138.298,351
Clase 2G	69,000
Clase 3G	478.605,918
Clase 4E	3.444,353
Clase 4G	3.089.310,148
Clase 8E	361.321,298
Clase 8G	139.623,318
Clase 9G	70,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		127.675.204
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	1.733.528
Interés bancario	2	5.206
Ingresos por intereses en swaps		122.573
Ingresos por intereses en contratos de futuros		9.203
Otros ingresos		13
Total de ingresos		1.870.523
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(296.214)
Interés bancario	2	(9.074)
Gastos por intereses en swaps		(325.287)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(5.189)
Gastos operativos	3, 5	(102.792)
Total de gastos		(738.556)
Ingresos netos de inversiones		1.131.967
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(9.759.473)
(Pérdida) neta realizada en swaps		(128.819)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(824.394)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		2.003.336
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		161.503
(Pérdida) neta realizada		(8.547.847)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(1.730.303)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		264.444
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		162.407
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(879.367)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(2.182.819)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(9.598.699)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		15.241.844
Reembolsos de acciones		(53.159.234)
Dividendos	7	(25.712)
Total de movimientos de capital		(37.943.102)
Patrimonio neto al final del ejercicio		80.133.403

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	80.133.403	127.675.204	157.999.564

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	9,2779	10,1243	10,7975
Clase ANH	9,1104 ¹	9,8409 ¹	10,4217 ¹
Clase IE	9,5112	10,3374	10,9588
Clase IEP	8,3544	9,2711	—
Clase INH	9,2841 ¹	9,9943 ¹	10,5063 ¹
Clase XE	8,8344	9,5748	10,1073
Clase XFH	8,7183 ²	9,5292 ²	10,0938 ²
Clase XGH	9,0433 ³	9,6585 ³	10,1315 ³
Clase XUH	9,1567 ⁴	9,6777 ⁴	10,1441 ⁴
Clase ZE	9,4441	10,2805	10,9309
Clase ZFH	8,5999 ²	9,4512 ²	10,0801 ²
Clase 1E	1,2624	1,3811	1,4728
Clase 1G	1,0210 ³	1,0743 ³	1,1548 ³
Clase 2E	9,5174	10,3490	10,9688
Clase 2G	9,2882 ³	9,7243 ³	10,3939 ³
Clase 3G	1,1557 ³	1,2099 ³	1,2941 ³
Clase 4E	9,6587	10,4502	11,0208
Clase 4G	9,7717 ³	10,1679 ³	10,8094 ³
Clase 8E	1,5938	1,7338	1,8383
Clase 8G	1,4020 ³	1,4667 ³	1,5677 ³
Clase 9G	9,2626 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 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	394.430.856
Efectivo en el banco	2	5.261.324
Por cobrar para la venta de inversiones		1.198.431
Suscripciones por cobrar		73.785
Interés y dividendos por cobrar, neto		5.669.608
Total de activos		406.634.004
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(2.538.738)
Reembolsos pagaderos		(435.842)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(481.773)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(80.768)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(279.988)
Otros pasivos		(48.234)
Total de pasivos		(3.865.343)
Total de patrimonio neto		402.768.661

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	342,253
Clase AKH	81,000
Clase ANH	807,000
Clase IE	5.849.877,990
Clase IEP	6.024.823,785
Clase IKH	80,000
Clase INH	798,000
Clase XE	77,000
Clase ZE	39.985,677
Clase ZEP	120.094,000
Clase 1E	12.090.868,369
Clase 1EP	1.046.935,471
Clase 1G	234.473,801
Clase 1GP	3.374,897
Clase 1UT	119.164,536
Clase 2E	30.299,719
Clase 2EP	2.884,000
Clase 2FH	6.834,346
Clase 2G	68,000
Clase 2GP	75,000
Clase 3E	2.912.931,952
Clase 3EP	1.845.688,854
Clase 3FC	6.523,913
Clase 3FH	27.927,294
Clase 3G	737.641,440
Clase 3GP	58.701,986
Clase 4E	299,277
Clase 4G	65,000
Clase 8E	1.894.692,429
Clase 8EP	5.555.524,634
Clase 8FH	32.415,940
Clase 8G	9.193,774
Clase 8GP	5.021,867
Clase 9E	3.471.833,446
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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		437.563.292
Ingresos		
Dividendos, neto	2	43.405
Interés sobre bonos, neto	2	15.324.515
Interés bancario	2	18.018
Ingresos por intereses en contratos de futuros		6.765
Otros ingresos		584
Total de ingresos		15.393.287
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(3.164.958)
Interés bancario	2	(14.800)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(3.292)
Gastos operativos	3, 5	(573.329)
Total de gastos		(3.756.379)
Ingresos netos de inversiones		11.636.908
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(17.251.364)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		2.810.337
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		388.516
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(492.964)
(Pérdida) neta realizada		(14.545.475)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(20.642.556)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(1.702.941)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(174.313)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(22.519.810)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(25.428.377)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		97.023.824
Reembolsos de acciones		(101.198.233)
Dividendos	7	(5.191.845)
Total de movimientos de capital		(9.366.254)
Patrimonio neto al final del ejercicio		402.768.661

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	402.768.661	437.563.292	601.800.632

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	10,1138	10,7825	11,2181
Clase AKH	95,0769 ¹	101,0117 ¹	104,9357 ¹
Clase ANH	9,6834 ²	10,2186 ²	10,5488 ²
Clase IE	10,2265	10,8198	11,1683
Clase IEP	8,4447	9,3088	9,9899
Clase IKH	97,5060 ¹	102,8317 ¹	105,8588 ¹
Clase INH	9,9336 ²	10,4003 ²	10,6479 ²
Clase XE	10,0295	10,5517	10,8140
Clase ZE	10,1957	10,7962	11,1495
Clase ZEP	8,4197	9,2891	9,9735
Clase 1E	9,9677	10,6162	11,0164
Clase 1EP	8,2294	9,1329	9,8573
Clase 1G	9,7341 ³	9,9707 ³	10,4297 ³
Clase 1GP	8,0597 ³	8,6028 ³	9,3569 ³
Clase 1UT	9,0587 ⁴	9,8080 ⁴	10,4752 ⁴
Clase 2E	10,2262	10,8306	11,1761
Clase 2EP	8,4747	9,3488	10,0267
Clase 2FH	10,0034 ⁵	10,6851 ⁵	11,0615 ⁵
Clase 2G	9,9771 ³	10,1723 ³	10,5872 ³
Clase 2GP	8,2855 ³	8,7869 ³	9,4995 ³
Clase 3E	10,2522	10,8528	11,1933
Clase 3EP	8,5292	9,4075	10,0878
Clase 3FC	8,3106 ⁵	9,2459 ⁵	9,9302 ⁵
Clase 3FH	10,0264 ⁵	10,7045 ⁵	11,0760 ⁵
Clase 3G	10,0112 ³	10,1921 ³	10,5964 ³
Clase 3GP	8,2268 ³	8,7267 ³	9,4331 ³
Clase 4E	10,5853	11,1273	11,3964
Clase 4G	10,5718 ³	10,6900 ³	11,0365 ³
Clase 8E	10,2071	10,8147	11,1642
Clase 8EP	8,4670	9,3469	10,0322
Clase 8FH	9,9839 ⁵	10,6685 ⁵	11,0486 ⁵
Clase 8G	9,9700 ³	10,1593 ³	10,5718 ³
Clase 8GP	8,2518 ³	8,7611 ³	9,4964 ³
Clase 9E	10,2702	10,8653	11,2018
Clase 9EP	8,5477	9,4214	10,0992
Clase 9FC	8,4020 ⁵	9,3284 ⁵	10,0032 ⁵
Clase 9FH	10,0637 ⁵	10,7239 ⁵	11,0918 ⁵
Clase 9G	10,0498 ³	10,2232 ³	10,6161 ³
Clase 9GP	8,3237 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 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	66.936.251
Efectivo en el banco	2	2.416.289
Por cobrar para la venta de inversiones		5.388
Interés y dividendos por cobrar, neto		810.769
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	34.475
Otros activos		3
Total de activos		70.203.175
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(178.128)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(14.019)
Otros pasivos		(6.159)
Total de pasivos		(198.306)
Total de patrimonio neto		70.004.869

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.739,363
Clase AEP	312,510
Clase AKH	82,000
Clase ANH	82,000
Clase IE	316.313,308
Clase IEP	93.668,000
Clase IGC	8,000
Clase IGH	7,000
Clase IKH	82,000
Clase INH	816,000
Clase XE	378,910
Clase XGC	50.662,801
Clase XGH	187.795,591
Clase ZE	8,200

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	101,8726	102,3925	103,3869
Clase AEP	88,7739	92,7591	97,3234
Clase AKH	102,7200 ¹	102,9071 ¹	103,6634 ¹
Clase ANH	105,2758 ²	104,6701 ²	104,8255 ²
Clase IE	103,3939	103,5067	104,0942
Clase IEP	90,1405	93,8051	97,9620
Clase IGC	93,3526 ³	95,6430 ³	99,1215 ³
Clase IGH	106,5129 ³	105,1039 ³	105,0674 ³
Clase IKH	103,6474 ¹	103,4243 ¹	103,8150 ¹
Clase INH	10,5733 ²	10,4750 ²	10,4542 ²
Clase XE	104,9403	104,6355	104,8093
Clase XGC	94,5441 ³	96,4461 ³	99,6631 ³
Clase XGH	108,3422 ³	106,2932 ³	105,8053 ³
Clase ZE	103,1073	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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		108.281.110
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	3.319.131
Interés bancario	2	9.946
Ingresos por intereses en swaps		13.875
Otros ingresos		266
Total de ingresos		3.343.218
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(106.261)
Interés bancario	2	(11.283)
Gastos operativos	3, 5	(86.350)
Total de gastos		(203.894)
Ingresos netos de inversiones		3.139.324
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(2.832.371)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(524.687)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(326.302)
(Pérdida) neta realizada		(3.683.360)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(1.908.158)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(10.110)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(433.051)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(2.351.319)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(2.895.355)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		36.495.370
Reembolsos de acciones		(71.328.517)
Dividendos	7	(547.739)
Total de movimientos de capital		(35.380.886)
Patrimonio neto al final del ejercicio		70.004.869

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	70.004.869	108.281.110	87.774.729

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	348.288.199
Efectivo en el banco	2	4.825.278
Suscripciones por cobrar		98.135
Interés y dividendos por cobrar, neto		2.567.109
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	358.560
Total de activos		356.137.281
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(584.563)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 9	(700.622)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(92.597)
Otros pasivos		(35.887)
Total de pasivos		(1.413.669)
Total de patrimonio neto		354.723.612

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.662.303,414
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	3.798.586,372
Clase IEP	2.541.188,149
Clase IFH	2.709.537,000
Clase IGH	73,000
Clase IKH	85,000
Clase INH	839,000
Clase ISC	100,000
Clase ISH	100,000
Clase IUC	83.135,804
Clase IUH	100,000
Clase LE	3.128.597,916
Clase NEP	111.878,641
Clase ZD	11.948.350,717
Clase ZE	2.657.416,258
Clase ZEP	581.208,140
Clase ZFH	3.489,000
Clase ZGC	5.535.129,078
Clase ZGH	808.400,965
Clase ZUH	1.592,141

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		397.016.310
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	5.157.630
Interés bancario	2	16.188
Ingresos por intereses en contratos de futuros		68.723
Otros ingresos		176
Total de ingresos		5.242.717
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.120.123)
Interés bancario	2	(15.165)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(42.821)
Gastos operativos	3, 5	(435.254)
Total de gastos		(1.613.363)
Ingresos netos de inversiones		3.629.354
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(19.638.314)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(364.930)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		5.048.821
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(535.930)
(Pérdida) neta realizada		(15.490.353)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(23.595.761)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(186.030)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(1.330.494)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(25.112.285)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(36.973.284)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		90.566.773
Reembolsos de acciones		(93.488.882)
Dividendos	7	(2.397.305)
Total de movimientos de capital		(5.319.414)
Patrimonio neto al final del ejercicio		354.723.612

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	354.723.612	397.016.310	329.896.379

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	8,4945	9,3388	9,9729
Clase AEP	8,2347	9,1831	9,9137
Clase AFH	8,4045 ¹	9,3172 ¹	9,9710 ¹
Clase AKH	85,5720 ²	93,6342 ²	99,5278 ²
Clase ANH	8,6990 ³	9,4392 ³	9,9762 ³
Clase ASC	8,4958 ⁴	9,3030 ⁴	9,9703 ⁴
Clase ASH	8,7327 ⁴	9,4156 ⁴	9,9784 ⁴
Clase AUC	8,5577 ⁵	9,3072 ⁵	9,9704 ⁵
Clase AUH	8,7920 ⁵	9,4257 ⁵	9,9792 ⁵
Clase ID	8,6319 ⁶	9,4617 ⁶	10,0874 ⁶
Clase IE	9,1890	10,0871	10,7559
Clase IEP	8,5025	9,4700	10,2088
Clase IFH	8,8540 ¹	9,8039 ¹	10,4909 ¹
Clase IGH	8,7057 ⁷	9,4189 ⁷	9,9775 ⁷
Clase IKH	86,7033 ²	94,8504 ²	100,7592 ²
Clase INH	8,9315 ³	9,6877 ³	10,2330 ³
Clase ISC	8,5268 ⁴	9,3048 ⁴	9,9703 ⁴
Clase ISH	8,7507 ⁴	9,4173 ⁴	9,9784 ⁴
Clase IUC	8,5688 ⁵	9,3112 ⁵	9,9711 ⁵
Clase IUH	8,8069 ⁵	9,4334 ⁵	9,9799 ⁵
Clase LE	9,2177	10,1185	10,7895
Clase NEP	857,1354	954,3554	1028,6742
Clase ZD	8,6148 ⁶	9,4477 ⁶	10,0776 ⁶
Clase ZE	9,1569	10,0568	10,7290
Clase ZEP	8,4565	9,4219	10,1616
Clase ZFH	8,8373 ¹	9,7912 ¹	10,4827 ¹
Clase ZGC	8,9178 ⁷	9,7886 ⁷	10,4934 ⁷
Clase ZGH	9,2550 ⁷	10,0164 ⁷	10,6218 ⁷
Clase ZUH	9,0273 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 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	128.688.046
Efectivo en el banco	2	7.809.696
Suscripciones por cobrar		133.695
Interés por cobrar en swaps	2	57.140
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.566.253
Total de activos		138.254.830
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(335.435)
Reembolsos pagaderos		(282.595)
Interés pagadero en swaps	2	(79.908)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(81.880)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(282.967)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(1.030.826)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(108.736)
Otros pasivos		(20.508)
Total de pasivos		(2.222.855)
Total de patrimonio neto		136.031.975

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.904.852,642
Clase AEP	762.311,440
Clase AKH	81,000
Clase ANH	802,000
Clase AUH	1.916,000
Clase DE	1.002.501,131
Clase DEP	1.338.522,221
Clase DUH	87,000
Clase IE	1.212.557,303
Clase INH	792,000
Clase ZE	85,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	27,7961	30,0762	31,0867
Clase AEP	12,9611	14,5050	15,3978
Clase AKH	95,0129 ¹	102,4839 ¹	105,8567 ¹
Clase ANH	9,7316 ²	10,4094 ²	10,6864 ²
Clase AUH	10,7647 ³	11,3753 ³	11,6784 ³
Clase DE	25,7676	28,0352	29,1371
Clase DEP	9,6172	10,8231	11,5522
Clase DUH	10,4683 ³	11,1164 ³	11,4774 ³
Clase IE	28,4329	30,5812	31,4196
Clase INH	9,9751 ²	10,6102 ²	10,8071 ²
Clase ZE	8,9875	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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		186.513.439
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	5.386.424
Interés bancario	2	44.306
Ingresos por intereses en swaps		720.066
Otros ingresos		23
Total de ingresos		6.150.819
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.416.880)
Interés bancario	2	(25.921)
Gastos por intereses en swaps		(1.880.145)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(37.280)
Gastos operativos	3, 5	(299.216)
Comisiones varias	4	(11)
Total de gastos		(3.659.453)
Ingresos netos de inversiones		2.491.366
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(10.906.882)
(Pérdida) neta realizada en swaps		(503.713)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(2.077.747)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		6.842.378
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(81.023)
(Pérdida) neta realizada		(6.726.987)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(7.276.139)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		1.641.802
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		724.694
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(4.556.742)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(9.466.385)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(13.702.006)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		43.810.406
Reembolsos de acciones		(79.772.815)
Dividendos	7	(817.049)
Total de movimientos de capital		(36.779.458)
Patrimonio neto al final del ejercicio		136.031.975

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	136.031.975	186.513.439	234.144.701

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	35.435.377
Efectivo en el banco	2	2.309.582
Suscripciones por cobrar		125.391
Interés y dividendos por cobrar, neto		453.160
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	310.224
Total de activos		38.633.734
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(2.632)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(35.259)
Otros pasivos		(5.362)
Total de pasivos		(43.253)
Total de patrimonio neto		38.590.481

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	544.222,112
Clase AEH	244.955,999
Clase AKH	80,000
Clase ANH	792,000
Clase ASH	7.673,293
Clase AU	100.013,506
Clase AUP	706.620,595
Clase DEC	40.726,837
Clase DEH	137.896,034
Clase DU	176.490,195
Clase IEC	258.086,000
Clase IEH	412.310,970
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

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEC	10,2032 ¹	11,3376 ¹	12,9505 ¹
Clase AEH	19,3369 ¹	20,5319 ¹	22,5246 ¹
Clase AKH	91,8018 ²	96,8799 ²	105,9916 ²
Clase ANH	9,3874 ³	9,8352 ³	10,6943 ³
Clase ASH	13,2054 ⁴	13,7388 ⁴	14,9331 ⁴
Clase AU	21,1802	21,9017	23,7934
Clase AUP	6,7900	7,3555	8,3207
Clase DEC	7,3807 ¹	8,2123 ¹	9,3896 ¹
Clase DEH	14,8160 ¹	15,7465 ¹	17,2924 ¹
Clase DU	16,4720	17,0502	18,5415
Clase IEC	7,8180 ¹	8,6232 ¹	9,7778 ¹
Clase IEH	27,6949 ¹	29,1681 ¹	31,7423 ¹
Clase IU	10,9376	11,2198	12,0940
Clase W	29,1323	30,0194	32,4983
Clase WEH	19,0279 ¹	20,1302 ¹	22,0058 ¹
Clase XUP	9,7987	10,5075	11,7343
Clase ZU	8,9259	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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		40.997.023
Ingresos		
Dividendos, neto	2	35.790
Interés sobre bonos, neto	2	1.831.211
Interés bancario	2	56.108
Ingresos por intereses en contratos de futuros		994
Otros ingresos		7
Total de ingresos		1.924.110
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(410.709)
Interés bancario	2	(3.104)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(17)
Gastos operativos	3, 5	(73.379)
Comisiones varias	4	(27)
Total de gastos		(487.236)
Ingresos netos de inversiones		1.436.874
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(1.046.490)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.345.800)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		575.768
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		6.632
(Pérdida) neta realizada		(1.809.890)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(1.896.734)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		4.692
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(192.573)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(2.084.615)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(2.457.631)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		5.374.104
Reembolsos de acciones		(4.754.070)
Dividendos	7	(568.945)
Total de movimientos de capital		51.089
Patrimonio neto al final del ejercicio		38.590.481

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	38.590.481	40.997.023	47.451.659

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	29.271.015
Efectivo en el banco	2	776.856
Suscripciones por cobrar		909
Interés y dividendos por cobrar, neto		377.006
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	14.559
Total de activos		30.440.345
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(1.615)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(34.991)
Otros pasivos		(5.174)
Total de pasivos		(41.780)
Total de patrimonio neto		30.398.565

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	46.569,415
Clase AEH	13.233,968
Clase AKH	82,000
Clase ANH	818,000
Clase ASH	272.273,409
Clase AU	47.418,475
Clase AUP	2.457.890,528
Clase DEH	20.054,742
Clase DU	18.318,766
Clase IEH	17.657,346
Clase IU	89,000
Clase SU	447,319
Clase SUP	41.856,044
Clase W	4.779,568
Clase XUP	89,000
Clase ZU	76,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEC	6,9476 ¹	8,0881 ¹	9,2177 ¹
Clase AEH	22,3440 ¹	24,6916 ¹	26,8384 ¹
Clase AKH	84,1314 ²	92,6360 ²	100,7566 ²
Clase ANH	8,5857 ³	9,3882 ³	10,1328 ³
Clase ASH	10,8469 ⁴	11,7200 ⁴	12,6134 ⁴
Clase AU	68,7292	73,6637	79,1694
Clase AUP	8,8962	10,0463	11,3182
Clase DEH	16,5765 ¹	18,3325 ¹	19,9465 ¹
Clase DU	48,7787	52,3331	56,3008
Clase IEH	24,8419 ¹	27,2289 ¹	29,3633 ¹
Clase IU	9,5573	10,1566	10,8581
Clase SU	27,5181	29,5378	31,7934
Clase SUP	8,5265	9,6466	10,8819
Clase W	57,6066	61,5266	65,8940
Clase XUP	8,8010	9,8204	10,9029
Clase ZU	11,1655	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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		35.175.906
Ingresos		
Dividendos, neto	2	38.265
Interés sobre bonos, neto	2	1.589.216
Interés bancario	2	32.309
Ingresos por intereses en contratos de futuros		213
Otros ingresos		1
Total de ingresos		1.660.004
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(410.301)
Interés bancario	2	(419)
Gastos operativos	3, 5	(71.257)
Comisiones varias	4	(27)
Total de gastos		(482.004)
Ingresos netos de inversiones		1.178.000
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(1.620.695)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(43.230)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		169.316
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		26.489
(Pérdida) neta realizada		(1.468.120)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(2.098.990)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(12.646)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(40.788)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(2.152.424)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(2.442.544)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		4.681.813
Reembolsos de acciones		(5.771.939)
Dividendos	7	(1.244.671)
Total de movimientos de capital		(2.334.797)
Patrimonio neto al final del ejercicio		30.398.565

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	30.398.565	35.175.906	45.515.822

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

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	57.453.232
Efectivo en el banco	2	1.445.478
Suscripciones por cobrar		769
Interés y dividendos por cobrar, neto		739.989
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	292.959
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	43.953
Total de activos		59.976.380
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(2.561)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(39.272)
Otros pasivos		(7.684)
Total de pasivos		(49.517)
Total de patrimonio neto		59.926.863

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	2.674.098,608
Clase AEH	216.289,827
Clase AKH	85,000
Clase ANH	835,000
Clase ASC	38.489,588
Clase ASH	14.267,454
Clase AU	336.766,572
Clase AUP	1.276.546,614
Clase DEH	84.792,632
Clase DU	120.201,933
Clase IE	173.632,512
Clase IEH	609.670,444
Clase XU	1.601.873,807
Clase XUP	184.900,129
Clase ZEH	15.664,000
Clase ZU	100,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEC	4,1720 ¹	4,6270 ¹	5,3304 ¹
Clase AEH	13,2333 ¹	13,9674 ¹	15,3274 ¹
Clase AKH	87,0471 ²	91,6130 ²	100,3800 ²
Clase ANH	8,9568 ³	9,3476 ³	10,1668 ³
Clase ASC	5,8342 ⁴	6,3399 ⁴	7,2335 ⁴
Clase ASH	10,1810 ⁴	10,5249 ⁴	11,4387 ⁴
Clase AU	16,6480	17,1041	18,5735
Clase AUP	4,5925	4,9572	5,6508
Clase DEH	10,2791 ¹	10,8662 ¹	11,9416 ¹
Clase DU	12,9190	13,2928	14,4565
Clase IE	9,6716 ¹	9,6301 ¹	9,8260 ¹
Clase IEH	15,3381 ¹	16,0698 ¹	17,5011 ¹
Clase XU	10,4820	10,6176	11,3638
Clase XUP	8,1382	8,6646	9,7360
Clase ZEH	9,8420 ¹	10,3126 ¹	11,2373 ¹
Clase ZU	9,0109	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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		91.108.424
Ingresos		
Dividendos, neto	2	57.551
Interés sobre bonos, neto	2	3.467.411
Interés bancario	2	64.408
Ingresos por intereses en contratos de futuros		896
Total de ingresos		3.590.266
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(489.696)
Interés bancario	2	(3.239)
Gastos operativos	3, 5	(122.092)
Comisiones varias	4	(6)
Total de gastos		(615.033)
Ingresos netos de inversiones		2.975.233
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(5.204.832)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.494.902)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(118.126)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(5.621)
(Pérdida) neta realizada		(6.823.481)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(677.353)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(41.225)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		105.716
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(612.862)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(4.461.110)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		6.041.953
Reembolsos de acciones		(31.718.963)
Dividendos	7	(1.043.441)
Total de movimientos de capital		(26.720.451)
Patrimonio neto al final del ejercicio		59.926.863

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	59.926.863	91.108.424	115.675.743

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	112.901.000
Efectivo en el banco	2	4.196.333
Suscripciones por cobrar		75.907
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.878.296
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	727.720
Otros activos		59
Total de activos		119.779.315
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(21.032)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(59.786)
Otros pasivos		(10.641)
Total de pasivos		(91.459)
Total de patrimonio neto		119.687.856

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	13.756,531
Clase AEH	18.063,550
Clase AKH	80,000
Clase ANH	802,000
Clase ASH	33.549,319
Clase AU	89.995,944
Clase AUP	210.482,229
Clase DEC	12.740,268
Clase DEH	19.397,812
Clase DU	35.828,686
Clase IEC	92,000
Clase IEH	1.910.014,092
Clase IKH	79,000
Clase INH	789,000
Clase ISC	395.606,558
Clase IU	3.951.994,297
Clase TEH	5.146,558
Clase XUP	90,000
Clase ZFH	82,000
Clase ZGH	58,000
Clase ZU	11.851,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		176.111.653
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	8.464.934
Interés bancario	2	150.271
Otros ingresos		1.800
Total de ingresos		8.617.005
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(870.643)
Interés bancario	2	(6.655)
Gastos operativos	3, 5	(159.807)
Total de gastos		(1.037.105)
Ingresos netos de inversiones		7.579.900
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(7.722.822)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(3.634.854)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(4)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		500.304
(Pérdida) neta realizada		(10.857.376)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(6.275.992)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(65.679)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(6.341.671)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(9.619.147)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		24.347.190
Reembolsos de acciones		(70.897.147)
Dividendos	7	(254.693)
Total de movimientos de capital		(46.804.650)
Patrimonio neto al final del ejercicio		119.687.856

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	119.687.856	176.111.653	210.577.608

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEC	10,3123 ¹	11,6239 ¹	12,5108 ¹
Clase AEH	30,0326 ¹	32,0422 ¹	32,7344 ¹
Clase AKH	96,4111 ²	102,5833 ²	104,5429 ²
Clase ANH	9,7797 ³	10,3445 ³	10,4867 ³
Clase ASH	14,4742 ⁴	15,1131 ⁴	15,3006 ⁴
Clase AU	36,5811	37,8984	38,3288
Clase AUP	11,4723	12,5588	13,3803
Clase DEC	7,7584 ¹	8,7567 ¹	9,4471 ¹
Clase DEH	21,5485 ¹	23,0395 ¹	23,5798 ¹
Clase DU	26,2017	27,1995	27,5635
Clase IEC	7,6761 ¹	8,5796 ¹	9,1542 ¹
Clase IEH	30,3547 ¹	32,1076 ¹	32,5065 ¹
Clase IKH	99,5072 ²	104,9731 ²	105,9750 ²
Clase INH	10,1091 ³	10,5900 ³	10,6374 ³
Clase ISC	8,5672 ⁴	9,3701 ⁴	—
Clase IU	11,5402	11,8564	11,8836
Clase TEH	10,8358 ¹	11,4601 ¹	11,6033 ¹
Clase XUP	9,6526	10,4751	10,9963
Clase ZFH	10,2174 ⁵	10,8909 ⁵	11,0919 ⁵
Clase ZGH	11,5898 ⁶	12,0954 ⁶	12,2029 ⁶
Clase ZU	13,4244	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 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	36.763.905
Efectivo en el banco	2	1.475.420
Depósitos a plazo	2, 19	3.646.810
Por cobrar para la venta de inversiones		356.878
Suscripciones por cobrar		300.513
Interés y dividendos por cobrar, neto		349.037
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	197.394
Otros activos		193
Total de activos		43.090.150
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(42.445)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(12.117)
Otros pasivos		(4.342)
Total de pasivos		(58.904)
Total de patrimonio neto		43.031.246

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	88.205,787
Clase AKH	82,000
Clase AS	1.486,300
Clase ASC	5.226,779
Clase ASH	42.594,720
Clase AU	97.044,685
Clase AUP	554.163,295
Clase AVC	100,000
Clase AVH	100,000
Clase DEH	60.905,790
Clase IEH	1.340.239,593
Clase IGH	54,000
Clase ISH	97,000
Clase IU	41.197,659
Clase XU	1.471.726,985
Clase ZU	42.070,000
Clase ZUP	92,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		57.454.754
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	1.780.826
Interés bancario	2	103.594
Ingresos por intereses en contratos de futuros		436
Otros ingresos		1
Total de ingresos		1.884.857
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(148.344)
Interés bancario	2	(2.526)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(95)
Gastos operativos	3, 5	(62.837)
Total de gastos		(213.802)
Ingresos netos de inversiones		1.671.055
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(2.488.096)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(516.683)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		243.031
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(65.248)
(Pérdida) neta realizada		(2.826.996)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(2.205.668)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		22.103
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(66.057)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(2.249.622)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(3.405.563)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		5.149.313
Reembolsos de acciones		(15.922.622)
Dividendos	7	(244.636)
Total de movimientos de capital		(11.017.945)
Patrimonio neto al final del ejercicio		43.031.246

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	43.031.246	57.454.754	68.819.183

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	10,2955 ¹	11,1546 ¹	11,9604 ¹
Clase AKH	89,4224 ²	96,2683 ²	102,8729 ²
Clase AS	10,2715 ³	11,0373 ³	11,6426 ³
Clase ASC	8,9050 ³	9,8517 ³	10,8641 ³
Clase ASH	11,6360 ³	12,3554 ³	13,1327 ³
Clase AU	11,9774	12,6431	13,4327
Clase AUP	9,3483	10,2865	11,3378
Clase AVC	8,4255 ⁴	9,3713 ⁴	10,3878 ⁴
Clase AVH	10,1977 ⁴	10,8855 ⁴	11,6150 ⁴
Clase DEH	9,9699 ¹	10,8323 ¹	11,6515 ¹
Clase IEH	10,8634 ¹	11,6988 ¹	12,4708 ¹
Clase IGH	11,7523 ⁵	12,4646 ⁵	13,1827 ⁵
Clase ISH	12,3266 ³	13,0166 ³	13,7420 ³
Clase IU	12,6617	13,2854	14,0310
Clase XU	12,0581	12,6016	13,2554
Clase ZU	12,6515	13,2836	14,0429
Clase ZUP	9,0572	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.

Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	441.234
Efectivo en el banco	2	70.958
Interés y dividendos por cobrar, neto		3.268
Total de activos		515.460
Pasivos		
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(93.528)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(10.421)
Otros pasivos		(3.604)
Total de pasivos		(107.553)
Total de patrimonio neto		407.907

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	19.286,564
Clase DE	19.192,968

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	10,7963	11,5219	11,3495
Clase AEP [#]	—	11,4169	11,2520
Clase DE	10,4040	11,1869	11,1024
Clase IE [#]	—	11,8436	11,5850
Clase IEP [#]	—	11,7510	11,4878
Clase LE [#]	—	11,9147	11,6371
Clase LEP [#]	—	11,8287	11,5394
Clase ZE [#]	—	11,7517	11,5196
Clase ZEP [#]	—	11,6583	11,4285

[#] Consulte la Nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		33.700.769
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	88.346
Interés bancario	2	35.040
Otros ingresos		4
Total de ingresos		123.390
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(184.331)
Interés bancario	2	(5.195)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(5.100)
Gastos operativos	3, 5	(66.381)
Total de gastos		(261.007)
(Pérdida) neta de inversiones		(137.617)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		2.217.490
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		123.337
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(555.793)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(84.550)
Ganancia neta realizada		1.700.484
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(3.594.581)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(87.400)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(352.619)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(4.034.600)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(2.471.733)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		4.061.917
Reembolsos de acciones		(34.883.044)
Dividendos	7	(2)
Total de movimientos de capital		(30.821.129)
Patrimonio neto al final del ejercicio		407.907

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	407.907	33.700.769	31.879.013

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	32.411.362
Efectivo en el banco	2	2.163.864
Depósitos a plazo	2, 19	1.411.301
Suscripciones por cobrar		87
Interés por cobrar en swaps	2	9.759
Interés y dividendos por cobrar, neto		122.413
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	183.181
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	96.637
Otros activos		9.632
Total de activos		36.408.236
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(45)
Pagadero por inversiones adquiridas		(278.117)
Reembolsos pagaderos		(2.824)
Interés pagadero en swaps	2	(4.880)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(314.687)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(39.443)
Otros pasivos		(8.278)
Total de pasivos		(648.274)
Total de patrimonio neto		35.759.962

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	61.474,388
Clase AEH	279.961,193
Clase AKH	74,000
Clase AU	236.279,127
Clase AUP	277.797,449
Clase DEH	94.209,106
Clase DU	162.881,488
Clase IEH	11.053,874
Clase IGH	24,000
Clase IU	264.680,590
Clase W	5.683,832
Clase ZU	100,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEC	11,8519 ¹	13,3778 ¹	14,0361 ¹
Clase AEH	24,9127 ¹	27,7017 ¹	28,7145 ¹
Clase AKH	97,4964 ²	108,2209 ²	112,0590 ²
Clase AU	39,0428	42,0736	43,1173
Clase AUP	14,3202	15,6687	16,2512
Clase DEH	17,7549 ¹	19,8712 ¹	20,7320 ¹
Clase DU	25,2586	27,3970	28,2598
Clase IEH	9,8952 ¹	10,9147 ¹	11,2478 ¹
Clase IGH	26,3907 ³	28,7174 ³	29,3439 ³
Clase IU	29,3576	31,4158	31,9704
Clase W	64,1635	69,2136	71,0014
Clase ZU	8,8409	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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		44.823.256
Ingresos		
Dividendos, neto	2	272.012
Interés sobre bonos, neto	2	206.149
Interés bancario	2	81.775
Ingresos por intereses en swaps		183.554
Total de ingresos		743.490
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(506.399)
Interés bancario	2	(17.379)
Gastos por intereses en swaps		(32.621)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(9.091)
Gastos operativos	3, 5	(105.866)
Total de gastos		(671.356)
Ingresos netos de inversiones		72.134
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		1.725.976
Ganancia neta realizada en swaps		62.731
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.718.964)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		905.155
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(300.854)
(Pérdida) neta realizada en reembolso de impuestos		(138)
Ganancia neta realizada		673.906
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(5.199.802)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(183.126)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		203.320
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		497.655
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(4.681.953)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(3.935.913)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		5.416.481
Reembolsos de acciones		(10.467.659)
Dividendos	7	(76.203)
Total de movimientos de capital		(5.127.381)
Patrimonio neto al final del ejercicio		35.759.962

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	35.759.962	44.823.256	58.030.727

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	102.806.032
Efectivo en el banco	2	6.486.496
Por cobrar para la venta de inversiones		312.977
Suscripciones por cobrar		67.102
Interés por cobrar en swaps	2	1.761
Interés y dividendos por cobrar, neto		650.054
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	105.827
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	366.411
Otros activos		42.312
Total de activos		110.838.972
Pasivos		
Opciones vendidas al valor de mercado	2, 12	(377.061)
Pagadero por inversiones adquiridas		(555.674)
Reembolsos pagaderos		(212.242)
Interés pagadero en swaps	2	(2.161)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(5.730)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(132.294)
Otros pasivos		(36.910)
Total de pasivos		(1.322.072)
Total de patrimonio neto		109.516.900

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	56.817,964
Clase AEC	4.181.222,806
Clase AEH	609.190,670
Clase AEP	2.210.186,318
Clase AS	100,000
Clase ASC	16.069,559
Clase ASH	639,122
Clase ASP	5.324,095
Clase AU	374.518,833
Clase AUM	40.835,903
Clase AUP	940.558,501
Clase DEC	2.242.637,357
Clase DEH	234.640,747
Clase DEP	230.012,621
Clase DU	333.249,275
Clase DUP	681.121,774
Clase ZE	73,000
Clase ZEC	93,000
Clase ZEH	72.750,621
Clase ZFH	85,000
Clase ZU	4.008,949
Clase ZUP	100,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		142.600.557
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.540.862
Interés sobre bonos, neto	2	1.933.158
Interés bancario	2	143.405
Ingresos por intereses en swaps		53.261
Ingresos por intereses en contratos de futuros		175.420
Otros ingresos		113
Total de ingresos		3.846.219
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.696.089)
Interés bancario	2	(15.795)
Gastos por intereses en swaps		(62.971)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(86.425)
Gastos operativos	3, 5	(343.793)
Comisiones varias	4	(1)
Total de gastos		(2.205.074)
Ingresos netos de inversiones		1.641.145
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(7.203.234)
Ganancia neta realizada en swaps		9.167
Ganancia neta realizada en opciones		365.179
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		1.234.162
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(88.402)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(1.088.305)
(Pérdida) neta realizada		(6.771.433)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(5.786.684)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		20.687
Cambio en la ganancia neta no realizada en opciones		24.932
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(740.533)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(310.150)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(6.791.748)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(11.922.036)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		10.342.076
Reembolsos de acciones		(27.710.504)
Dividendos	7	(3.793.193)
Total de movimientos de capital		(21.161.621)
Patrimonio neto al final del ejercicio		109.516.900

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	109.516.900	142.600.557	175.207.757

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	11,5541 ¹	11,8451 ¹	11,1664 ¹
Clase AEC	6,8440 ¹	7,7505 ¹	8,1761 ¹
Clase AEH	16,5540 ¹	17,9084 ¹	18,0258 ¹
Clase AEP	8,7671 ¹	9,4049 ¹	9,2989 ¹
Clase AS	10,4496 ²	11,1952 ²	11,0946 ²
Clase ASC	8,2370 ²	9,1249 ²	9,5406 ²
Clase ASH	10,4766 ²	11,0880 ²	11,0586 ²
Clase ASP	8,1638 ²	9,1289 ²	9,4660 ²
Clase AU	19,5536	20,5295	20,4434
Clase AUM	8,8613	9,7159	10,1632
Clase AUP	8,3706	9,1953	9,6048
Clase DEC	6,4163 ¹	7,3229 ¹	7,7834 ¹
Clase DEH	9,3527 ¹	10,1960 ¹	10,3401 ¹
Clase DEP	8,1540 ¹	8,8122 ¹	8,7797 ¹
Clase DU	11,9278	12,6175	12,6591
Clase DUP	7,5370	8,3429	8,7793
Clase ZE	11,8898 ¹	12,1429 ¹	11,3949 ¹
Clase ZEC	7,6027 ¹	8,5885 ¹	9,0180 ¹
Clase ZEH	10,0654 ¹	10,8301 ¹	10,8464 ¹
Clase ZFH	9,8346 ³	10,6752 ³	10,7251 ³
Clase ZU	11,5140	12,0281	11,9183
Clase ZUP	8,4589	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 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	4.832.284
Efectivo en el banco	2	253.059
Por cobrar para la venta de inversiones		479
Interés y dividendos por cobrar, neto		21.959
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	816
Otros activos	20	33.653
Total de activos		5.142.250
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(2.555)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(2.896)
Otros pasivos		(603)
Total de pasivos		(6.054)
Total de patrimonio neto		5.136.196

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	100,000
Clase AEC	100,000
Clase AEH	9.236,091
Clase AU	100,000
Clase AUP	100,000
Clase IE	100,000
Clase IEH	100,000
Clase IG	100,000
Clase IU	100,000
Clase LE	97.000,000
Clase LG	100,000
Clase XU	100,000
Clase ZE	100,000
Clase ZEC	100,000
Clase ZEH	100,000
Clase ZU	498.187,100
Clase ZUP	100,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	8,6814 ¹	10,1300 ¹	13,1238 ¹
Clase AEC	7,3738 ¹	9,3082 ¹	13,0744 ¹
Clase AEH	7,6264 ¹	9,4264 ¹	13,1208 ¹
Clase AU	8,0834	9,6534	13,2113
Clase AUP	7,8220	9,5286	13,1684
Clase IE	8,8953 ¹	10,2725 ¹	13,1851 ¹
Clase IEH	7,8154 ¹	9,5604 ¹	13,1794 ¹
Clase IG	8,5458 ²	9,4923 ²	12,2808 ²
Clase IU	8,2860	9,7979	13,2780
Clase LE	8,9650 ¹	10,3264 ¹	13,2092 ¹
Clase LG	8,6130 ²	9,5344 ²	12,2989 ²
Clase XU	8,4163	9,8914	13,3214
Clase ZE	8,8591 ¹	10,2464 ¹	13,1739 ¹
Clase ZEC	7,5103 ¹	9,4153 ¹	13,1241 ¹
Clase ZEH	7,7713 ¹	9,5353 ¹	13,1675 ¹
Clase ZU	8,2349	9,7613	13,2623
Clase ZUP	7,9637	9,6378	13,2192

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		6.094.426
Ingresos		
Dividendos, neto	2	81.634
Interés bancario	2	4.983
Total de ingresos		86.617
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(35.610)
Gastos operativos	3, 5	(9.711)
Total de gastos		(45.321)
Ingresos netos de inversiones		41.296
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(821.291)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(5.487)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(3.106)
(Pérdida) neta realizada		(829.884)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(165.251)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(240)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(165.491)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(954.079)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		508
Reembolsos de acciones		(4.598)
Dividendos	7	(61)
Total de movimientos de capital		(4.151)
Patrimonio neto al final del ejercicio		5.136.196

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	5.136.196	6.094.426	9.412.889

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.853.829.794
Efectivo en el banco	2	3.068.643
Por cobrar para la venta de inversiones		7.319.697
Suscripciones por cobrar		1.123.378
Interés y dividendos por cobrar, neto		2.437.986
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	1.869.364
Otros activos	20	739.993
Total de activos		1.870.388.855
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(4.857.089)
Reembolsos pagaderos		(1.960.748)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.737.830)
Otros pasivos		(237.785)
Total de pasivos		(8.793.452)
Total de patrimonio neto		1.861.595.403

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	1.427.641,871
Clase AEP	4.022.716,513
Clase ASH	88.568,115
Clase AU	6.704.765,850
Clase AUP	34.292,333
Clase DEH	737.762,471
Clase DU	1.516.437,783
Clase IE	5.387.913,894
Clase IEH	3.964.562,783
Clase IU	25.682.526,076
Clase IUP	51.356,992
Clase W	4.738,351
Clase XU	2.762.066,512
Clase ZE	4.434.997,017
Clase ZEH	243.060,968
Clase ZEP	3.744.094,085
Clase ZFH	75,000
Clase ZG	608.086,828
Clase ZU	663.955,692

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		2.405.094.415
Ingresos		
Dividendos, neto	2	18.797.252
Interés bancario	2	175.757
Otros ingresos		370
Total de ingresos		18.973.379
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(20.848.148)
Interés bancario	2	(48.665)
Gastos operativos	3, 5	(3.565.898)
Total de gastos		(24.462.711)
(Pérdida) neta de inversiones		(5.489.332)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(106.284.065)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(10.540.289)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		370.792
(Pérdida) neta realizada en reembolso de impuestos		(188)
(Pérdida) neta realizada		(116.453.750)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(126.431.618)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(4.820)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(126.436.438)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(248.379.520)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		587.900.273
Reembolsos de acciones		(881.035.864)
Dividendos	7	(1.983.901)
Total de movimientos de capital		(295.119.492)
Patrimonio neto al final del ejercicio		1.861.595.403

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	1.861.595.403	2.405.094.415	1.676.310.766

Threadneedle (Lux) - Global Focus

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	52,8087 ¹	60,3566 ¹	57,4173 ¹
Clase AEP	19,5948 ¹	21,3430 ¹	19,1012 ¹
Clase ASH [#]	9,9814 ²	—	—
Clase AU	93,4160	102,8279	96,5311
Clase AUP	14,6282	16,3197	15,4283
Clase DEH	37,5629 ¹	43,2512 ¹	41,4515 ¹
Clase DU	47,8351	53,0512	50,1776
Clase IE	19,5074 ¹	20,7896 ¹	18,3198 ¹
Clase IEH	14,4633 ¹	16,3912 ¹	15,4630 ¹
Clase IU	19,4038	21,1779	19,7127
Clase IUP	15,2319	16,8469	15,7922
Clase W	142,8921	157,1578	147,4604
Clase XU	22,8844	24,7993	22,8996
Clase ZE	21,9599 ¹	23,4189 ¹	20,6574 ¹
Clase ZEH	10,4027 ¹	11,7932 ¹	11,1310 ¹
Clase ZEP	20,4842 ¹	22,1355 ¹	19,6580 ¹
Clase ZFH	10,3229 ³	11,7503 ³	11,1109 ³
Clase ZG	22,5389 ⁴	23,1166 ⁴	20,5546 ⁴
Clase ZU	23,4612	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 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	342.123.884
Efectivo en el banco	2	8.086.511
Por cobrar para la venta de inversiones		17.506
Suscripciones por cobrar		1.108
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.235.304
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	20.726
Otros activos	20	2.330.687
Total de activos		353.815.726
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(11.223)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(69.895)
Otros pasivos		(28.611)
Total de pasivos		(109.729)
Total de patrimonio neto		353.705.997

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	16.393,606
Clase AU	34.541,373
Clase DEH	47.894,407
Clase DU	63.604,139
Clase IE	33.292,215
Clase IEH	41.024,410
Clase IU	4.747.899,224
Clase XU	29.731.456,869
Clase ZU	127.516,669
Clase 1E	3.134.661,702
Clase 1U	2.236.201,250
Clase 2E	2.016.097,894
Clase 2U	53,000
Clase 8E	390,015
Clase 8U	1.640.029,266

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	24,5593 ¹	29,8455 ¹	42,3802 ¹
Clase AU	41,7317	48,9816	68,3931
Clase DEH	17,2383 ¹	21,1131 ¹	30,1969 ¹
Clase DU	28,7652	34,0169	47,8562
Clase IE	10,4209 ¹	11,8421 ¹	15,5210 ¹
Clase IEH	15,0434 ¹	18,1198 ¹	25,5028 ¹
Clase IU	10,1101	11,7660	16,2895
Clase XU	8,8771	10,2512	—
Clase ZU	9,6637	11,2539	15,5962
Clase 1E	1,2435 ¹	1,4248 ¹	1,8817 ¹
Clase 1U	1,3508	1,5851	2,2113
Clase 2E	11,4983 ¹	13,0947 ¹	17,1886 ¹
Clase 2U	11,0215	12,8579	17,8242
Clase 8E	1,3737 ¹	1,5656 ¹	2,0559 ¹
Clase 8U	1,4931	1,7421	2,4165

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		134.106.881
Ingresos		
Dividendos, neto	2	4.254.148
Interés bancario	2	233.375
Otros ingresos		586.590
Total de ingresos		5.074.113
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(943.672)
Interés bancario	2	(5.003)
Gastos operativos	3, 5	(352.555)
Total de gastos		(1.301.230)
Ingresos netos de inversiones		3.772.883
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(29.933.966)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(116.470)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(198.004)
(Pérdida) neta realizada		(30.248.440)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(14.528.395)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(1.848)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(14.530.243)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(41.005.800)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		302.224.814
Reembolsos de acciones		(41.619.898)
Total de movimientos de capital		260.604.916
Patrimonio neto al final del ejercicio		353.705.997

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	353.705.997	134.106.881	170.104.097

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	167.602.520
Efectivo en el banco	2	303.605
Suscripciones por cobrar		153.508
Interés y dividendos por cobrar, neto		380.373
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	54.167
Otros activos	20	155.360
Total de activos		168.649.533
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(86.331)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(142.165)
Otros pasivos		(24.022)
Total de pasivos		(252.518)
Total de patrimonio neto		168.397.015

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	326,000
Clase AUP	84,000
Clase DEC	77,000
Clase DUP	49.298,838
Clase IU	218.786,000
Clase TE	66,000
Clase ZU	75,000
Clase 1E	1.625.996,038
Clase 1EP	1.424.333,754
Clase 1SC	434.065,976
Clase 1SH	36.070,165
Clase 1ST	80.840,493
Clase 1U	321.124,663
Clase 1UP	396.270,792
Clase 1VT	5.746,136
Clase 2E	760.261,534
Clase 2EP	72,000
Clase 2U	75,000
Clase 2UP	82,000
Clase 3E	140.997,353
Clase 3EP	7.208.679,900
Clase 3U	9.575,003
Clase 3UP	20.172,115
Clase 8E	119.354,234
Clase 8EP	236,808
Clase 8U	8.233,578
Clase 8UP	105.481,704
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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		215.918.713
Ingresos		
Dividendos, neto	2	4.283.771
Interés bancario	2	44.133
Otros ingresos		320
Total de ingresos		4.328.224
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.740.683)
Interés bancario	2	(1.041)
Gastos operativos	3, 5	(299.467)
Total de gastos		(2.041.191)
Ingresos netos de inversiones		2.287.033
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(2.724.776)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(33.831)
(Pérdida) neta realizada		(2.758.607)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(9.308.678)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		7.909
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(9.300.769)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(9.772.343)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		18.729.941
Reembolsos de acciones		(52.847.962)
Dividendos	7	(3.631.334)
Total de movimientos de capital		(37.749.355)
Patrimonio neto al final del ejercicio		168.397.015

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	168.397.015	215.918.713	220.612.038

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEC	9,7529 ¹	10,9032 ¹	10,8646 ¹
Clase AUP	10,8746	11,7207	11,5197
Clase DEC	9,5329 ¹	10,7205 ¹	10,7367 ¹
Clase DUP	10,6321	11,5104	11,3689
Clase IU	13,0416	13,5078	12,8194
Clase TE	13,6889 ¹	13,8508 ¹	12,4675 ¹
Clase ZU	12,9971	13,4839	12,8038
Clase 1E	13,3500 ¹	13,6005 ¹	12,3011 ¹
Clase 1EP	11,5606 ¹	12,1468 ¹	11,2887 ¹
Clase 1SC	10,5266 ²	11,4630 ²	11,2960 ²
Clase 1SH	12,1716 ²	12,8545 ²	12,3246 ²
Clase 1ST	10,5621 ²	11,4849 ²	11,3150 ²
Clase 1U	12,6598	13,2084	12,6191
Clase 1UP	10,9443	11,7772	11,5601
Clase 1VT	10,0908 ³	11,1290 ³	11,0336 ³
Clase 2E	13,9684 ¹	14,1440 ¹	12,7149 ¹
Clase 2EP	11,9014 ¹	12,4187 ¹	11,4725 ¹
Clase 2U	13,0009	13,4831	12,8080
Clase 2UP	11,2898	12,0644	11,7699
Clase 3E	13,8013 ¹	13,9552 ¹	12,5276 ¹
Clase 3EP	11,9519 ¹	12,4603 ¹	11,4904 ¹
Clase 3U	13,0876	13,5528	12,8514
Clase 3UP	11,3470	12,1163	11,8020
Clase 8E	13,6859 ¹	13,8635 ¹	12,4677 ¹
Clase 8EP	11,8295 ¹	12,3593 ¹	11,4170 ¹
Clase 8U	12,9818	13,4674	12,7934
Clase 8UP	11,2439	12,0275	11,7367
Clase 9E	13,8492 ¹	13,9945 ¹	12,5555 ¹
Clase 9EP	11,9987 ¹	12,4988 ¹	11,5171 ¹
Clase 9U	13,1489	13,6064	12,8935
Clase 9UP	11,3777	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 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	581.342.531
Efectivo en el banco	2	1.435.988
Suscripciones por cobrar		56.476
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.108.005
Otros activos	20	219.772
Total de activos		584.162.772
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(10.335.752)
Reembolsos pagaderos		(393.923)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(595.941)
Otros pasivos		(70.749)
Total de pasivos		(11.396.365)
Total de patrimonio neto		572.766.407

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IU	63.166,202
Clase ZU	1.378,995
Clase 1E	22.052.128,904
Clase 1U	64.240.462,842
Clase 2E	308.507,753
Clase 2U	2.988.061,507
Clase 3U	9.525.570,701
Clase 8E	63.716,592
Clase 8U	22.466.748,119
Clase 9U	2.167.420,935

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase IU	13,9844	15,7040	15,4100
Clase ZU	13,9429	15,6678	15,3846
Clase 1E	3,5100 ¹	3,8796 ¹	3,6305 ¹
Clase 1U	3,8129	4,3160	4,2662
Clase 2E	14,6149 ¹	16,0460 ¹	14,9212 ¹
Clase 2U	13,9132	15,6533	15,3787
Clase 3U	4,1009	4,6059	4,5175
Clase 8E	5,1839 ¹	5,6972 ¹	5,3010 ¹
Clase 8U	5,6311	6,3379	6,2292
Clase 9U	14,0355	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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		609.163.562
Ingresos		
Dividendos, neto	2	6.874.698
Interés bancario	2	61.913
Otros ingresos		43
Total de ingresos		6.936.654
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(6.694.640)
Interés bancario	2	(8.927)
Gastos operativos	3, 5	(807.216)
Total de gastos		(7.510.783)
(Pérdida) neta de inversiones		(574.129)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(6.034.796)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		5.227
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		99.814
(Pérdida) neta realizada		(5.929.755)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(60.066.305)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(60.066.305)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(66.570.189)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		137.576.486
Reembolsos de acciones		(107.403.452)
Total de movimientos de capital		30.173.034
Patrimonio neto al final del ejercicio		572.766.407

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	572.766.407	609.163.562	605.915.496

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.685.070.914
Efectivo en el banco	2	1.342.668
Por cobrar para la venta de inversiones		1.360.576
Suscripciones por cobrar		6.889.249
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.281.063
Otros activos	20	350.195
Total de activos		1.696.294.665
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(6.219.076)
Reembolsos pagaderos		(1.427.461)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(53.987)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.645.618)
Otros pasivos		(375.818)
Total de pasivos		(9.721.960)
Total de patrimonio neto		1.686.572.705

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	14.522.792,970
Clase AEP	22.888.881,947
Clase AK	1.051.687,406
Clase AUP	68.493,848
Clase DE	1.734.284,581
Clase IE	5.790.708,485
Clase IEP	2.540.195,052
Clase NE	6.060.120,000
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	1.992.369,249
Clase ZFH	328.953,539
Clase ZG	1.663.920,776
Clase ZGH	66.405,043
Clase ZU	5.551.812,150

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		1.892.718.184
Ingresos		
Dividendos, neto	2	12.205.381
Interés bancario	2	81.580
Otros ingresos		1.957
Total de ingresos		12.288.918
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(19.137.829)
Interés bancario	2	(7.954)
Gastos operativos	3, 5	(4.397.196)
Total de gastos		(23.542.979)
(Pérdida) neta de inversiones		(11.254.061)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(109.239.887)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		1.028.891
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		684.503
(Pérdida) neta realizada		(107.526.493)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(15.931.848)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(337.793)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(16.269.641)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(135.050.195)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		420.543.783
Reembolsos de acciones		(488.530.829)
Dividendos	7	(3.108.238)
Total de movimientos de capital		(71.095.284)
Patrimonio neto al final del ejercicio		1.686.572.705

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	1.686.572.705	1.892.718.184	2.108.588.124

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	42,3307	45,6690	47,2890
Clase AEP	13,7161	14,9359	15,5848
Clase AK	124,8571 ¹	123,9807 ¹	126,8311 ¹
Clase AUP	12,6530 ²	14,1101 ²	15,5516 ²
Clase DE	31,9592	34,6525	36,0617
Clase IE	62,3619	66,7097	68,4913
Clase IEP	11,7372	12,6727	13,1106
Clase NE	13,7328	14,6609	15,0223
Clase XE	16,0222	17,0020	17,3169
Clase XFH	10,5007 ³	11,2077 ³	11,4338 ³
Clase XG	16,0392 ⁴	16,3517 ⁴	16,7790 ⁴
Clase XGH	22,0720 ⁴	23,1206 ⁴	23,4350 ⁴
Clase XU	9,7326 ²	10,5772 ²	11,3797 ²
Clase ZE	15,3242	16,4090	16,8641
Clase ZFH	14,9779 ³	16,1495 ³	16,6452 ³
Clase ZG	15,3455 ⁴	15,8031 ⁴	16,3719 ⁴
Clase ZGH	45,1878 ⁴	47,7950 ⁴	48,9276 ⁴
Clase ZU	14,1168 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 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.054.468.199
Efectivo en el banco	2	2.129.191
Suscripciones por cobrar		545.614
Interés y dividendos por cobrar, neto		650.555
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	1.915.892
Total de activos		1.059.709.451
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(590.406)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(916.219)
Otros pasivos		(165.864)
Total de pasivos		(1.672.489)
Total de patrimonio neto		1.058.036.962

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	2.213.076,297
Clase AU	280.544,216
Clase DEH	44.016,944
Clase DU	610.689,401
Clase IEH	548.188,745
Clase IU	5.488.882,160
Clase W	1.598,035
Clase ZE	19.308,359
Clase ZEH	2.114.294,299
Clase ZU	60,000
Clase 1E	2.538.878,247
Clase 1EH	76.038,808
Clase 1EP	311.033,567
Clase 1U	11.864.112,005
Clase 2E	549.548,222
Clase 2U	8.300.540,060
Clase 3EH	34.852,469
Clase 3U	139.994,550
Clase 8E	449.826,278
Clase 8U	544.135,187
Clase 9EH	55,000
Clase 9U	364.819,350

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		1.241.417.577
Ingresos		
Dividendos, neto	2	11.179.480
Interés bancario	2	110.174
Total de ingresos		11.289.654
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(11.337.989)
Interés bancario	2	(10.475)
Gastos operativos	3, 5	(2.062.268)
Total de gastos		(13.410.732)
(Pérdida) neta de inversiones		(2.121.078)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		30.883.946
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(12.263.865)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(512.743)
Ganancia neta realizada		18.107.338
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(154.112.696)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		21.480
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(154.091.216)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(138.104.956)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		513.060.714
Reembolsos de acciones		(558.260.709)
Dividendos	7	(75.664)
Total de movimientos de capital		(45.275.659)
Patrimonio neto al final del ejercicio		1.058.036.962

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	1.058.036.962	1.241.417.577	1.120.251.631

Threadneedle (Lux) - American

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	58,8005 ¹	67,7231 ¹	62,4805 ¹
Clase AU	106,4713	118,2788	107,7058
Clase DEH	43,1697 ¹	49,9448 ¹	46,2355 ¹
Clase DU	41,1268	45,8481	41,8962
Clase IEH	64,4833 ¹	73,6686 ¹	67,3710 ¹
Clase IU	73,9691	81,4356	73,4915
Clase W	142,5123	157,8424	143,3024
Clase ZE	16,4747 ¹	17,7345 ¹	15,1672 ¹
Clase ZEH	13,7004 ¹	15,6669 ¹	14,3367 ¹
Clase ZU	15,4537	17,0528	15,4031
Clase 1E	15,6752 ¹	16,9814 ¹	14,6201 ¹
Clase 1EH	13,2250 ¹	15,2219 ¹	14,0242 ¹
Clase 1EP	14,6508 ¹	16,1234 ¹	14,0455 ¹
Clase 1U	14,7080	16,3179	14,8399
Clase 2E	16,1119 ¹	17,3483 ¹	14,8451 ¹
Clase 2U	15,1153	16,6678	15,0659
Clase 3EH	13,6917 ¹	15,6415 ¹	14,2960 ¹
Clase 3U	15,2372	16,7719	15,1327
Clase 8E	16,0815 ¹	17,3225 ¹	14,8290 ¹
Clase 8U	15,0839	16,6398	15,0466
Clase 9EH	13,7283 ¹	15,6785 ¹	14,3200 ¹
Clase 9U	15,2580	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 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	330.705.270
Efectivo en el banco	2	1.220.867
Depósitos a plazo	2, 19	5.001.325
Suscripciones por cobrar		25.733
Interés y dividendos por cobrar, neto		326.155
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	16.587
Total de activos		337.295.937
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(92.641)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(408.968)
Otros pasivos		(47.276)
Total de pasivos		(548.885)
Total de patrimonio neto		336.747.052

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AD	405,000
Clase AEH	15.035,842
Clase AN	524,000
Clase AU	127.456,818
Clase DEH	16.847,894
Clase DU	90.644,247
Clase ID	399,000
Clase IE	54,000
Clase IEH	4.765,789
Clase IN	517,000
Clase W	4.870,367
Clase ZEH	53,000
Clase ZU	8.884,396
Clase 1E	12.746.178,468
Clase 1EH	63.824,804
Clase 1EP	380.361,416
Clase 1U	37.872.414,659
Clase 2EH	712,000
Clase 2U	1.619,818
Clase 3E	831.550,449
Clase 3U	755.689,298
Clase 8EH	4.562,812
Clase 8U	1.857.228,876
Clase 9E	50,000
Clase 9U	3.235,874

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		413.688.020
Ingresos		
Dividendos, neto	2	3.662.492
Interés bancario	2	254.248
Total de ingresos		3.916.740
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(5.043.850)
Interés bancario	2	(567)
Gastos operativos	3, 5	(582.430)
Total de gastos		(5.626.847)
(Pérdida) neta de inversiones		(1.710.107)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(32.938.293)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(115.969)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		8.328
(Pérdida) neta realizada		(33.045.934)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(17.431.050)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(7.893)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(17.438.943)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(52.194.984)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		22.616.857
Reembolsos de acciones		(47.328.161)
Dividendos	7	(34.680)
Total de movimientos de capital		(24.745.984)
Patrimonio neto al final del ejercicio		336.747.052

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	336.747.052	413.688.020	438.535.319

Threadneedle (Lux) - American Select

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AD	14,4184 ¹	16,1001 ¹	14,0643 ¹
Clase AEH	36,3897 ²	43,2612 ²	40,4315 ²
Clase AN	17,0195 ³	16,2724 ³	14,6605 ³
Clase AU	34,9515	39,9888	36,9044
Clase DEH	24,5242 ²	29,3649 ²	27,6535 ²
Clase DU	30,3579	34,9947	32,5387
Clase ID	14,8718 ¹	16,4501 ¹	14,2588 ¹
Clase IE	14,9055 ²	16,5155 ²	14,3186 ²
Clase IEH	39,2277 ²	46,2659 ²	42,8992 ²
Clase IN	17,5368 ³	16,6107 ³	14,8493 ³
Clase W	37,0021	42,3137	39,0305
Clase ZEH	13,1870 ²	15,5785 ²	14,4664 ²
Clase ZU	14,9153	16,9458	15,5296
Clase 1E	5,5378 ²	6,1787 ²	5,3911 ²
Clase 1EH	3,8663 ²	4,5896 ²	4,2840 ²
Clase 1EP	5,2544 ²	5,9576 ²	5,2548 ²
Clase 1U	6,0164	6,8745	6,3360
Clase 2EH	13,6558 ²	16,1111 ²	14,9450 ²
Clase 2U	15,1476	17,2032	15,7585
Clase 3E	4,5811 ²	5,0705 ²	4,3890 ²
Clase 3U	4,9770	5,6415	5,1582
Clase 8EH	3,4274 ²	4,0452 ²	3,7559 ²
Clase 8U	6,9957	7,9480	7,2838
Clase 9E	15,9996 ²	17,7121 ²	15,3150 ²
Clase 9U	15,3123	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 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	459.733.127
Efectivo en el banco	2	1.037.476
Suscripciones por cobrar		254.439
Interés y dividendos por cobrar, neto		61.710
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	694.141
Total de activos		461.780.893
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(169.880)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(386.719)
Otros pasivos		(65.108)
Total de pasivos		(621.707)
Total de patrimonio neto		461.159.186

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	146.813,264
Clase ASH	135,000
Clase AU	64.714,138
Clase DEH	19.309,039
Clase DU	59.936,971
Clase IE	7.475.903,485
Clase IU	1.185.843,630
Clase ZU	16.039,182
Clase 1E	562.304,921
Clase 1EP	1.120.043,835
Clase 1U	6.263.232,085
Clase 2U	1.506.944,461
Clase 3EH	4.009,863
Clase 3U	903.916,074
Clase 8U	1.233.977,903
Clase 9EH	3.812.813,617
Clase 9U	2.870.809,609

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	14,5673 ¹	16,5581 ¹	16,6368 ¹
Clase ASH [#]	9,7371 ²	—	—
Clase AU	16,2313	17,7793	17,6124
Clase DEH	14,2416 ¹	16,2757 ¹	16,4357 ¹
Clase DU	15,8822	17,4841	17,4069
Clase IE	16,1245 ¹	17,1002 ¹	15,9009 ¹
Clase IU	16,8585	18,3099	17,9845
Clase ZU	16,7987	18,2631	17,9572
Clase 1E	17,2458 ¹	18,4235 ¹	17,2570 ¹
Clase 1EP	16,1333 ¹	17,4744 ¹	16,5639 ¹
Clase 1U	16,3330	17,8692	17,6803
Clase 2U	16,7817	18,2483	17,9455
Clase 3EH	15,1814 ¹	17,0721 ¹	17,0018 ¹
Clase 3U	16,8822	18,3319	18,0025
Clase 8U	16,7598	18,2318	17,9365
Clase 9EH	15,2029 ¹	17,1199 ¹	17,0449 ¹
Clase 9U	16,9176	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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		336.365.358
Ingresos		
Dividendos, neto	2	3.488.382
Interés bancario	2	58.021
Total de ingresos		3.546.403
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(3.476.243)
Interés bancario	2	(1.323)
Gastos operativos	3, 5	(510.241)
Total de gastos		(3.987.807)
(Pérdida) neta de inversiones		(441.404)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		3.179.890
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.341.762)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(142.830)
Ganancia neta realizada		1.695.298
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(39.221.286)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		536.115
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(38.685.171)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(37.431.277)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		246.490.096
Reembolsos de acciones		(83.999.905)
Dividendos	7	(265.086)
Total de movimientos de capital		162.225.105
Patrimonio neto al final del ejercicio		461.159.186

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	461.159.186	336.365.358	317.052.344

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	42.950.164
Efectivo en el banco	2	759.917
Interés y dividendos por cobrar, neto		149.575
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	4.099
Otros activos	20	530.884
Total de activos		44.394.639
Pasivos		
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.361)
Impuesto por pagar	3	(25.824)
Otros pasivos		(5.686)
Total de pasivos		(32.871)
Total de patrimonio neto		44.361.768

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.735,856
Clase AF	51,000
Clase AS	938,481
Clase ASH	32.070,823
Clase AU	11.475,833
Clase DE	25.118,613
Clase IF	49,000
Clase ISH	71,000
Clase IU	51,000
Clase XU	1.237.862,746
Clase XUP	2.557.578,913
Clase ZE	45,000
Clase ZEH	3.844,269
Clase ZF	49,000
Clase ZG	60,000
Clase ZU	4.199,804

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	13,9231 ¹	15,4485 ¹	18,3066 ¹
Clase AF	12,7109 ²	14,5713 ²	18,6638 ²
Clase AS	9,9397 ³	11,4961 ³	14,2865 ³
Clase ASH	12,3807 ³	14,2590 ³	17,9279 ³
Clase AU	13,2011	15,0003	18,7762
Clase DE	13,0775 ¹	14,6194 ¹	17,4547 ¹
Clase IF	13,5353 ²	15,3389 ²	19,4667 ²
Clase ISH	13,3286 ³	15,2033 ³	18,9488 ³
Clase IU	14,1624	15,9526	19,7990
Clase XU	10,8872	12,1685	14,9820
Clase XUP	11,7028	13,4480	16,9577
Clase ZE	14,7099 ¹	16,2137 ¹	19,0713 ¹
Clase ZEH	11,8918 ¹	13,8883 ¹	17,5088 ¹
Clase ZF	13,4629 ²	15,3088 ²	19,4570 ²
Clase ZG	9,6689 ⁴	10,2500 ⁴	12,1521 ⁴
Clase ZU	14,0938	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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		95.614.006
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.401.445
Interés bancario	2	22.346
Otros ingresos		246.030
Total de ingresos		1.669.821
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(21.353)
Interés bancario	2	(589)
Gastos operativos	3, 5	(91.494)
Total de gastos		(113.436)
Ingresos netos de inversiones		1.556.385
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(2.851.035)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(13.564)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		32.773
(Pérdida) neta realizada		(2.831.826)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(9.704.069)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		938
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(9.703.131)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(10.978.572)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		11.295.110
Reembolsos de acciones		(50.824.521)
Dividendos	7	(744.255)
Total de movimientos de capital		(40.273.666)
Patrimonio neto al final del ejercicio		44.361.768

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	44.361.768	95.614.006	188.088.458

Threadneedle (Lux) - Asia Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	115.440.088
Efectivo en el banco	2	787.228
Suscripciones por cobrar		1.262
Interés y dividendos por cobrar, neto		412.537
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	13
Otros activos	20	1.383.325
Total de activos		118.024.453
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(713.789)
Reembolsos pagaderos		(69.160)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(121.005)
Otros pasivos		(17.249)
Total de pasivos		(921.203)
Total de patrimonio neto		117.103.250

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	83,000
Clase AEH	83,000
Clase DE	83,000
Clase DEH	83,000
Clase IE	554.785,299
Clase IU	188.889,492
Clase ZU	19.857,424
Clase 1E	1.178.423,101
Clase 1U	22.268.734,091
Clase 2E	55,000
Clase 2U	1.583.661,487
Clase 3U	4.101.843,604
Clase 8E	670,407
Clase 8U	1.691.627,638
Clase 9U	131.715,243

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	7,7940 ¹	8,9696 ¹	—
Clase AEH	6,6394 ¹	8,0913 ¹	—
Clase DE	7,7281 ¹	8,9361 ¹	—
Clase DEH	6,5830 ¹	8,0618 ¹	—
Clase IE	11,2413 ¹	12,8045 ¹	14,5096 ¹
Clase IU	11,4782	13,3897	16,0271
Clase ZU	11,4362	13,3540	16,0024
Clase 1E	2,7919 ¹	3,2041 ¹	3,6581 ¹
Clase 1U	3,0330	3,5648	4,2991
Clase 2E	11,9878 ¹	13,6717 ¹	15,5085 ¹
Clase 2U	11,4208	13,3414	15,9916
Clase 3U	2,7558	3,2148	3,8480
Clase 8E	3,2110 ¹	3,6646 ¹	4,1593 ¹
Clase 8U	3,4904	4,0790	4,8912
Clase 9U	11,5069	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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		142.380.978
Ingresos		
Dividendos, neto	2	2.777.190
Interés bancario	2	40.660
Otros ingresos		518.334
Total de ingresos		3.336.184
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.501.491)
Interés bancario	2	(337)
Gastos operativos	3, 5	(213.337)
Comisiones varias	4	(265)
Total de gastos		(1.715.430)
Ingresos netos de inversiones		1.620.754
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(10.513.890)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(8.257)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(52.945)
(Pérdida) neta realizada		(10.575.092)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(11.774.789)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(3)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(11.774.792)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(20.729.130)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		21.492.955
Reembolsos de acciones		(26.041.553)
Total de movimientos de capital		(4.548.598)
Patrimonio neto al final del ejercicio		117.103.250

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	117.103.250	142.380.978	343.930.526

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	260.750.521
Efectivo en el banco	2	6.443.734
Suscripciones por cobrar		88.188
Interés y dividendos por cobrar, neto		140.089
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	970.551
Total de activos		268.393.083
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(389.533)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(127.107)
Otros pasivos		(55.881)
Total de pasivos		(572.521)
Total de patrimonio neto		267.820.562

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	52,844
Clase AEH	22.892,032
Clase AU	75.775,028
Clase AUP	8.906,274
Clase DU	6.382,200
Clase IU	1.426.416,499
Clase XS	69,000
Clase XSH	5.242.486,638
Clase ZEH	338.028,006
Clase ZFH	48,000
Clase ZGH	35,000
Clase ZU	3.592.736,411

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEC	16,0772 ¹	18,8839 ¹	17,5161 ¹
Clase AEH	27,0377 ¹	31,2589 ¹	28,6186 ¹
Clase AU	51,7687	57,7098	52,1802
Clase AUP	18,4680	20,8998	19,1464
Clase DU	25,5801	28,6587	26,0427
Clase IU	75,5875	83,5904	74,9789
Clase XS	18,3141 ²	20,4221 ²	18,0154 ²
Clase XSH	18,5872 ²	20,6253 ²	18,3848 ²
Clase ZEH	17,8024 ¹	20,4263 ¹	18,5596 ¹
Clase ZFH	17,3160 ³	19,9729 ³	18,1775 ³
Clase ZGH	18,7761 ⁴	21,2839 ⁴	19,2281 ⁴
Clase ZU	20,9441	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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		379.069.017
Ingresos		
Dividendos, neto	2	2.672.162
Interés bancario	2	175.047
Total de ingresos		2.847.209
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.643.430)
Interés bancario	2	(7.796)
Gastos operativos	3, 5	(709.165)
Total de gastos		(2.360.391)
Ingresos netos de inversiones		486.818
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		22.159.580
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(707.868)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(61.135)
Ganancia neta realizada		21.390.577
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(59.348.888)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(93.723)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(59.442.611)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(37.565.216)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		45.664.053
Reembolsos de acciones		(119.344.926)
Dividendos	7	(2.366)
Total de movimientos de capital		(73.683.239)
Patrimonio neto al final del ejercicio		267.820.562

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	267.820.562	379.069.017	484.292.226

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	125.538.670
Efectivo en el banco	2	1.531.165
Suscripciones por cobrar		135.036
Interés y dividendos por cobrar, neto		74.286
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	5.416
Total de activos		127.284.573
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(155.246)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(10.676)
Otros pasivos		(10.537)
Total de pasivos		(176.459)
Total de patrimonio neto		127.108.114

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.819,435
Clase AEH	54,100
Clase AU	59,094
Clase AUP	63,640
Clase DE	15.027,698
Clase DEH	37.915,284
Clase DU	1.069,760
Clase IE	52,100
Clase IEC	58,100
Clase IEH	54,100
Clase IFH	59,100
Clase IG	17.930,113
Clase IU	57,576
Clase NE	23.087,450
Clase NG	5.919.787,311
Clase NU	1.911.462,394
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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		78.667.240
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.197.855
Interés bancario	2	3.932
Total de ingresos		1.201.787
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(95.896)
Gastos operativos	3, 5	(93.195)
Total de gastos		(189.091)
Ingresos netos de inversiones		1.012.696
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(853.228)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(12.348)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(16.572)
(Pérdida) neta realizada		(882.148)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(2.431.410)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(2.840)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(2.434.250)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(2.303.702)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		77.312.949
Reembolsos de acciones		(26.568.342)
Dividendos	7	(31)
Total de movimientos de capital		50.744.576
Patrimonio neto al final del ejercicio		127.108.114

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	127.108.114	78.667.240	26.554.871

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	17,338 ¹	18,289 ¹	15,240 ¹
Clase AEH	14,712 ¹	16,462 ¹	14,670 ¹
Clase AU	16,914 ¹	18,254 ¹	16,066 ¹
Clase AUP	15,096 ¹	16,590 ¹	14,861 ¹
Clase DE	17,131 ¹	18,107 ¹	15,118 ¹
Clase DEH	14,548 ¹	16,310 ¹	14,563 ¹
Clase DU	16,702 ¹	18,079 ¹	15,945 ¹
Clase IE	17,653 ¹	18,565 ¹	15,416 ¹
Clase IEC	13,336 ¹	15,180 ¹	13,728 ¹
Clase IEH	14,968 ¹	16,719 ¹	14,847 ¹
Clase IFH	14,770 ²	16,548 ²	14,715 ²
Clase IG	14,643 ³	14,803 ³	12,389 ³
Clase IU	17,238 ¹	18,567 ¹	16,281 ¹
Clase NE	14,258 ¹	14,958 ¹	12,390 ¹
Clase NG	13,719 ³	13,849 ³	11,575 ³
Clase NU	13,104 ¹	14,085 ¹	12,333 ¹
Clase XG	13,798 ³	13,910 ³	11,614 ³
Clase ZEH	14,907 ¹	16,659 ¹	14,810 ¹
Clase ZFH	14,683 ²	16,454 ²	14,644 ²
Clase ZU	17,142 ¹	18,472 ¹	16,219 ¹

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

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

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

Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	433.197.682
Efectivo en el banco	2	1.216.394
Suscripciones por cobrar		184.892
Interés y dividendos por cobrar, neto		629.632
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	24.948
Otros activos		698.502
Total de activos		435.952.050
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(178.380)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(256.815)
Otros pasivos		(42.592)
Total de pasivos		(477.787)
Total de patrimonio neto		435.474.263

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	138.144,612
Clase ASH	884.938,817
Clase AUH	5.301,591
Clase DE	143.717,026
Clase IE	2.322.201,033
Clase W	30.997,242
Clase XE	1.343.634,723
Clase ZE	646.420,857
Clase ZUH	5.381,483
Clase 1E	2.971.226,626
Clase 1EP	65,000
Clase 1G	160.738,427
Clase 1GP	59,000
Clase 2E	7.299.867,359
Clase 2G	449.433,863
Clase 2U	73,000
Clase 3E	94.817,983
Clase 3G	225.058,394
Clase 3GP	382,218
Clase 4E	416.408,472
Clase 4G	55,000
Clase 8E	215.710,164
Clase 8G	36.280,399
Clase 8U	73,000
Clase 9E	62,000
Clase 9G	56,000
Clase 9GP	57,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		475.145.184
Ingresos		
Dividendos, neto	2	11.810.950
Interés bancario	2	8.009
Otros ingresos		308
Total de ingresos		11.819.267
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(2.947.776)
Interés bancario	2	(9.285)
Gastos operativos	3, 5	(528.243)
Total de gastos		(3.485.304)
Ingresos netos de inversiones		8.333.963
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(3.342.840)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		274.019
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(150.000)
Ganancia neta realizada en reembolso de impuestos		13
(Pérdida) neta realizada		(3.218.808)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(5.743.050)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		38.773
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(5.704.277)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(589.122)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		89.195.389
Reembolsos de acciones		(128.276.955)
Dividendos	7	(233)
Total de movimientos de capital		(39.081.799)
Patrimonio neto al final del ejercicio		435.474.263

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	435.474.263	475.145.184	386.572.137

Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	83,5774	83,5781	78,4220
Clase ASH	24,5969 ¹	24,0735 ¹	22,3960 ¹
Clase AUH	29,8927 ²	28,9294 ²	26,8262 ²
Clase DE	30,0559	30,1163	28,3149
Clase IE	59,7803	59,3341	55,2576
Clase W	69,9400	70,0340	65,8450
Clase XE	70,2841	69,2730	64,0957
Clase ZE	9,8833	9,8259	—
Clase ZUH	19,6715 ²	18,9486 ²	17,4726 ²
Clase 1E	13,3051	13,3070	12,4836
Clase 1EP	12,3086	12,6891	12,2262
Clase 1G	12,9932 ³	12,4978 ³	11,8186 ³
Clase 1GP	12,0282 ³	11,9244 ³	11,5799 ³
Clase 2E	13,6414	13,5821	12,6844
Clase 2G	13,3206 ³	12,7552 ³	12,0079 ³
Clase 2U	12,7149 ²	12,9544 ²	12,7712 ²
Clase 3E	13,7277	13,6488	12,7289
Clase 3G	13,4053 ³	12,8183 ³	12,0504 ³
Clase 3GP	12,4223 ³	12,2439 ³	11,8079 ³
Clase 4E	14,2809	14,0773	13,0161
Clase 4G	13,9701 ³	13,2403 ³	12,3357 ³
Clase 8E	13,6107	13,5570	12,6660
Clase 8G	13,2969 ³	12,7375 ³	11,9961 ³
Clase 8U	12,6872 ²	12,9310 ²	12,7491 ²
Clase 9E	13,7945	13,7069	12,7770
Clase 9G	13,4619 ³	12,8673 ³	12,0896 ³
Clase 9GP	12,4892 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 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	68.880.135
Efectivo en el banco	2	295.155
Por cobrar para la venta de inversiones		296.086
Suscripciones por cobrar		77.762
Interés y dividendos por cobrar, neto		88.980
Otros activos		282.411
Total de activos		69.920.529
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(297.591)
Reembolsos pagaderos		(80.199)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(47.463)
Otros pasivos		(8.533)
Total de pasivos		(433.786)
Total de patrimonio neto		69.486.743

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	754,188
Clase AEP	38.312,313
Clase AUP	80,000
Clase DE	1.655,034
Clase DEP	17.413,058
Clase IE	1.179.227,428
Clase IEP	653.490,000
Clase ZE	65,000
Clase ZEP	22.802,000
Clase 1E	3.523.281,743
Clase 1EP	10.397.992,113
Clase 1G	170.467,092
Clase 1GP	329.566,345
Clase 2E	928.650,278
Clase 2EP	72,000
Clase 2G	58,000
Clase 2GP	63,000
Clase 3EP	71.251,006
Clase 3G	71.165,838
Clase 3GP	609.089,451
Clase 4GP	7.350.534,040
Clase 8E	252.431,001
Clase 8EP	860.721,752
Clase 8G	16.041,603
Clase 8GP	478.750,358
Clase 9EP	71,000
Clase 9G	57,000
Clase 9GP	263,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		60.925.035
Ingresos		
Dividendos, neto	2	2.269.392
Interés bancario	2	1.219
Otros ingresos		140
Total de ingresos		2.270.751
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(505.592)
Interés bancario	2	(3.127)
Gastos operativos	3, 5	(83.307)
Comisiones varias	4	(16)
Total de gastos		(592.042)
Ingresos netos de inversiones		1.678.709
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(1.648.741)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		4.295
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(47.310)
Ganancia neta realizada en reembolso de impuestos		10
(Pérdida) neta realizada		(1.691.746)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		1.600.038
Cambio neto en ganancia no realizada		1.600.038
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		1.587.001
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		19.534.285
Reembolsos de acciones		(11.142.711)
Dividendos	7	(1.416.867)
Total de movimientos de capital		6.974.707
Patrimonio neto al final del ejercicio		69.486.743

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	69.486.743	60.925.035	72.471.914

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	12,6500	12,2899	12,2123
Clase AEP	10,5858	10,7997	11,1512
Clase AUP	10,4337 ¹	10,9127 ¹	11,9099 ¹
Clase DE	12,4468	12,1356	12,1020
Clase DEP	10,4095	10,6571	11,0429
Clase IE	13,1920	12,6707	12,4632
Clase IEP	11,0419	11,1344	11,3788
Clase ZE	13,0688	12,6183	12,4458
Clase ZEP	10,9401	11,0767	11,3507
Clase 1E	2,0670	2,0062	1,9917
Clase 1EP	1,0503	1,0714	1,1057
Clase 1G	1,8160 ²	1,6952 ²	1,6964 ²
Clase 1GP	0,9240 ²	0,9066 ²	0,9428 ²
Clase 2E	13,0603	12,5994	12,4322
Clase 2EP	10,9561	11,0904	11,3572
Clase 2G	13,0785 ²	12,1240 ²	12,0502 ²
Clase 2GP	10,9385 ²	10,6484 ²	10,9938 ²
Clase 3EP	1,7311	1,7509	1,7928
Clase 3G	1,7759 ²	1,6454 ²	1,6343 ²
Clase 3GP	1,5112 ²	1,4708 ²	1,5182 ²
Clase 4GP	1,3545 ²	1,3081 ²	1,3394 ²
Clase 8E	2,2984	2,2182	2,1897
Clase 8EP	1,1545	1,1693	1,1990
Clase 8G	2,0212 ²	1,8760 ²	1,8667 ²
Clase 8GP	1,0142 ²	0,9875 ²	1,0208 ²
Clase 9EP	11,0341	11,1480	11,4256
Clase 9G	13,1481 ²	12,1739 ²	12,0857 ²
Clase 9GP	11,0089 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 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	389.364.672
Efectivo en el banco	2	1.777.342
Por cobrar para la venta de inversiones		96.560
Suscripciones por cobrar		146.277
Interés y dividendos por cobrar, neto		494.490
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	13.155
Otros activos	20	698.593
Total de activos		392.591.089
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(292.531)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(455.822)
Otros pasivos		(108.173)
Total de pasivos		(856.526)
Total de patrimonio neto		391.734.563

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	4.719.667,977
Clase ASH	374.732,185
Clase AUH	11.283,289
Clase DE	1.159.157,536
Clase DUH	275,000
Clase IE	1.679.106,647
Clase W	9.912,171
Clase XE	88,000
Clase ZE	3.323.243,164
Clase ZFH	5.601,004

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	43,8005	50,4135	53,6034
Clase ASH	30,8067 ¹	34,6658 ¹	36,5279 ¹
Clase AUH	12,0652 ²	13,4075 ²	14,0753 ²
Clase DE	38,7886	45,0490	48,3327
Clase DUH	11,5560 ²	12,9610 ²	13,7346 ²
Clase IE	55,8653	63,8189	67,3496
Clase W	73,1946	84,2877	89,6657
Clase XE	9,2026	10,4050	—
Clase ZE	11,2353	12,8349	13,5449
Clase ZFH	10,7434 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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		673.597.948
Ingresos		
Dividendos, neto	2	8.465.934
Interés bancario	2	5.659
Otros ingresos		233
Total de ingresos		8.471.826
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(6.053.423)
Interés bancario	2	(11.620)
Gastos operativos	3, 5	(1.434.786)
Total de gastos		(7.499.829)
Ingresos netos de inversiones		971.997
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(2.919.074)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		615.400
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		44.589
Ganancia neta realizada en reembolso de impuestos		13
(Pérdida) neta realizada		(2.259.072)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(84.725.377)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		37.711
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(84.687.666)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(85.974.741)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		48.474.706
Reembolsos de acciones		(244.363.350)
Total de movimientos de capital		(195.888.644)
Patrimonio neto al final del ejercicio		391.734.563

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	391.734.563	673.597.948	967.772.792

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	743.105.034
Efectivo en el banco	2	2.558.722
Por cobrar para la venta de inversiones		189.075
Suscripciones por cobrar		68.562
Interés y dividendos por cobrar, neto		806.904
Otros activos		1.831.816
Total de activos		748.560.113
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(972.164)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(396.052)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(630.516)
Otros pasivos		(93.898)
Total de pasivos		(2.092.630)
Total de patrimonio neto		746.467.483

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase 1E	1.048.877,064
Clase 2E	826.848,727
Clase 1E	19.388.025,495
Clase 1EP	675.169,392
Clase 1FH	200.873,710
Clase 1G	570.489,917
Clase 1UH	1.517.719,944
Clase 2E	15.340.003,969
Clase 2G	56,000
Clase 3E	11.816.237,955
Clase 3EP	936.181,220
Clase 3FH	638.906,591
Clase 3G	1.848.743,337
Clase 3GP	143.890,562
Clase 3UH	749.173,342
Clase 4E	1.785.471,465
Clase 4G	1.832.020,560
Clase 8E	3.611.191,677
Clase 8G	483.570,549
Clase 9E	5.836.490,672
Clase 9EP	64,000
Clase 9FH	23.354,059
Clase 9G	924.438,277
Clase 9GP	57,000
Clase 9UH	98.344,006

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		1.236.395.974
Ingresos		
Dividendos, neto	2	17.313.945
Interés bancario	2	5.628
Otros ingresos		467
Total de ingresos		17.320.040
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(8.397.660)
Interés bancario	2	(14.605)
Gastos operativos	3, 5	(1.281.715)
Total de gastos		(9.693.980)
Ingresos netos de inversiones		7.626.060
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(39.497.577)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		2.912.107
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		143.855
Ganancia neta realizada en reembolso de impuestos		107
(Pérdida) neta realizada		(36.441.508)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(105.230.833)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(104.432)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(105.335.265)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(134.150.713)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		53.526.211
Reembolsos de acciones		(408.967.070)
Dividendos	7	(336.919)
Total de movimientos de capital		(355.777.778)
Patrimonio neto al final del ejercicio		746.467.483

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	746.467.483	1.236.395.974	1.980.272.935

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase IE	10,8544	12,1084	13,0732
Clase ZE	10,5207	11,7537	12,7094
Clase 1E	10,2286	11,4986	12,5109
Clase 1EP	9,5356	10,9343	12,0777
Clase 1FH	10,0750 ¹	11,3955 ¹	12,4182 ¹
Clase 1G	9,9865 ²	10,7968 ²	11,8416 ²
Clase 1UH	11,3113 ³	12,2785 ³	13,1915 ³
Clase 2E	10,5360	11,7673	12,7202
Clase 2G	10,2944 ²	11,0646 ²	12,0514 ²
Clase 3E	10,6150	11,8366	12,7747
Clase 3EP	9,9003	11,2596	12,3346
Clase 3FH	10,4566 ¹	11,7317 ¹	12,6823 ¹
Clase 3G	10,3626 ²	11,1130 ²	12,0901 ²
Clase 3GP	9,6655 ²	10,5711 ²	11,6735 ²
Clase 3UH	11,7341 ³	12,6338 ³	13,4644 ³
Clase 4E	11,0319	12,1985	13,0550
Clase 4G	12,0536 ²	12,8182 ²	13,8285 ²
Clase 8E	10,5187	11,7527	12,7095
Clase 8G	10,2696 ²	11,0354 ²	12,0297 ²
Clase 9E	10,6358	11,8550	12,7895
Clase 9EP	9,9388	11,2856	12,3547
Clase 9FH	10,4765 ¹	11,7487 ¹	12,6978 ¹
Clase 9G	10,3853 ²	11,1328 ²	12,1068 ²
Clase 9GP	9,7133 ²	10,6036 ²	11,7010 ²
Clase 9UH	11,7629 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 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.533.556.605
Efectivo en el banco	2	1.015.110
Por cobrar para la venta de inversiones		7.516.288
Suscripciones por cobrar		92.605
Interés y dividendos por cobrar, neto		237.239
Otros activos	20	3.889.945
Total de activos		1.546.307.792
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(11.637.067)
Reembolsos pagaderos		(538.509)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(185.379)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.681.414)
Otros pasivos		(175.072)
Total de pasivos		(14.217.441)
Total de patrimonio neto		1.532.090.351

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	142.776,027
Clase AGH	19.585,978
Clase AUH	285.078,104
Clase DUH	66,000
Clase IE	515.704,670
Clase ZE	85,000
Clase ZG	15.240,197
Clase ZGH	155.247,985
Clase 1E	73.380.614,792
Clase 1EP	915.057,483
Clase 1SH	1.856.727,524
Clase 1U	31.307,338
Clase 1UH	1.009.285,750
Clase 2E	7.091.555,326
Clase 2EP	57,000
Clase 3E	1.833.432,086
Clase 3U	536.612,311
Clase 8E	1.891.370,362
Clase 8EP	26.200,536
Clase 9E	12.361.174,682
Clase 9U	63,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		1.623.386.971
Ingresos		
Dividendos, neto	2	21.675.137
Interés bancario	2	9.751
Otros ingresos		1.422
Total de ingresos		21.686.310
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(18.786.796)
Interés bancario	2	(17.533)
Gastos operativos	3, 5	(1.930.641)
Total de gastos		(20.734.970)
Ingresos netos de inversiones		951.340
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		76.966.571
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		1.446.638
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		115.172
Ganancia neta realizada en reembolso de impuestos		1
Ganancia neta realizada		78.528.382
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(59.880.932)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(81.852)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(59.962.784)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		19.516.938
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		190.992.480
Reembolsos de acciones		(301.605.547)
Dividendos	7	(200.491)
Total de movimientos de capital		(110.813.558)
Patrimonio neto al final del ejercicio		1.532.090.351

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	1.532.090.351	1.623.386.971	1.641.460.241

Threadneedle (Lux) - European Select

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	30,7946	30,1120	29,4285
Clase AGH	33,4259 ¹	32,2683 ¹	31,3771 ¹
Clase AUH	36,1250 ²	34,1941 ²	33,0305 ²
Clase DUH	15,0044 ²	14,2740 ²	13,8650 ²
Clase IE	45,1332	43,7595	42,4042
Clase ZE	9,3846	9,1184	—
Clase ZG	15,6331 ¹	14,5919 ¹	14,2678 ¹
Clase ZGH	34,7713 ¹	33,3203 ¹	32,1562 ¹
Clase 1E	14,7181	14,3703	14,0231
Clase 1EP	13,7522	13,6418	13,5040
Clase 1SH	15,6546 ³	14,9506 ³	14,4595 ³
Clase 1U	13,8087 ²	13,8075 ²	14,2325 ²
Clase 1UH	16,1804 ²	15,2829 ²	14,7401 ²
Clase 2E	15,1090	14,6652	14,2266
Clase 2EP	14,1356	13,9345	13,7092
Clase 3E	15,2310	14,7570	14,2900
Clase 3U	14,2879 ²	14,1771 ²	14,5014 ²
Clase 8E	15,0828	14,6457	14,2134
Clase 8EP	14,1062	13,9187	13,7016
Clase 9E	15,2571	14,7765	14,3031
Clase 9U	14,3329 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 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.435.047.467
Efectivo en el banco	2	2.853.132
Por cobrar para la venta de inversiones		3.284.167
Suscripciones por cobrar		109.450
Interés y dividendos por cobrar, neto		2.475.954
Otros activos	20	3.421.498
Total de activos		1.447.191.668
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(483.723)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(147.122)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.668.332)
Otros pasivos		(249.686)
Total de pasivos		(2.548.863)
Total de patrimonio neto		1.444.642.805

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IE	853.471,477
Clase ZE	725.351,743
Clase 1E	88.762.917,241
Clase 1EP	3.453.434,339
Clase 1FH	61,000
Clase 2E	1.593.232,507
Clase 3E	4.869.874,696
Clase 3EP	80.358,418
Clase 3FH	778.300,982
Clase 8E	4.705.646,739
Clase 9E	4.769.673,471
Clase 9EP	555.375,000
Clase 9FH	221,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase IE	12,0030	12,6494	13,0435
Clase ZE	13,3280	14,0668	14,5269
Clase 1E	12,9677	13,7718	14,3106
Clase 1EP	12,1305	13,1298	13,8388
Clase 1FH	12,7811 ¹	13,6535 ¹	14,2143 ¹
Clase 2E	13,3491	14,0850	14,5412
Clase 3E	13,4001	14,1189	14,5559
Clase 3EP	12,5586	13,4851	14,0994
Clase 3FH	13,2238 ¹	14,0261 ¹	14,4944 ¹
Clase 8E	13,3279	14,0682	14,5297
Clase 9E	13,4533	14,1693	14,6020
Clase 9EP	12,5916	13,5144	14,1156
Clase 9FH	13,2294 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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		1.772.635.200
Ingresos		
Dividendos, neto	2	27.358.454
Interés bancario	2	951
Otros ingresos		5.535
Total de ingresos		27.364.940
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(19.682.801)
Interés bancario	2	(19.473)
Gastos operativos	3, 5	(2.944.646)
Total de gastos		(22.646.920)
Ingresos netos de inversiones		4.718.020
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(2.509.703)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		418.151
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(26.340)
Ganancia neta realizada en reembolso de impuestos		74
(Pérdida) neta realizada		(2.117.818)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(119.144.798)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(235.205)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(119.380.003)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(116.779.801)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		135.397.266
Reembolsos de acciones		(345.680.393)
Dividendos	7	(929.467)
Total de movimientos de capital		(211.212.594)
Patrimonio neto al final del ejercicio		1.444.642.805

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	1.444.642.805	1.772.635.200	1.932.987.086

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	51.275.240
Efectivo en el banco	2	372.820
Por cobrar para la venta de inversiones		103.729
Suscripciones por cobrar		3.393
Interés y dividendos por cobrar, neto		244.326
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	68.771
Otros activos	20	631.332
Total de activos		52.699.611
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(377.585)
Reembolsos pagaderos		(29.699)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(34.682)
Otros pasivos		(9.336)
Total de pasivos		(451.302)
Total de patrimonio neto		52.248.309

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	32.759,019
Clase AU	46.890,237
Clase AUP	179.982,457
Clase DEH	161.772,801
Clase DU	44.129,797
Clase DUP	27.505,940
Clase IEP	1.063.069,353
Clase IU	70,000
Clase W	19.129,778
Clase XU	1.307.720,471
Clase XUP	269.785,749
Clase ZG	51,000
Clase ZGH	6.917,198
Clase ZGP	56,000
Clase ZU	100,000
Clase ZUP	3.829,949

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	38,9105 ¹	45,2875 ¹	49,6140 ¹
Clase AU	101,8799	114,4216	123,7850
Clase AUP	11,5123	13,4844	15,1272
Clase DEH	27,2703 ¹	31,9765 ¹	35,2821 ¹
Clase DU	48,8592	55,2874	60,2623
Clase DUP	11,1252	13,1305	14,8423
Clase IEP	12,3493 ¹	14,0025 ¹	14,7448 ¹
Clase IU	11,8781	13,2161	14,1867
Clase W	75,1452	84,5649	91,6683
Clase XU	13,3803	14,7814	15,7291
Clase XUP	12,2763	14,1419	15,6032
Clase ZG	13,2498 ²	13,8913 ²	14,2390 ²
Clase ZGH	22,6597 ²	25,8292 ²	27,9288 ²
Clase ZGP	11,1818 ²	12,2208 ²	12,9909 ²
Clase ZU	8,8505	9,8775	—
Clase ZUP	13,5022	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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		52.164.940
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.729.457
Interés bancario	2	19.994
Otros ingresos		80.154
Total de ingresos		1.829.605
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(369.133)
Interés bancario	2	(1.286)
Gastos operativos	3, 5	(103.429)
Comisiones varias	4	(49)
Total de gastos		(473.897)
Ingresos netos de inversiones		1.355.708
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(473.648)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(55.465)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(42.377)
(Pérdida) neta realizada		(571.490)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(6.288.886)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		25.349
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(6.263.537)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(5.479.319)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		11.931.527
Reembolsos de acciones		(5.591.220)
Dividendos	7	(777.619)
Total de movimientos de capital		5.562.688
Patrimonio neto al final del ejercicio		52.248.309

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	52.248.309	52.164.940	52.863.212

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Technology

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	619.850.434
Efectivo en el banco	2	22.576.640
Por cobrar para la venta de inversiones		1.005.798
Suscripciones por cobrar		715.198
Interés y dividendos por cobrar, neto		219.813
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	824.792
Total de activos		645.192.675
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(638.341)
Reembolsos pagaderos		(432.015)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(723.544)
Otros pasivos		(141.167)
Total de pasivos		(1.935.067)
Total de patrimonio neto		643.257.608

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	628.244,882
Clase AS	851.750,116
Clase AU	3.117.132,234
Clase AUP	72.094,859
Clase BU	58.486,227
Clase DEH	285.567,362
Clase DU	553.054,756
Clase IE	670.072,960
Clase IEH	1.205.225,041
Clase IG	17.898,636
Clase IU	8.697.335,652
Clase ZEH	108.502,011
Clase ZFH	43.765,815
Clase ZG	32.679,256
Clase ZU	1.299.243,266

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	62,5310 ¹	73,7380 ¹	67,4347 ¹
Clase AS	22,3014 ²	25,6949 ²	23,0106 ²
Clase AU	87,0049	98,4809	88,8329
Clase AUP	18,4591	21,0644	19,1460
Clase BU	109,3899	124,3152	112,5857
Clase DEH	17,8847 ¹	21,1515 ¹	19,4109 ¹
Clase DU	127,1439	144,4193	130,7275
Clase IE	15,8873 ¹	17,4019 ¹	14,7271 ¹
Clase IEH	21,4521 ¹	25,0771 ¹	22,7318 ¹
Clase IG	22,0881 ³	23,2680 ³	19,8499 ³
Clase IU	15,5489	17,4419	15,5922
Clase ZEH	17,7747 ¹	20,7904 ¹	18,8611 ¹
Clase ZFH	20,7055 ⁴	24,2713 ⁴	22,0485 ⁴
Clase ZG	22,0003 ³	23,1988 ³	19,8092 ³
Clase ZU	40,1267	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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		651.663.253
Ingresos		
Dividendos, neto	2	3.583.118
Interés bancario	2	255.996
Total de ingresos		3.839.114
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(8.210.961)
Interés bancario	2	(8.490)
Gastos operativos	3, 5	(1.589.629)
Total de gastos		(9.809.080)
(Pérdida) neta de inversiones		(5.969.966)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(6.152.374)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(5.096.904)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(131.195)
(Pérdida) neta realizada		(11.380.473)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(60.229.179)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(142.190)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(60.371.369)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(77.721.808)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		259.575.699
Reembolsos de acciones		(190.249.085)
Dividendos		(10.451)
Total de movimientos de capital		69.316.163
Patrimonio neto al final del ejercicio		643.257.608

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	643.257.608	651.663.253	537.276.170

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - UK Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 GBP
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	165.486.673
Efectivo en el banco	2	1.382.334
Suscripciones por cobrar		350.176
Interés y dividendos por cobrar, neto		520.056
Otros activos		126
Total de activos		167.739.365
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(187.176)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(117.886)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(105.549)
Otros pasivos		(27.333)
Total de pasivos		(437.944)
Total de patrimonio neto		167.301.421

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	98.316,766
Clase AEH	116.093,974
Clase AFH	7.192,000
Clase AG	390.355,107
Clase AGP	29.929,121
Clase DEH	8.344,846
Clase DG	75.395,788
Clase IE	562.634,940
Clase IEH	163.459,547
Clase IG	2.307.719,116
Clase IGP	221.925,062
Clase NEH	66,000
Clase NFH	73,000
Clase NG	57,000
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	20.941,383
Clase ZEH	74.052,824
Clase ZFH	3.325,000
Clase ZG	147.037,906
Clase ZGP	116.311,257
Clase ZUH	57.569,000
Clase 3EH	1.174.832,427
Clase 3FH	49.785,040
Clase 3UH	1.805.391,582
Clase 9EH	9.707,339
Clase 9EP	2.589.832,979
Clase 9FH	85,000
Clase 9G	11.018,300
Clase 9UH	87,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 GBP
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		274.453.238
Ingresos		
Dividendos, neto	2	6.780.540
Interés bancario	2	20.563
Total de ingresos		6.801.103
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.706.828)
Interés bancario	2	(1.991)
Gastos operativos	3, 5	(387.992)
Total de gastos		(2.096.811)
Ingresos netos de inversiones		4.704.292
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(15.237.103)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		812.976
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(46.033)
(Pérdida) neta realizada		(14.470.160)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		5.339.132
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(81.045)
Cambio neto en ganancia no realizada		5.258.087
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(4.507.781)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		99.336.984
Reembolsos de acciones		(200.652.322)
Dividendos	7	(1.328.698)
Total de movimientos de capital		(102.644.036)
Patrimonio neto al final del ejercicio		167.301.421

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
GBP	167.301.421	274.453.238	296.943.244

Threadneedle (Lux) - UK Equities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	9,4273 ¹	9,3165 ¹	9,2845 ¹
Clase AEH	20,6050 ¹	19,9122 ¹	20,1489 ¹
Clase AFH	9,9885 ²	9,7085 ²	9,8231 ²
Clase AG	29,3049	27,8526	27,9800
Clase AGP	20,7157	20,3018	21,0118
Clase DEH	9,6352 ¹	9,3874 ¹	9,5731 ¹
Clase DG	10,1533	9,7276	9,8507
Clase IE	10,1864 ¹	9,9716 ¹	9,8435 ¹
Clase IEH	31,4994 ¹	30,1611 ¹	30,2322 ¹
Clase IG	43,2514	40,7193	40,5187
Clase IGP	30,8986	29,9926	30,7471
Clase NEH	12,9677 ¹	12,3773 ¹	12,3770 ¹
Clase NFH	12,8955 ²	12,3772 ²	12,3746 ²
Clase NG	13,3079	12,5034	12,4164
Clase NGP	12,4219	12,0225	12,2963
Clase NUH	13,6193 ³	12,6056 ³	12,4477 ³
Clase TEH	12,9563 ¹	12,3724 ¹	12,3766 ¹
Clase TFH	12,8835 ²	12,3703 ²	12,3738 ²
Clase TG	13,3116	12,5042	12,4163
Clase TGP	12,4067	12,0170	12,2962
Clase TUH	13,6152 ³	12,6005 ³	12,4472 ³
Clase ZE	9,6466 ¹	9,4643 ¹	9,3628 ¹
Clase ZEH	12,8699 ¹	12,3480 ¹	12,4008 ¹
Clase ZFH	12,4052 ²	11,9648 ²	12,0143 ²
Clase ZG	28,6161	26,9947	26,9156
Clase ZGP	11,0805	10,7776	11,0735
Clase ZUH	11,8096 ³	10,9752 ³	10,8824 ³
Clase 3EH	1,8386 ¹	1,7608 ¹	1,7651 ¹
Clase 3FH	1,9650 ²	1,8918 ²	1,8962 ²
Clase 3UH	2,3556 ³	2,1863 ³	2,1639 ³
Clase 9EH	11,0302 ¹	10,5479 ¹	10,5716 ¹
Clase 9EP	9,8665 ¹	9,9562 ¹	10,1260 ¹
Clase 9FH	10,9400 ²	10,5292 ²	10,5498 ²
Clase 9G	10,7349	10,1044	10,0527
Clase 9UH	12,1115 ³	11,2422 ³	11,1280 ³

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

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

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

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 GBP
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	239.899.491
Efectivo en el banco	2	1.042.358
Suscripciones por cobrar		189.641
Interés y dividendos por cobrar, neto		927.338
Total de activos		242.058.828
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(209.723)
Reembolsos pagaderos		(737.507)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(127.950)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(141.357)
Otros pasivos		(43.098)
Total de pasivos		(1.259.635)
Total de patrimonio neto		240.799.193

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.692.515,605
Clase AEC	45.167,097
Clase AEH	118.996,596
Clase AG	507.167,095
Clase ASC	133,600
Clase AUC	129.896,783
Clase DE	2.654,203
Clase DEC	12.739,967
Clase DEH	4.780,573
Clase DG	23.717,766
Clase DGP	808,187
Clase IE	1.985.401,134
Clase IEH	20.378,034
Clase IG	200.830,035
Clase IGP	1.607.327,543
Clase IU	645.313,204
Clase IUH	80,000
Clase LG	503.455,553
Clase LGP	12.015.847,668
Clase ZE	16.844,763
Clase ZEH	31.152,710
Clase ZFH	10.046,000
Clase ZG	157.217,621
Clase ZGP	97.189,252
Clase ZUH	66.622,758
Clase 1EH	161.165,641
Clase 1FH	6.518,663
Clase 1UH	80.815,007
Clase 3EH	125.905,573
Clase 3FH	50.377,689
Clase 3UH	210.691,347
Clase 9EH	73,000
Clase 9FH	81,000
Clase 9G	1.162.234,374
Clase 9UH	2.174,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 GBP
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		232.631.300
Ingresos		
Dividendos, neto	2	9.071.984
Interés bancario	2	17.828
Total de ingresos		9.089.812
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.732.551)
Interés bancario	2	(2.409)
Gastos operativos	3, 5	(508.689)
Total de gastos		(2.243.649)
Ingresos netos de inversiones		6.846.163
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		5.749.225
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		1.098.425
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		92.075
Ganancia neta realizada		6.939.725
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(1.354.375)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(36.239)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(1.390.614)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		12.395.274
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		98.670.788
Reembolsos de acciones		(97.388.592)
Dividendos	7	(5.509.577)
Total de movimientos de capital		(4.227.381)
Patrimonio neto al final del ejercicio		240.799.193

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
GBP	240.799.193	232.631.300	203.529.182

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	12,6013 ¹	12,6812 ¹	11,6608 ¹
Clase AEC	9,4634 ¹	9,6686 ¹	9,3261 ¹
Clase AEH	11,7767 ¹	11,5877 ¹	10,8296 ¹
Clase AG	12,5901	12,1852	11,2947
Clase ASC	10,1010 ²	10,1013 ²	9,6533 ²
Clase AUC	10,7034 ³	10,6068 ³	10,1151 ³
Clase DE	12,0054 ¹	12,1725 ¹	11,2772 ¹
Clase DEC	8,9702 ¹	9,2267 ¹	8,9790 ¹
Clase DEH	11,2144 ¹	11,1182 ¹	10,4678 ¹
Clase DG	11,9968	11,6992	10,9259
Clase DGP	9,9693	10,0965	9,7473
Clase IE	13,3960 ¹	13,3535 ¹	12,1630 ¹
Clase IEH	12,5067 ¹	12,1998 ¹	11,2958 ¹
Clase IG	13,4114	12,8573	11,8052
Clase IGP	10,7517	10,7015	10,1383
Clase IU	12,9928 ³	13,2640 ³	12,7617 ³
Clase IUH	13,7584 ³	13,0077 ³	11,8874 ³
Clase LG	13,5361	12,9575	11,8792
Clase LGP	10,8271	10,7649	10,1870
Clase ZE	13,2311 ¹	13,2156 ¹	12,0615 ¹
Clase ZEH	12,3577 ¹	12,0729 ¹	11,2040 ¹
Clase ZFH	12,1009 ⁴	11,8925 ⁴	11,0386 ⁴
Clase ZG	13,2275	12,7064	11,6899
Clase ZGP	11,1391	11,1107	10,5523
Clase ZUH	14,0566 ³	13,3271 ³	12,2225 ³
Clase 1EH	11,6827 ¹	11,4780 ¹	10,7111 ¹
Clase 1FH	11,5429 ⁴	11,4101 ⁴	10,6537 ⁴
Clase 1UH	12,8308 ³	12,2298 ³	11,2829 ³
Clase 3EH	12,0836 ¹	11,7863 ¹	10,9193 ¹
Clase 3FH	11,9357 ⁴	11,7136 ⁴	10,8540 ⁴
Clase 3UH	13,2761 ³	12,5625 ³	11,5019 ³
Clase 9EH	12,1085 ¹	11,7980 ¹	10,9227 ¹
Clase 9FH	11,9323 ⁴	11,7077 ⁴	10,8516 ⁴
Clase 9G	11,9888	11,4924	10,5508
Clase 9UH	13,2859 ³	12,5653 ³	11,4992 ³

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

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

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

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

Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	23 de enero de 2023*	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase IU	3,6523	3,8464	3,8047
Clase ZU	3,6528	3,8469	3,8053

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril de 2022 al 23 de enero de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		1.580.155
Ingresos		
Interés bancario	2	12.680
Total de ingresos		12.680
Gastos		
Gastos operativos	3, 5	(4.398)
Total de gastos		(4.398)
Ingresos netos de inversiones		8.282
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(2.396)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(465)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(85.174)
(Pérdida) neta realizada		(88.035)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(79.753)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		—
Reembolsos de acciones		(1.500.402)
Total de movimientos de capital		(1.500.402)
Patrimonio neto al final del periodo		—

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	23 de enero de 2023*	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	—	1.580.155	6.857.182

* Consulte la nota 1.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	18.848.174
Efectivo en el banco	2	2.441.307
Por cobrar para la venta de inversiones		473.673
Suscripciones por cobrar		270
Interés por cobrar en swaps	2	12.095
Interés y dividendos por cobrar, neto		15.834
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	187.055
Otros activos		6.087
Total de activos		21.984.495
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(1.393.646)
Interés pagadero en swaps	2	(28.030)
Dividendo pagadero en swaps	2	(31.031)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(263.301)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(613.670)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(13.589)
Otros pasivos		(3.824)
Total de pasivos		(2.347.091)
Total de patrimonio neto		19.637.404

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	28.063,946
Clase AFH	764,000
Clase AGH	599,522
Clase AU	134.199,089
Clase DEH	7.908,621
Clase DU	337.015,020
Clase IEH	108.431,798
Clase IGH	26.698,188
Clase IU	67.144,306
Clase XGH	548.081,680
Clase ZE	80,000
Clase ZEH	83,000
Clase ZGH	1.774,835
Clase ZU	100,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	14,8309 ¹	15,5801 ¹	15,3714 ¹
Clase AFH	13,3909 ²	14,1612 ²	13,9949 ²
Clase AGH	16,1906 ³	16,7573 ³	16,4018 ³
Clase AU	17,2876	17,6966	17,2872
Clase DEH	11,3655 ¹	12,0140 ¹	11,9135 ¹
Clase DU	13,1644	13,5433	13,2965
Clase IEH	21,8492 ¹	22,7694 ¹	22,2720 ¹
Clase IGH	23,6037 ³	24,2352 ³	23,5814 ³
Clase IU	25,1613	25,5384	24,8005
Clase XGH	10,6525 ³	10,8426 ³	10,4372 ³
Clase ZE	11,1038 ¹	11,0174 ¹	10,1161 ¹
Clase ZEH	9,4994 ¹	9,9289 ¹	9,7263 ¹
Clase ZGH	16,1995 ³	16,6367 ³	16,1525 ³
Clase ZU	10,4522	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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		24.741.485
Ingresos		
Dividendos, neto	2	211.641
Interés bancario	2	38.266
Ingresos por intereses en swaps		220.970
Ingresos por intereses en contratos de futuros		12.507
Total de ingresos		483.384
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(146.935)
Interés bancario	2	(3.916)
Dividendos pagados en swaps		(139.152)
Gastos por intereses en swaps		(144.900)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(54)
Gastos operativos	3, 5	(49.932)
Total de gastos		(484.889)
(Pérdida) neta de inversiones		(1.505)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(2.052.470)
Ganancia neta realizada en swaps		1.400.931
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.659.989)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		1.027.747
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(100.569)
(Pérdida) neta realizada		(1.384.350)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(799.637)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(122.677)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(31.567)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		280.990
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(672.891)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(2.058.746)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		28.670.689
Reembolsos de acciones		(31.716.024)
Total de movimientos de capital		(3.045.335)
Patrimonio neto al final del ejercicio		19.637.404

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	19.637.404	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 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	405.167.576
Efectivo en el banco	2	33.693.370
Por cobrar para la venta de inversiones		1.810.282
Suscripciones por cobrar		1.157.718
Interés por cobrar en swaps	2	270.548
Interés y dividendos por cobrar, neto		5.247.913
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	507.363
Total de activos		447.854.770
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(1.117.098)
Reembolsos pagaderos		(4.113.526)
Interés pagadero en swaps	2	(589.206)
Pago por adelantado cobrado en swaps	2	(51.210)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(4.837.958)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(5.585.899)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(233.866)
Otros pasivos		(38.490)
Total de pasivos		(16.567.253)
Total de patrimonio neto		431.287.517

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.141,754
Clase IE	85,000
Clase ZE	88.337,141
Clase 1E	9.677.406,820
Clase 1EP	53.679,268
Clase 1GH	150.695,633
Clase 1UH	184.976,506
Clase 2E	19.766.231,059
Clase 2EP	15.324,613
Clase 2GC	76,000
Clase 2GH	7.383,713
Clase 4GH	165.803,293
Clase 8E	13.992.640,928
Clase 8EP	124.630,995
Clase 8GC	1.303,020
Clase 8GH	433.241,882

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		980.879.073
Ingresos		
Dividendos, neto	2	62.755
Interés sobre bonos, neto	2	24.441.473
Interés bancario	2	30.214
Ingresos por intereses en swaps		5.069.943
Ingresos por intereses en contratos de futuros		390.856
Otros ingresos		335
Total de ingresos		29.995.576
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(3.853.369)
Interés bancario	2	(242.494)
Gastos por intereses en swaps		(17.791.392)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(233.172)
Gastos operativos	3, 5	(606.322)
Comisiones varias	4	(32)
Total de gastos		(22.726.781)
Ingresos netos de inversiones		7.268.795
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(54.999.381)
Ganancia neta realizada en swaps		240.798
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(3.739.435)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		59.247.729
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(825.968)
(Pérdida) neta realizada		(76.257)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(25.387.502)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		15.010.568
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(4.000.444)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(22.180.450)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(36.557.828)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(29.365.290)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		115.900.966
Reembolsos de acciones		(635.953.718)
Dividendos	7	(173.514)
Total de movimientos de capital		(520.226.266)
Patrimonio neto al final del ejercicio		431.287.517

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	431.287.517	980.879.073	1.105.181.704

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	9,2862	9,7720	—
Clase IE	9,3680	9,8024	—
Clase ZE	9,5447	9,9967	10,2122
Clase 1E	9,3721	9,8622	10,1181
Clase 1EP	7,9045	8,7147	9,2533
Clase 1GH	9,7939 ¹	10,1307 ¹	10,3276 ¹
Clase 1UH	10,1457 ²	10,4460 ²	10,6393 ²
Clase 2E	9,6387	10,0810	10,2797
Clase 2EP	8,1165	8,8919	9,3705
Clase 2GC	8,4780 ¹	9,1211 ¹	9,5453 ¹
Clase 2GH	10,0735 ¹	10,3563 ¹	10,4925 ¹
Clase 4GH	10,3070 ¹	10,5443 ¹	10,6305 ¹
Clase 8E	9,6172	10,0626	10,2650
Clase 8EP	8,1203	8,8993	9,3952
Clase 8GC	8,4801 ¹	9,1415 ¹	9,5801 ¹
Clase 8GH	10,0599 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 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	16.460.178
Efectivo en el banco	2	1.521.050
Interés por cobrar en swaps	2	7.923
Interés y dividendos por cobrar, neto		165.418
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	79.781
Otros activos		5.767
Total de activos		18.240.117
Pasivos		
Interés pagadero en swaps	2	(17.097)
Pago por adelantado cobrado en swaps	2	(1.722)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(51.507)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(284.885)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.517)
Otros pasivos		(1.739)
Total de pasivos		(358.467)
Total de patrimonio neto		17.881.650

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	20.319,717
Clase AFH	92,200
Clase AKH	84,000
Clase ANH	830,000
Clase AUH	572,957
Clase DE	17.592,059
Clase IE	373.561,836
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	89,000
Clase LGH	67,800
Clase XE	3.298,170
Clase XGH	1.211.045,797
Clase XUH	92,000
Clase YE	82,001
Clase YGH	68,800
Clase YUH	91,000
Clase ZE	81,997
Clase ZFH	90,200
Clase ZGH	67,800
Clase ZUH	91,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		44.628.404
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	876.866
Interés bancario	2	9.466
Ingresos por intereses en swaps		238.028
Ingresos por intereses en contratos de futuros		34.904
Otros ingresos		2
Total de ingresos		1.159.266
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(13.515)
Interés bancario	2	(13.140)
Gastos por intereses en swaps		(670.289)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(24.740)
Gastos operativos	3, 5	(37.233)
Comisiones varias	4	(15)
Total de gastos		(758.932)
Ingresos netos de inversiones		400.334
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(4.007.497)
Ganancia neta realizada en swaps		219.915
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.605.494)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		3.542.882
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		294.877
(Pérdida) neta realizada		(1.555.317)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(75.423)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		342.495
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		102.049
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(1.315.904)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(946.783)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(2.101.766)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		4.326.430
Reembolsos de acciones		(28.971.361)
Dividendos	7	(57)
Total de movimientos de capital		(24.644.988)
Patrimonio neto al final del ejercicio		17.881.650

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	17.881.650	44.628.404	53.361.804

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	9,3843	9,9429	10,2349
Clase AFH	9,1791 ¹	9,8101 ¹	10,1268 ¹
Clase AKH	94,5085 ²	99,6323 ²	102,3358 ²
Clase ANH	9,7009 ³	10,1446 ³	10,3661 ³
Clase AUH	10,2804 ⁴	10,6635 ⁴	10,8977 ⁴
Clase DE	9,1244	9,7208	10,0608
Clase IE	9,6940	10,2044	10,4353
Clase IEP	8,2812	9,0524	9,4983
Clase IGH	10,1721 ⁵	10,5320 ⁵	10,6920 ⁵
Clase INH	9,8776 ³	10,2572 ³	10,4013 ³
Clase IU	9,3333 ⁴	10,0660 ⁴	10,8726 ⁴
Clase IUH	10,5992 ⁴	10,9297 ⁴	11,0910 ⁴
Clase JE	9,6769	10,1884	10,4159
Clase JGH	10,1878 ⁵	10,5456 ⁵	10,6939 ⁵
Clase JUH	10,5575 ⁴	10,8783 ⁴	11,0321 ⁴
Clase LE	9,7648	10,2635	10,4800
Clase LEP	8,4066	9,1580	9,5877
Clase LGH	10,2762 ⁵	10,6048 ⁵	10,7382 ⁵
Clase XE	10,0968	10,5895	10,7859
Clase XGH	9,9837 ⁵	10,2913 ⁵	10,4148 ⁵
Clase XUH	10,4837 ⁴	10,7628 ⁴	10,8737 ⁴
Clase YE	9,6238	10,1443	10,3910
Clase YGH	10,1032 ⁵	10,4650 ⁵	10,6432 ⁵
Clase YUH	10,4761 ⁴	10,8066 ⁴	10,9872 ⁴
Clase ZE	9,5978	10,1272	10,3835
Clase ZFH	9,3880 ¹	9,9880 ¹	10,2620 ¹
Clase ZGH	10,1022 ⁵	10,4758 ⁵	10,6642 ⁵
Clase ZUH	10,5291 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 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	75.567.235
Efectivo en el banco	2	4.164.050
Por cobrar para la venta de inversiones		584.521
Suscripciones por cobrar		197
Interés por cobrar en swaps	2	2.308.535
Interés y dividendos por cobrar, neto		52.014
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	47.139
Otros activos		230.192
Total de activos		82.953.883
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(1.581.523)
Interés pagadero en swaps	2	(1.183.975)
Dividendo pagadero en swaps	2	(255.219)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(1.748.411)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(79.651)
Otros pasivos		(19.189)
Total de pasivos		(4.867.968)
Total de patrimonio neto		78.085.915

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.591.069,034
Clase AEP	28.481,437
Clase AUH	77,000
Clase DE	2.051.414,732
Clase IE	892.897,803
Clase IGH	13.209,827
Clase LE	1.044.554,591
Clase XGH	377.248,938
Clase ZE	144.712,555
Clase ZF	76,000
Clase ZFH	77,000
Clase ZGH	57,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AE	12,3069	12,1389	11,9823
Clase AEP	12,3610	12,3867	12,3580
Clase AUH	13,7357 ¹	13,1642 ¹	12,8933 ¹
Clase DE	11,8833	11,7798	11,7839
Clase IE	12,9068	12,6164	12,5007
Clase IGH	13,4607 ²	12,9699 ²	12,7513 ²
Clase LE	13,1617	12,8174	12,6752
Clase XGH	14,9610 ²	14,3002 ²	13,8662 ²
Clase ZE	12,9456	12,6671	12,5092
Clase ZF	11,4147 ³	11,5379 ³	12,2367 ³
Clase ZFH	12,0814 ³	11,9019 ³	11,8267 ³
Clase ZGH	13,5842 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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		123.839.076
Ingresos		
Dividendos, neto	2	2.511.785
Interés bancario	2	10.530
Ingresos por intereses en swaps		447.056
Otros ingresos		166
Total de ingresos		2.969.537
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.069.086)
Interés bancario	2	(11.172)
Dividendos pagados en swaps		(1.598.311)
Gastos por intereses en swaps		(405.869)
Gastos operativos	3, 5	(264.971)
Total de gastos		(3.349.409)
(Pérdida) neta de inversiones		(379.872)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(1.742.027)
Ganancia neta realizada en swaps		729.073
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(336.440)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		39.653
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(36.291)
Ganancia neta realizada en reembolso de impuestos		20
(Pérdida) neta realizada		(1.346.012)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		3.181.145
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(1.701.408)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		46.192
Cambio neto en ganancia no realizada		1.525.929
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(199.955)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		8.746.159
Reembolsos de acciones		(54.293.849)
Dividendos	7	(5.516)
Total de movimientos de capital		(45.553.206)
Patrimonio neto al final del ejercicio		78.085.915

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
EUR	78.085.915	123.839.076	235.387.755

Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	87.795.769
Efectivo en el banco	2	1.783.847
Suscripciones por cobrar		18.109
Interés por cobrar en swaps	2	14.721
Interés y dividendos por cobrar, neto		76.770
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	21.617
Total de activos		89.710.833
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(52.820)
Interés pagadero en swaps	2	(43.535)
Dividendo pagadero en swaps	2	(83.311)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(570.509)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(77.684)
Otros pasivos		(12.005)
Total de pasivos		(839.864)
Total de patrimonio neto		88.870.969

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	977,889
Clase AU	1.892,784
Clase DEH	343,599
Clase DU	21.360,497
Clase IU	221.932,376
Clase ZU	57,000
Clase 1E	3.140.918,553
Clase 1EH	368.566,336
Clase 1U	1.122.973,971
Clase 2E	2.804,467
Clase 2U	186,000
Clase 3U	45.196,000
Clase 8E	295.471,699
Clase 8U	1.324.966,558
Clase 9U	2.334.763,880

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	13,5117 ¹	16,4272 ¹	14,7944 ¹
Clase AU	14,8565	17,4066	15,4832
Clase DEH	13,2239 ¹	16,1610 ¹	14,6365 ¹
Clase DU	14,5400	17,1211	15,3058
Clase IU	15,4273	17,9132	15,7911
Clase ZU	15,3226	17,8411	15,7432
Clase 1E	7,1058 ¹	8,1204 ¹	6,8306 ¹
Clase 1EH	4,9237 ¹	5,9805 ¹	5,3803 ¹
Clase 1U	7,7187	9,0336	8,0266
Clase 2E	16,2312 ¹	18,3931 ¹	15,3339 ¹
Clase 2U	15,4950	17,9863	15,8326
Clase 3U	4,3987	5,1096	4,5061
Clase 8E	7,9140 ¹	8,9701 ¹	7,4837 ¹
Clase 8U	8,5451	9,9191	8,7414
Clase 9U	15,4564	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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		125.198.445
Ingresos		
Dividendos, neto	2	867.205
Interés bancario	2	56.579
Ingresos por intereses en swaps		617.072
Total de ingresos		1.540.856
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.186.291)
Interés bancario	2	(2.845)
Dividendos pagados en swaps		(189.375)
Gastos por intereses en swaps		(818.868)
Gastos operativos	3, 5	(163.437)
Total de gastos		(2.360.816)
(Pérdida) neta de inversiones		(819.960)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(7.865.121)
Ganancia neta realizada en swaps		1.255.583
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(133.731)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(22)
(Pérdida) neta realizada		(6.743.291)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(10.789.450)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(40.473)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(3.840)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(10.833.763)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(18.397.014)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		44.296.113
Reembolsos de acciones		(62.226.575)
Total de movimientos de capital		(17.930.462)
Patrimonio neto al final del ejercicio		88.870.969

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	88.870.969	125.198.445	112.622.890

Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	73.822.965
Efectivo en el banco	2	2.184.180
Depósitos a plazo	2, 19	4.915.320
Suscripciones por cobrar		910
Interés por cobrar en swaps	2	236.043
Dividendo por cobrar en swaps		206.059
Interés y dividendos por cobrar, neto		118.389
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	1.694
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	853.780
Otros activos	20	60.049
Total de activos		82.399.389
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(872.576)
Reembolsos pagaderos		(294)
Interés pagadero en swaps	2	(436.682)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(97.327)
Otros pasivos		(12.478)
Total de pasivos		(1.419.357)
Total de patrimonio neto		80.980.032

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	52,000
Clase AU	19.215,185
Clase DEH	12.023,296
Clase DU	618,597
Clase IU	94.720,000
Clase ZU	58,000
Clase 1E	14.092.034,832
Clase 1U	852.580,848
Clase 2E	52,000
Clase 2U	517,284
Clase 8E	313.153,819
Clase 8U	177.502,303

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	12,3134 ¹	14,5886 ¹	15,0223 ¹
Clase AU	13,5426	15,4367	15,6740
Clase DEH	12,1476 ¹	14,4782 ¹	14,9762 ¹
Clase DU	13,3338	15,2753	15,5884
Clase IU	14,2037	16,0451	16,1456
Clase ZU	14,0143	15,8776	15,9900
Clase 1E	4,7036 ¹	5,2295 ¹	5,0213 ¹
Clase 1U	5,1181	5,8275	5,9106
Clase 2E	14,7996 ¹	16,3297 ¹	15,5305 ¹
Clase 2U	14,1217	15,9419	16,0307
Clase 8E	5,2661 ¹	5,8070 ¹	5,5302 ¹
Clase 8U	5,7939	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 cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		99.127.304
Ingresos		
Dividendos, neto	2	912.758
Interés bancario	2	215.605
Ingresos por dividendos en swaps		700
Ingresos por intereses en swaps		401.410
Total de ingresos		1.530.473
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.197.855)
Interés bancario	2	(6.624)
Gastos por intereses en swaps		(940.114)
Gastos operativos	3, 5	(154.011)
Total de gastos		(2.298.604)
(Pérdida) neta de inversiones		(768.131)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(3.376.590)
Ganancia neta realizada en swaps		455.385
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(46.571)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(70.125)
(Pérdida) neta realizada		(3.037.901)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(7.302.213)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(1.011.932)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(12.645)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(8.326.790)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(12.132.822)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		5.708.287
Reembolsos de acciones		(11.722.737)
Total de movimientos de capital		(6.014.450)
Patrimonio neto al final del ejercicio		80.980.032

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	80.980.032	99.127.304	209.555.266

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	187.368.122
Efectivo en el banco	2	4.981.820
Interés por cobrar en swaps	2	4.030.635
Suscripciones por cobrar		7.821
Interés y dividendos por cobrar, neto		27.935
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	1.107.623
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	2.142.039
Total de activos		199.665.995
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(115.274)
Interés pagadero en swaps	2	(2.953)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(72.655)
Otros pasivos		(19.579)
Total de pasivos		(210.461)
Total de patrimonio neto		199.455.534

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	277.991,211
Clase AFH	225.781,729
Clase AGH	72.671,597
Clase ASH	725.225,281
Clase AU	753.136,039
Clase DEH	205.173,512
Clase DU	397.240,047
Clase IEH	364.809,006
Clase IG	64,000
Clase IGH	2.688.419,609
Clase IU	347.435,513
Clase NG	22.574,043
Clase XU	4.793.550,062
Clase ZEH	24.307,319
Clase ZFH	160,000
Clase ZGH	237.629,581
Clase ZU	106.450,500

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del ejercicio		547.084.733
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	6.279.369
Interés bancario	2	457.874
Ingresos por intereses en swaps		61.628
Total de ingresos		6.798.871
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.178.446)
Interés bancario	2	(17.307)
Gastos por intereses en swaps		(747.896)
Gastos operativos	3, 5	(512.069)
Comisiones varias	4	(1.194)
Total de gastos		(2.456.912)
Ingresos netos de inversiones		4.341.959
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		496.955
(Pérdida) neta realizada en swaps		(24.565.363)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(7.805.231)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(587.061)
(Pérdida) neta realizada		(32.460.700)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		346.974
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(15.715.092)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(99.296)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(15.467.414)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(43.586.155)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		104.380.461
Reembolsos de acciones		(408.423.505)
Total de movimientos de capital		(304.043.044)
Patrimonio neto al final del ejercicio		199.455.534

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	199.455.534	547.084.733	528.893.598

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
Clase AEH	10,6456 ¹	12,2529 ¹	8,4906 ¹
Clase AFH	7,7799 ²	9,0157 ²	6,2739 ²
Clase AGH	11,5943 ³	13,1736 ³	9,0951 ³
Clase ASH	6,1489 ⁴	6,9266 ⁴	4,7702 ⁴
Clase AU	13,0569	14,5604	10,0129
Clase DEH	8,0276 ¹	9,2625 ¹	6,4457 ¹
Clase DU	9,8496	11,0114	7,6039
Clase IEH	15,8324 ¹	18,1687 ¹	12,4903 ¹
Clase IG	14,7608 ³	15,4257 ³	10,0476 ³
Clase IGH	17,2065 ³	19,4921 ³	13,3493 ³
Clase IU	19,3974	21,5661	14,7124
Clase NG	14,3316 ³	14,9110 ³	9,6735 ³
Clase XU	20,8308	22,9751	15,5436
Clase ZEH	6,6838 ¹	7,6710 ¹	5,2751 ¹
Clase ZFH	6,3961 ²	7,3902 ²	5,1075 ²
Clase ZGH	9,8431 ³	11,1531 ³	7,6437 ³
Clase ZU	7,9952	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 31 de marzo de 2023

			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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					ISLAS CAIMÁN (continuación)				
EUR	3.708.000	APA Infrastructure Limited 1.25% 15/03/2033	2.970.329	0,35	USD	1.200.000	Tencent Holdings Limited 3.93% 19/01/2038	1.002.923	0,12
EUR	2.019.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	1.673.550	0,20	Total de Islas Caimán			9.955.465	1,19
EUR	1.030.000	Ausgrid Finance Pty Limited 1.25% 30/07/2025	1.061.276	0,13	DINAMARCA				
USD	1.916.000	Ausgrid Finance Pty Limited 4.35% 01/08/2028	1.825.133	0,22	EUR	576.000	Danske Bank AS FRN 15/05/2031	551.820	0,07
USD	3.331.000	Australia & New Zealand Banking Group Limited FRN 25/11/2035	2.579.561	0,31	USD	7.770.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	6.804.499	0,81
EUR	1.539.000	Goodman Australia Finance Pty Limited 1.38% 27/09/2025	1.534.423	0,18	Total de Dinamarca			7.356.319	0,88
EUR	5.868.000	NBN Company Limited 4.13% 15/03/2029	6.522.790	0,79	FINLANDIA				
USD	2.597.000	SGSP Australia Assets Pty 3.50% 07/07/2027	2.431.441	0,29	EUR	5.711.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	5.261.236	0,63
USD	7.087.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	6.842.357	0,83	Total de Finlandia			5.261.236	0,63
Total de Australia			27.440.860	3,30	FRANCIA				
BERMUDAS					USD	2.674.000	BNP Paribas SA FRN 15/09/2029	2.233.041	0,27
USD	3.035.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	2.845.396	0,34	USD	1.500.000	BNP Paribas SA FRN 20/01/2033	1.259.368	0,15
Total de Bermudas			2.845.396	0,34	USD	4.346.000	BNP Paribas SA FRN 13/01/2029	4.349.000	0,52
CANADÁ					EUR	3.200.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	2.503.650	0,30
USD	2.137.000	Enbridge Inc. 5.70% 08/03/2033	2.225.878	0,27	USD	2.317.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	2.032.777	0,24
Total de Canadá			2.225.878	0,27	USD	567.000	BPCE SA FRN 19/07/2033	556.767	0,07
ISLAS CAIMÁN					GBP	5.500.000	Credit Agricole SA 4.88% 23/10/2029	6.714.970	0,81
USD	732.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	623.927	0,07	EUR	3.800.000	Electricite de France SA 4.25% 25/01/2032	4.099.845	0,49
GBP	2.333.000	Southern Water Services Finance Limited 1.63% 30/03/2027	2.496.647	0,30	EUR	400.000	Electricite de France SA FRN 06/12/2171	426.233	0,05
GBP	2.472.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	2.647.544	0,32	EUR	2.451.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	2.171.395	0,26
GBP	1.840.000	Southern Water Services Finance Limited 3.00% 28/05/2037	1.675.156	0,20	EUR	2.600.000	SANEF SA 1.88% 16/03/2026	2.687.507	0,33
USD	566.000	Tencent Holdings Limited 3.24% 03/06/2050	373.842	0,04	Total de Francia			29.034.553	3,49
USD	1.208.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	1.135.426	0,14	ALEMANIA				
					EUR	1.700.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	1.526.753	0,18
					EUR	6.800.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	5.460.603	0,64
					EUR	2.500.000	Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032	2.768.797	0,33
					EUR	3.700.000	Commerzbank AG FRN 29/12/2031	3.310.974	0,40
					EUR	1.500.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	1.533.680	0,18
					EUR	884.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	901.333	0,11

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valor nominal	Inversión			Valor nominal	Inversión				
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					
EUR	1.700.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	1.457.962	0,17	EUR	1.066.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 26/09/2029	975.992	0,11
USD	3.657.000	Deutsche Bank AG FRN 28/05/2032	2.828.803	0,34	EUR	901.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	849.008	0,10
EUR	1.300.000	Deutsche Bank AG FRN 05/09/2030	1.350.626	0,16	EUR	1.889.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	1.664.353	0,20
EUR	200.000	Deutsche Bank AG FRN 05/09/2030	207.789	0,02	EUR	232.000	Autostrade per l'Italia SpA 4.75% 24/01/2031	249.141	0,03
USD	469.000	Deutsche Bank AG FRN 10/02/2034	436.877	0,05	EUR	773.000	ENI SpA - Perp FRN	701.694	0,08
EUR	1.800.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	1.498.810	0,18	USD	300.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	262.262	0,03
EUR	200.000	Vier Gas Transport GmbH 0.13% 10/09/2029	172.183	0,02	Total de Italia		4.702.450	0,55	
EUR	100.000	Vier Gas Transport GmbH 0.50% 10/09/2034	73.786	0,01	JERSEY - ISLAS DEL CANAL				
EUR	1.300.000	Vier Gas Transport GmbH 1.50% 25/09/2028	1.254.932	0,15	USD	1.647.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	1.357.308	0,16
EUR	2.000.000	Vier Gas Transport GmbH 4.00% 26/09/2027	2.184.341	0,26	USD	2.563.645	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.94% 30/09/2040	2.086.783	0,25
EUR	2.900.000	Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	3.254.879	0,39	GBP	1.130.000	Heathrow Funding Limited 6.45% 10/12/2031	1.488.963	0,17
EUR	1.691.000	Volkswagen Leasing GmbH 0.63% 19/07/2029	1.477.507	0,18	Total de Jersey - Islas del Canal		4.933.054	0,58	
EUR	2.800.000	Vonovia SE 1.88% 28/06/2028	2.594.834	0,31	LUXEMBURGO				
EUR	1.300.000	Vonovia SE 5.00% 23/11/2030	1.324.647	0,16	EUR	2.000.000	Aroundtown SA 0.00% 16/07/2026	1.546.363	0,19
Total de Alemania		35.620.116	4,24	EUR	3.400.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	2.479.657	0,30	
INDIA				EUR	1.500.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	1.014.596	0,12	
USD	2.164.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	1.655.588	0,20	GBP	1.234.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	964.527	0,12
USD	1.580.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	1.387.652	0,17	USD	2.054.000	Aroundtown SA 5.38% 21/03/2029	1.524.915	0,18
Total de India		3.043.240	0,37	EUR	2.804.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.33% 13/08/2028	2.564.325	0,31	
IRLANDA				EUR	2.014.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	2.031.051	0,24	
EUR	2.019.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	1.989.501	0,24	EUR	7.100.000	Grand City Properties SA 0.13% 11/01/2028	5.453.963	0,65
EUR	1.954.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	1.982.423	0,24	USD	2.388.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl 6.13% 23/02/2038	2.461.247	0,30
EUR	2.111.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	1.971.910	0,24	EUR	3.288.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	2.686.629	0,32
EUR	3.365.000	Experian Europe DAC 1.56% 16/05/2031	3.101.230	0,37	EUR	1.858.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	1.518.174	0,18
EUR	2.243.000	Glencore Capital Finance DAC 0.75% 01/03/2029	1.973.789	0,24	EUR	1.851.000	Prologis International Funding II SA 0.75% 23/03/2033	1.335.601	0,16
Total de Irlanda		11.018.853	1,33						

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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	3.746.000	SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	3.740.699	0,45	EUR	2.200.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	1.795.210	0,22
		Total de Luxemburgo	29.321.747	3,52	GBP	1.300.000	Volkswagen Financial Services NV 1.38% 14/09/2028	1.310.205	0,16
PAÍSES BAJOS					GBP	1.200.000	Volkswagen Financial Services NV 2.13% 18/01/2028	1.283.937	0,15
EUR	1.101.000	ABB Finance BV 3.25% 16/01/2027	1.192.730	0,14	EUR	1.000.000	Vonovia Finance BV 1.00% 28/01/2041	527.554	0,06
EUR	302.000	Airbus SE 2.38% 09/06/2040	258.636	0,03	EUR	1.987.000	Wolters Kluwer NV 3.75% 03/04/2031	2.171.716	0,26
EUR	765.000	ASR Nederland NV FRN 07/12/2043	862.923	0,10	Total de Países Bajos			44.789.446	5,39
USD	1.977.000	Braskem Netherlands Finance BV 7.25% 13/02/2033	1.910.185	0,23	NORUEGA				
EUR	4.593.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	3.896.608	0,47	EUR	1.795.000	DNB Bank ASA FRN 18/01/2028	1.732.797	0,21
EUR	1.193.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	913.612	0,11	USD	2.599.000	DNB Bank ASA 1.13% 16/09/2026	2.333.680	0,28
EUR	1.379.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	1.056.053	0,13	EUR	1.967.000	DNB Bank ASA FRN 21/09/2027	2.102.443	0,25
GBP	3.381.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	4.408.849	0,53	Total de Noruega			6.168.920	0,74
USD	279.000	E.ON International Finance BV 6.65% 30/04/2038	305.628	0,04	ESPAÑA				
USD	1.067.000	EDP Finance BV 6.30% 11/10/2027	1.114.197	0,13	EUR	700.000	Banco de Sabadell SA FRN 10/11/2028	764.205	0,09
USD	1.355.000	Enel Finance International NV 6.80% 14/10/2025	1.404.353	0,17	GBP	1.500.000	Banco Santander SA FRN 30/08/2028	1.800.275	0,22
USD	2.159.000	ING Groep NV FRN 28/03/2033	1.973.162	0,24	GBP	3.000.000	Banco Santander SA 5.13% 25/01/2030	3.645.583	0,44
EUR	1.387.000	Nederlandse Gasunie NV 3.38% 11/07/2034	1.467.426	0,18	EUR	309.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	313.631	0,04
EUR	617.000	Nederlandse Gasunie NV 3.38% 11/07/2034	652.777	0,08	USD	1.503.000	Telefonica Emisiones SA 5.21% 08/03/2047	1.316.538	0,16
EUR	1.870.000	Sagax Euro Mtn NL BV 0.75% 26/01/2028	1.490.259	0,18	Total de España			7.840.232	0,95
EUR	1.379.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	1.241.734	0,15	SUECIA				
EUR	618.000	Stedin Holding NV 2.38% 03/06/2030	625.679	0,08	EUR	3.521.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	3.109.547	0,37
EUR	1.391.000	Stedin Holding NV 2.38% 03/06/2030	1.408.283	0,17	EUR	136.000	Sagax AB 2.00% 17/01/2024	143.941	0,02
EUR	4.823.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	4.411.810	0,53	Total de Suecia			3.253.488	0,39
EUR	1.000.000	Telefonica Europe BV FRN 12/05/2169	854.138	0,10	SUIZA				
EUR	100.000	Telefonica Europe BV FRN 12/05/2170	85.414	0,01	EUR	1.346.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	1.153.954	0,14
EUR	1.000.000	Telefonica Europe BV FRN 23/11/2171	1.108.425	0,13	USD	4.470.000	Credit Suisse AG 5.00% 09/07/2027	4.307.963	0,52
EUR	600.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	637.756	0,08	USD	5.276.000	Credit Suisse Group AG FRN 14/05/2032	4.251.058	0,51
EUR	4.355.000	Tennet Holding BV FRN 22/10/2168	4.420.187	0,53	USD	1.650.000	Credit Suisse Group AG FRN 01/04/2031	1.466.933	0,18

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	
Valor nominal	Inversión			Valor nominal	Inversión			
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	1.630.000	UBS Group AG Perp FRN	1.548.839	0,19	GBP	520.000	London Power Networks plc	
							6.13% 07/06/2027	667.166
		Total de Suiza	12.728.747	1,54	GBP	637.000	National Gas Transmission plc	
							5.75% 05/04/2035	795.855
REINO UNIDO					EUR	2.038.000	National Grid Electricity	
GBP	2.456.000	Anglian Water Osprey					Distribution East Midlands plc	
		Financing plc 2.00% 31/07/2028	2.452.147	0,29			3.95% 20/09/2032	2.171.674
EUR	1.459.000	Anglo American Capital plc			EUR	5.508.000	National Grid Electricity	
		4.75% 21/09/2032	1.598.336	0,19			Transmission plc 0.82%	
USD	691.000	Anglo American Capital plc					07/07/2032	4.588.410
		4.75% 16/03/2052	585.022	0,07	EUR	780.000	National Grid Electricity	
USD	9.062.000	Bae Systems plc 3.40%					Transmission plc 0.82%	
		15/04/2030	8.330.032	1,00			07/07/2032	649.775
USD	2.756.000	Barclays plc FRN 24/11/2032	2.197.182	0,26	GBP	1.077.000	National Grid Electricity	
USD	2.314.000	Barclays plc FRN 09/08/2033	2.288.507	0,27			Transmission plc 1.13%	
GBP	509.000	BAT International Finance plc					07/07/2028	1.096.602
		2.25% 26/06/2028	517.814	0,06	GBP	1.000.000	National Grid Gas plc 1.13%	
USD	2.278.000	BP Capital Markets plc FRN					14/01/2033	830.835
		22/09/2168	2.185.025	0,26	EUR	3.177.000	Nationwide Building Society	
EUR	2.269.000	BP Capital Markets plc - Perp					0.25% 14/09/2028	2.794.188
		FRN	2.285.597	0,27	USD	3.661.000	Nationwide Building Society	
EUR	1.636.000	British American Tobacco plc					1.50% 13/10/2026	3.223.298
		FRN 27/12/2169	1.450.886	0,18	GBP	1.654.000	NatWest Markets plc 6.38%	
GBP	840.000	Broadgate Financing plc 5.00%					08/11/2027	2.127.392
		05/10/2031	1.008.486	0,12	EUR	2.980.000	NGG Finance plc FRN	
GBP	530.000	Broadgate Financing plc 5.10%					05/09/2082	2.727.026
		05/04/2033	611.270	0,07	GBP	2.490.000	Northumbrian Water Finance	
EUR	1.237.000	Cadent Finance plc 0.63%					plc 2.38% 05/10/2027	2.745.475
		19/03/2030	1.084.241	0,13	GBP	1.126.000	Northumbrian Water Finance	
EUR	951.000	Cadent Finance plc 0.63%					plc 6.38% 28/10/2034	1.500.175
		19/03/2030	833.559	0,10	GBP	783.000	Phoenix Group Holdings plc	
GBP	1.820.000	Cadent Finance plc 2.25%					5.63% 28/04/2031	877.565
		10/10/2035	1.585.285	0,19	GBP	420.000	Santander UK plc Perp 10.06%	
USD	5.993.000	Diageo Capital plc 5.50%			GBP	587.000	Severn Trent Utilities Finance	
		24/01/2033	6.503.538	0,79			plc 5.25% 04/04/2036	720.417
GBP	2.826.000	Ds Smith plc 2.88% 26/07/2029	3.012.149	0,36	GBP	1.121.000	Telereal Securitisation plc FRN	
EUR	3.633.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	3.550.061	0,43			10/12/2033	1.241.193
EUR	479.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	507.302	0,06	GBP	136.000	Telereal Securitisation plc FRN	
EUR	28.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	29.654	0,00			10/12/2033	150.582
USD	7.628.000	HSBC Holdings plc FRN			GBP	457.237	Tesco Property Finance 1 plc	
		22/11/2032	6.221.725	0,75			7.62% 13/07/2039	639.651
USD	2.899.000	HSBC Holdings plc FRN			GBP	826.985	Tesco Property Finance 3 plc	
		11/08/2033	2.873.270	0,34			5.74% 13/04/2040	1.013.427
USD	1.591.000	HSBC Holdings plc FRN			GBP	1.256.000	Thames Water Kemble Finance	
		09/03/2044	1.687.139	0,20			plc 4.63% 19/05/2026	1.375.183
GBP	2.158.000	HSBC Holdings plc FRN			EUR	3.407.000	Thames Water Utilities Finance	
		16/11/2034	2.806.267	0,34			plc 0.88% 31/01/2028	3.200.477
GBP	378.000	Legal & General Group plc FRN			GBP	1.133.000	Virgin Money UK plc FRN	
		01/11/2050	407.091	0,05			19/08/2031	1.168.874

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)			
REINO UNIDO (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
GBP	700.000 Virgin Money UK plc FRN 22/06/2025	823.660	0,10	USD	7.825.000 Bank of America Corp. FRN 11/03/2032	6.537.599	0,78
EUR	2.112.000 Virgin Money UK plc FRN 29/10/2028	2.188.920	0,26	USD	4.487.000 Bank of America Corp. FRN 04/02/2033	3.802.536	0,46
GBP	1.282.000 Wessex Water Services Finance plc 5.13% 31/10/2032	1.565.513	0,19	USD	1.669.000 Bank of America Corp. FRN 23/07/2030	1.488.010	0,18
GBP	1.070.000 Western Power Distribution plc 3.50% 16/10/2026	1.249.594	0,15	USD	2.355.000 Bayer US Finance II LLC 4.63% 25/06/2038	2.159.457	0,26
	Total de Reino Unido	99.497.728	11,94	GBP	2.479.000 Becton Dickinson & Company 3.02% 24/05/2025	2.938.938	0,35
ESTADOS UNIDOS				USD	6.186.000 Berkshire Hathaway Finance Corp. 3.85% 15/03/2052	5.212.577	0,62
USD	3.098.000 AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	2.737.985	0,33	USD	2.011.000 Boeing Company 3.95% 01/08/2059	1.487.504	0,18
USD	916.000 AbbVie Inc. 4.88% 14/11/2048	884.754	0,11	USD	950.000 Boeing Company 5.93% 01/05/2060	950.106	0,11
USD	981.000 AEP Texas Inc. 3.45% 15/05/2051	717.754	0,09	USD	2.331.000 Broadcom Inc. 2.45% 15/02/2031	1.909.479	0,22
USD	6.055.000 Amazon.com Inc. 4.70% 01/12/2032	6.218.844	0,75	USD	1.150.000 Broadcom Inc. 4.15% 15/11/2030	1.067.686	0,13
USD	986.000 American Transmission Systems Inc. 2.65% 15/01/2032	833.492	0,10	USD	1.691.000 Brown-Forman Corp. 4.75% 15/04/2033	1.707.386	0,20
USD	1.515.000 Amgen Inc. 2.20% 21/02/2027	1.395.868	0,17	USD	1.271.000 Charter Communications Operating LLC 3.90% 01/06/2052	841.363	0,10
USD	1.755.000 Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	1.614.211	0,19	USD	2.314.000 Charter Communications Operating LLC 3.95% 30/06/2062	1.471.388	0,18
USD	2.025.000 Amgen Inc. 3.15% 21/02/2040	1.592.830	0,19	USD	385.000 Commonwealth Edison Company 4.00% 01/03/2049	323.188	0,04
USD	932.000 Amgen Inc. 4.20% 22/02/2052	791.820	0,09	USD	879.000 Commonwealth Edison Company 5.30% 01/02/2053	921.533	0,11
USD	673.000 Amgen Inc. 4.88% 01/03/2053	631.653	0,08	USD	833.000 Connecticut Light and Power Company 5.25% 15/01/2053	862.620	0,10
USD	2.578.000 Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	2.637.269	0,32	USD	340.000 Consolidated Edison Company of New York Inc. 3.95% 01/04/2050	282.815	0,03
USD	4.434.000 Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	4.557.911	0,55	USD	168.000 CSX Corp. 3.80% 01/11/2046	138.089	0,02
USD	1.326.000 Amgen Inc. 5.65% 02/03/2053	1.380.566	0,17	USD	814.000 CSX Corp. 3.80% 15/04/2050	664.339	0,08
USD	4.837.000 Amgen Inc. 5.75% 02/03/2063	5.036.152	0,59	USD	1.695.000 CSX Corp. 4.50% 15/11/2052	1.554.225	0,18
USD	2.296.000 Anheuser-Busch Companies LLC 4.70% 01/02/2036	2.287.920	0,27	USD	1.625.000 Daimler Truck Finance North America LLC 5.13% 19/01/2028	1.628.681	0,20
USD	2.887.000 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	3.033.824	0,37	USD	652.000 Duke Energy Ohio Inc. 5.65% 01/04/2053	687.476	0,08
EUR	958.000 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	861.926	0,10	USD	1.077.000 Emera US Finance LP 4.75% 15/06/2046	879.613	0,11
USD	7.882.000 Astrazeneca Finance LLC 4.88% 03/03/2028	8.114.742	0,97	USD	2.133.000 Enterprise Products Operating LLC 4.45% 15/02/2043	1.906.708	0,23
USD	6.872.000 AT&T Inc. 3.50% 15/09/2053	4.997.465	0,60	USD	8.317.000 Eversource Energy 2.55% 15/03/2031	7.102.785	0,84
CAD	1.500.000 AT&T Inc. 4.00% 25/11/2025	1.090.861	0,13				
GBP	400.000 AT&T Inc. 4.38% 14/09/2029	470.400	0,06				
USD	2.240.000 AT&T Inc. 4.90% 15/08/2037	2.151.261	0,26				
USD	1.514.000 Bank of America Corp. FRN 21/07/2032	1.222.360	0,15				
USD	1.814.000 Bank of America Corp. FRN 13/02/2031	1.537.631	0,18				
USD	2.219.000 Bank of America Corp. FRN 29/04/2031	1.877.645	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)				Bonos (continuación)			
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
USD	2.196.000 Eversource Energy 4.20% 27/06/2024	2.175.210	0,26	USD	3.086.000 Lowe's Companies Inc. 5.80% 15/09/2062	3.119.044	0,37
USD	2.567.000 Eversource Energy 5.45% 01/03/2028	2.660.933	0,32	USD	1.577.000 Metropolitan Edison Company 4.30% 15/01/2029	1.515.567	0,18
USD	2.527.000 Five Corners Funding Trust III 5.79% 15/02/2033	2.594.894	0,31	USD	4.583.000 Metropolitan Life Global Funding I 1.55% 07/01/2031	3.671.701	0,44
USD	2.224.000 Ford Motor Credit Company LLC 7.35% 04/11/2027	2.301.173	0,28	EUR	4.160.000 Metropolitan Life Global Funding I 3.75% 05/12/2030	4.464.288	0,54
USD	1.000.000 GE HealthCare Technologies Inc. 6.38% 22/11/2052	1.121.065	0,13	GBP	2.156.000 Morgan Stanley FRN 18/11/2033	2.719.207	0,33
USD	551.000 Georgia Power Company 3.70% 30/01/2050	428.583	0,05	USD	7.545.000 Nestle Holdings Inc. 5.00% 14/03/2028	7.843.045	0,95
USD	1.043.000 Georgia Power Company 5.13% 15/05/2052	1.022.849	0,12	EUR	8.033.000 Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	8.425.049	1,01
USD	879.000 Goodman USA Finance Five LLC 4.63% 04/05/2032	825.103	0,10	EUR	2.740.000 Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	2.929.252	0,35
USD	398.000 Goodman USA Finance Three LLC 3.70% 15/03/2028	367.814	0,04	USD	2.594.000 New York Life Global Funding 4.55% 28/01/2033	2.569.278	0,31
USD	637.000 Guardian Life Insurance Company of America 4.85% 24/01/2077	563.870	0,07	USD	2.241.000 New York Life Global Funding 4.85% 09/01/2028	2.276.101	0,27
USD	3.640.000 HCA Inc. 5.88% 01/02/2029	3.720.800	0,45	USD	553.000 New York Life Insurance Company 4.45% 04/04/2069	490.646	0,06
EUR	2.121.000 Honeywell International Inc. 4.13% 02/11/2034	2.339.171	0,28	USD	2.243.000 NiSource Inc. 1.70% 15/02/2031	1.774.748	0,21
USD	1.098.000 Indiana Michigan Power Company 5.63% 01/04/2053	1.142.825	0,14	USD	1.598.000 NiSource Inc. 4.38% 15/05/2047	1.388.936	0,17
USD	256.000 Intel Corp. 4.75% 25/03/2050	235.075	0,03	USD	6.959.000 NiSource Inc. 4.80% 15/02/2044	6.421.718	0,77
USD	855.000 Intel Corp. 4.90% 05/08/2052	797.068	0,10	USD	800.000 NiSource Inc. 5.00% 15/06/2052	762.658	0,09
USD	2.271.000 Intel Corp. 5.13% 10/02/2030	2.312.342	0,27	USD	1.189.000 NiSource Inc. 5.25% 30/03/2028	1.213.051	0,15
GBP	2.151.000 International Business Machines Corp. 4.88% 06/02/2038	2.570.173	0,31	USD	3.960.000 Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.45% 30/03/2051	2.919.421	0,35
USD	2.369.000 Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	1.984.932	0,24	USD	682.000 Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.63% 30/09/2059	508.170	0,06
USD	1.918.000 JPMorgan Chase & Company FRN 04/02/2032	1.543.025	0,18	USD	890.000 Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.85% 30/09/2047	715.420	0,09
USD	3.911.000 JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	3.250.134	0,39	USD	2.459.000 Oracle Corp. 2.88% 25/03/2031	2.110.231	0,26
USD	9.930.000 JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	8.350.308	0,99	USD	1.319.000 Oracle Corp. 3.60% 01/04/2040	1.024.017	0,12
USD	4.888.000 JPMorgan Chase & Company FRN 25/01/2033	4.190.081	0,50	USD	1.346.000 Oracle Corp. 3.65% 25/03/2041	1.042.551	0,12
USD	1.785.000 Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	1.572.790	0,19	USD	5.314.000 Pacific Gas and Electric Company 4.95% 01/07/2050	4.389.225	0,53
USD	1.220.000 Kinder Morgan Inc. 5.20% 01/06/2033	1.211.522	0,15	USD	1.174.000 Pacific Gas and Electric Company 6.75% 15/01/2053	1.213.714	0,15
GBP	4.150.000 Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	4.962.149	0,59	USD	718.000 Piedmont Natural Gas Company Inc. 3.35% 01/06/2050	506.801	0,06
USD	785.000 Lowe's Companies Inc. 5.75% 01/07/2053	800.564	0,10	USD	588.000 Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	523.027	0,06
				USD	2.680.000 Plains All American Pipeline LP 4.70% 15/06/2044	2.109.267	0,25
				USD	814.000 PPL Electric Utilities Corp 4.15% 15/06/2048	727.930	0,09
				USD	4.991.000 PPL Electric Utilities Corp. 5.00% 15/05/2033	5.098.683	0,61

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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	625.000	Public Service Company of Colorado 5.25% 01/04/2053	637.114	0,08	USD	1.297.000	UnitedHealth Group Inc. 6.05% 15/02/2063	1.477.629	0,18
USD	3.964.000	Public Service Electric and Gas Company 4.65% 15/03/2033	3.985.666	0,48	USD	4.039.000	Verizon Communications Inc. 4.40% 01/11/2034	3.842.697	0,46
USD	1.503.000	RELX Capital Inc. 4.75% 20/05/2032	1.494.230	0,18	USD	8.651.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	7.024.227	0,84
USD	2.470.000	Republic Services Inc. 4.88% 01/04/2029	2.499.865	0,30	USD	5.147.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.39% 15/03/2062	4.167.918	0,50
USD	2.829.000	Roche Holdings Inc. 1.93% 13/12/2028	2.490.477	0,30	USD	4.644.000	Williams Cos IncThe 2.60% 15/03/2031	3.908.103	0,46
USD	516.000	Southern California Edison Company 3.65% 01/02/2050	398.248	0,05	USD	1.274.000	Williams Partners LP 4.85% 01/03/2048	1.131.849	0,14
USD	734.000	Southern California Edison Company 4.13% 01/03/2048	610.003	0,07	Total de Estados Unidos			299.994.260	35,94
USD	744.000	Southern California Gas Company 3.95% 15/02/2050	601.754	0,07	Total de bonos			647.031.988	77,58
EUR	1.105.000	Southern Company FRN 15/09/2081	951.844	0,11	Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
EUR	134.000	Southern Company FRN 15/09/2081	115.427	0,01	CANADÁ				
USD	956.000	Southern Company 5.70% 15/10/2032	1.008.037	0,12	CAD	6.845.000	Canada (Govt of) 1.00% 01/09/2026	4.700.079	0,56
USD	2.299.000	Stellantis Finance USA Inc. 6.38% 12/09/2032	2.413.061	0,28	CAD	4.186.000	Canada (Govt of) 2.75% 01/12/2048	2.918.415	0,35
USD	1.894.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.90% 15/09/2044	1.755.164	0,21	Total de Canadá			7.618.494	0,91
GBP	1.514.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	1.807.349	0,22	ALEMANIA				
USD	1.048.000	T-Mobile USA Inc. 2.63% 15/02/2029	924.343	0,11	EUR	3.557.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2052	1.989.871	0,24
USD	1.974.000	T-Mobile USA Inc. 2.88% 15/02/2031	1.704.125	0,20	EUR	3.118.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 15/09/2028	2.904.403	0,35
USD	1.615.000	T-Mobile USA Inc. 3.40% 15/10/2052	1.164.894	0,14	GBP	4.900.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3.88% 02/09/2025	5.997.035	0,72
USD	3.732.000	T-Mobile USA Inc. 4.95% 15/03/2028	3.767.995	0,45	Total de Alemania			10.891.309	1,31
USD	1.901.000	T-Mobile USA Inc. 5.05% 15/07/2033	1.911.294	0,23	JAPÓN				
USD	441.000	T-Mobile USA Inc. 5.80% 15/09/2062	457.214	0,05	JPY	549.600.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.40% 20/06/2049	3.360.161	0,40
USD	566.000	TSMC Arizona Corp. 2.50% 25/10/2031	485.558	0,06	Total de Japón			3.360.161	0,40
USD	2.866.000	UnitedHealth Group Inc. 4.50% 15/04/2033	2.851.246	0,34	SUPRANACIONAL				
USD	1.815.000	UnitedHealth Group Inc. 4.95% 15/05/2062	1.768.277	0,21	EUR	2.300.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.00% 15/01/2027	2.231.739	0,27
USD	5.608.000	UnitedHealth Group Inc. 5.30% 15/02/2030	5.918.208	0,71					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*					Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión						Valor nominal	Inversión			
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)					
SUPRANACIONAL (continuación)						NORUEGA					
USD	5.465.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 11/03/2025		5.124.615	0,61	USD	200.000	DNB Bank ASA FRN 09/10/2026		201.942	0,02
USD	4.000.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 24/11/2027		3.494.557	0,42			Total de Noruega		201.942	0,02
		Total de supranacional		10.850.911	1,30						
REINO UNIDO						ESTADOS UNIDOS					
GBP	996.000	United Kingdom Gilt 3.75% 22/07/2052		1.212.170	0,15	USD	1.936.000	Atlantic City Electric 2.30% 15/03/2031		1.636.540	0,20
		Total de Reino Unido		1.212.170	0,15	USD	1.352.000	Broadcom Inc. 4.93% 15/05/2037		1.231.822	0,15
						USD	5.623.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030		4.930.407	0,59
						USD	3.920.000	GE HealthCare Technologies Inc. 5.86% 15/03/2030		4.105.880	0,50
						USD	3.141.000	HCA Inc. 3.63% 15/03/2032		2.770.772	0,33
						USD	1.200.000	HCA Inc. 4.63% 15/03/2052		1.000.803	0,12
						USD	1.548.000	Verizon Communications Inc. 2.36% 15/03/2032		1.272.502	0,15
		Total de Estados Unidos		44.838.720	5,37			Total de Estados Unidos		16.948.726	2,04
		Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda		78.771.765	9,44			Total de bonos		18.249.693	2,19
		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		725.803.753	87,02			Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		18.249.693	2,19
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	817.000	NBN Company Limited 2.63% 05/05/2031		692.833	0,08	USD	2.913.000	APA Infrastructure Limited 4.25% 15/07/2027		2.820.688	0,34
		Total de Australia		692.833	0,08			Total de Australia		2.820.688	0,34
PAÍSES BAJOS						BERMUDAS					
USD	409.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023		406.192	0,05	USD	700.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028		695.746	0,08
		Total de Países Bajos		406.192	0,05			Total de Bermudas		695.746	0,08
						CANADÁ					
CAD	1.980.000	Rogers Communications Inc. 3.65% 31/03/2027								1.410.868	0,17
		Total de Canadá						Total de Canadá		1.410.868	0,17

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*
---------------	-----------	----------------------------	-------------------------------

Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)

Bonos (continuación)

PORTUGAL

EUR	200.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	23.902	0,00
Total de Portugal			23.902	0,00

ESTADOS UNIDOS

USD	883.000	Metropolitan Edison Company 5.20% 01/04/2028	892.601	0,11
USD	2.830.000	Metropolitan Life Global Funding I 5.15% 28/03/2033	2.860.309	0,34
USD	4.100.000	Pacific Life Global Funding II 4.90% 04/04/2028	4.105.179	0,49
USD	495.000	Peachtree Fund Trust 3.98% 15/02/2025	480.897	0,06
USD	2.991.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.27% 15/05/2047	2.526.194	0,30
Total de Estados Unidos			10.865.180	1,30

Total de bonos **15.816.384** **1,89**

**Total de otros valores mobiliarios e instrumentos
del mercado monetario** **15.816.384** **1,89**

Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios

Fondos

IRLANDA

35.269.617	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	35.269.617	4,23
Total de Irlanda		35.269.617	4,23

Total de fondos **35.269.617** **4,23**

**Total de organismos de inversión colectiva en
valores mobiliarios** **35.269.617** **4,23**

Valor total de las inversiones **795.139.447** **95,33**

(Coste total: 848.154.775 USD)

* Diferencias menores debido al redondeo.

** Título a su valor razonable.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

		Valor de mercado		% de valor				Valor de mercado		% de valor		
Valor nominal	Inversión	EUR	liquidativo*	Valor nominal	Inversión	EUR	liquidativo*	Valor nominal	Inversión	EUR	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	483.000	APA Infrastructure Limited 1.25% 15/03/2033	356.124	0,44	EUR	788.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	668.178	0,83			
EUR	239.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	182.344	0,23	Total de Finlandia				668.178	0,83		
EUR	94.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	71.717	0,09	FRANCIA							
EUR	876.000	Ausgrid Finance Pty Limited 1.25% 30/07/2025	830.779	1,04	EUR	399.000	AXA SA 3.75% 12/10/2030	401.950	0,50			
EUR	594.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd 0.63% 25/08/2030	472.458	0,59	EUR	235.000	AXA SA FRN 10/03/2043	214.427	0,27			
EUR	723.000	Australia & New Zealand Banking Group Limited FRN 05/05/2031	630.207	0,79	USD	930.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.60% 04/10/2026	751.701	0,94			
EUR	494.000	Goodman Australia Finance Pty Limited 1.38% 27/09/2025	453.340	0,57	EUR	200.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.63% 14/09/2032	197.210	0,25			
EUR	431.000	National Australia Bank Limited 2.13% 24/05/2028	403.832	0,50	EUR	600.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	432.081	0,54			
EUR	645.000	NBN Company Limited 4.13% 15/03/2029	659.922	0,82	USD	1.241.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	1.002.134	1,25			
EUR	700.000	Westpac Banking Corp. 3.80% 17/01/2030	695.895	0,87	EUR	200.000	BPCE SA 4.00% 29/11/2032	200.497	0,25			
Total de Australia			4.756.618	5,94	EUR	200.000	Credit Agricole SA 1.13% 24/02/2029	173.331	0,22			
BÉLGICA				EUR	400.000	Credit Agricole SA 2.50% 29/08/2029	375.213	0,47				
EUR	325.000	Anheuser-Busch InBev SA/ NV 3.70% 02/04/2040	307.325	0,38	EUR	400.000	Credit Agricole SA 4.00% 18/01/2033	408.616	0,51			
EUR	52.000	Anheuser-Busch InBev SA/ NV 3.70% 02/04/2040	49.172	0,06	GBP	400.000	Credit Agricole SA 4.88% 23/10/2029	449.502	0,56			
EUR	500.000	Argenta Spaarbank NV FRN 08/02/2029	407.042	0,51	EUR	600.000	Danone SA 2.60% 28/06/2023	599.479	0,75			
EUR	400.000	Belfius Bank SA - Perp FRN	286.771	0,36	EUR	100.000	Electricite de France SA 2.00% 09/12/2049	60.873	0,08			
EUR	1.200.000	Elia Transmission Belgium SA 0.88% 28/04/2030	1.007.184	1,27	EUR	100.000	Electricite de France SA 4.25% 25/01/2032	99.306	0,12			
Total de Bélgica			2.057.494	2,58	EUR	500.000	Electricite de France SA 4.38% 12/10/2029	507.480	0,63			
BERMUDAS				EUR	200.000	Electricite de France SA FRN 06/12/2171	196.158	0,24				
USD	500.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	431.463	0,54	EUR	200.000	ELO SACA 4.88% 08/12/2028	191.114	0,24			
Total de Bermudas			431.463	0,54	EUR	428.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	349.004	0,44			
DINAMARCA				EUR	200.000	La Banque Postale SA FRN 26/01/2031	176.705	0,22				
USD	775.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	624.694	0,78	EUR	300.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 0.63% 08/07/2032	232.802	0,29			
Total de Dinamarca			624.694	0,78	EUR	400.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 0.75% 12/01/2034	303.041	0,38			
				EUR	200.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 1.50% 27/09/2030	173.404	0,22				
				EUR	700.000	SANEF SA 1.88% 16/03/2026	665.985	0,84				
				EUR	700.000	Schneider Electric SE 0.25% 09/09/2024	673.035	0,84				
				EUR	600.000	Suez SACA 1.88% 24/05/2027	560.053	0,70				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*				Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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)					ITALIA				
EUR	400.000	Suez SACA 4.63% 03/11/2028	411.602	0,51	EUR	214.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	172.341	0,22
EUR	500.000	TotalEnergies SE - Perp FRN	415.229	0,52	EUR	283.000	Assicurazioni Generali SpA 5.00% 08/06/2048	278.925	0,35
Total de Francia			10.221.932	12,78	EUR	149.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	129.230	0,16
ALEMANIA					EUR	358.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	290.327	0,36
EUR	900.000	Allianz SE FRN 08/07/2050	734.376	0,91	EUR	100.000	Autostrade per l'Italia SpA 4.75% 24/01/2031	98.843	0,12
EUR	200.000	Allianz SE FRN 05/07/2052	184.174	0,23	EUR	195.000	ENI SpA - Perp FRN	162.927	0,20
EUR	600.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	495.977	0,62	USD	500.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	402.323	0,50
EUR	1.000.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	739.132	0,92	EUR	309.000	Snam SpA 0.00% 15/08/2025	284.553	0,36
EUR	100.000	Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032	101.939	0,13	EUR	250.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale FRN 09/02/2171	209.544	0,26
EUR	700.000	BASF SE 4.00% 08/03/2029	718.685	0,90	Total de Italia			2.029.013	2,53
EUR	400.000	Commerzbank AG FRN 29/12/2031	329.461	0,41	JAPÓN				
EUR	200.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	188.219	0,23	EUR	512.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0.01% 10/09/2025	468.429	0,58
EUR	400.000	Commerzbank AG FRN 21/03/2028	392.415	0,49	Total de Japón			468.429	0,58
EUR	700.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	552.567	0,70	JERSEY - ISLAS DEL CANAL				
EUR	200.000	Deutsche Bank AG FRN 05/09/2030	191.255	0,24	EUR	357.000	Heathrow Funding Limited 1.88% 14/03/2034	281.648	0,35
EUR	400.000	Hannover Rueck SE FRN 26/08/2043	408.844	0,51	GBP	234.000	Heathrow Funding Limited 6.45% 10/12/2031	283.800	0,35
EUR	400.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	306.566	0,38	Total de Jersey - Islas del Canal			565.448	0,70
EUR	400.000	Vier Gas Transport GmbH 0.13% 10/09/2029	316.964	0,40	LUXEMBURGO				
EUR	900.000	Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	929.758	1,16	EUR	600.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	402.767	0,50
EUR	300.000	Vonovia SE 1.50% 14/06/2041	158.138	0,20	EUR	600.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	373.546	0,47
EUR	600.000	Vonovia SE 1.88% 28/06/2028	511.792	0,64	EUR	300.000	Aroundtown SA 1.63% 31/01/2028	198.009	0,25
EUR	300.000	Vonovia SE 5.00% 23/11/2030	281.364	0,35	EUR	347.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	217.163	0,27
Total de Alemania			7.541.626	9,42	EUR	1.200.000	Grand City Properties SA 0.13% 11/01/2028	848.447	1,05
IRLANDA					EUR	433.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.38% 15/10/2040	298.213	0,38
EUR	370.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	335.583	0,42	EUR	521.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	391.836	0,49
EUR	500.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	466.909	0,58	EUR	300.000	Prologis International Funding II SA 4.63% 21/02/2035	280.612	0,35
EUR	420.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	361.109	0,45					
EUR	355.000	Experian Europe DAC 1.56% 16/05/2031	301.139	0,38					
Total de Irlanda			1.464.740	1,83					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	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	825.000 SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	758.278	0,95	EUR	717.000 Stedin Holding NV - Perp FRN	603.683	0,75
	Total de Luxemburgo	3.768.871	4,71	EUR	100.000 Telefonica Europe BV FRN 23/11/2171	102.023	0,13
PAÍSES BAJOS				EUR	300.000 Telefonica Europe BV - Perp FRN	249.999	0,31
EUR	100.000 ABB Finance BV 3.25% 16/01/2027	99.711	0,12	EUR	400.000 Telefonica Europe BV Perp FRN	391.339	0,49
EUR	176.000 Achmea BV 3.63% 29/11/2025	175.668	0,22	EUR	437.000 Tennet Holding BV FRN 22/10/2168	408.248	0,51
EUR	300.000 Airbus SE 2.38% 09/06/2040	236.479	0,30	EUR	485.000 TenneT Holding BV 1.63% 17/11/2026	463.637	0,58
EUR	265.000 Allianz Finance II BV 0.00% 22/11/2026	258.086	0,32	EUR	463.000 TenneT Holding BV 2.13% 17/11/2029	434.301	0,54
EUR	300.000 ASR Nederland NV FRN 07/12/2043	269.309	0,34	EUR	380.000 TenneT Holding BV 4.50% 28/10/2034	409.205	0,51
EUR	302.000 Diageo Capital BV 1.88% 08/06/2034	201.420	0,25	EUR	400.000 Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	300.430	0,37
EUR	538.000 Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	255.294	0,32	GBP	1.600.000 Volkswagen Financial Services NV 1.38% 14/09/2028	1.484.246	1,85
EUR	345.000 Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	420.110	0,52	EUR	300.000 Vonovia Finance BV 1.00% 28/01/2041	145.673	0,18
EUR	160.000 Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	243.182	0,30	EUR	249.000 Wolters Kluwer NV 3.00% 23/09/2026	246.148	0,31
USD	251.000 Enel Finance International NV 6.80% 14/10/2025	112.780	0,14	EUR	234.000 Wolters Kluwer NV 3.75% 03/04/2031	235.403	0,29
EUR	482.000 Enxsis Holding NV 0.63% 17/06/2032	239.442	0,30		Total de Países Bajos	13.067.634	16,29
EUR	56.000 Enxsis Holding NV 0.63% 17/06/2032	377.078	0,47	NORUEGA			
EUR	327.000 Enxsis Holding NV 0.75% 02/07/2031	43.810	0,05	USD	1.319.000 DNB Bank ASA FRN 30/09/2025	1.135.086	1,41
EUR	300.000 ING Groep NV FRN 01/02/2030	267.184	0,33	EUR	679.000 DNB Bank ASA FRN 14/03/2029	689.890	0,86
EUR	300.000 ING Groep NV FRN 29/11/2030	236.030	0,29		Total de Noruega	1.824.976	2,27
EUR	300.000 ING Groep NV FRN 29/11/2030	239.670	0,30	PORTUGAL			
EUR	500.000 ING Groep NV FRN 16/02/2031	239.670	0,30	EUR	100.000 Caixa Geral de Depositos SA FRN 31/10/2028	103.298	0,13
EUR	937.000 RELX Finance BV 1.00% 22/03/2024	420.851	0,53		Total de Portugal	103.298	0,13
EUR	345.000 Royal Schiphol Group NV 0.75% 22/04/2033	911.959	1,14	ESPAÑA			
EUR	345.000 Sagax Euro Mtn NL BV 0.75% 26/01/2028	262.443	0,33	EUR	600.000 Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 4.38% 14/10/2029**	615.915	0,77
EUR	345.000 Shell International Finance BV 1.88% 07/04/2032	253.064	0,32	EUR	100.000 Banco de Sabadell SA FRN 10/11/2028	100.485	0,13
EUR	700.000 Siemens Financieringsmaatschappij NV 3.38% 24/08/2031	298.112	0,37	GBP	200.000 Banco Santander SA FRN 30/08/2028	220.937	0,28
EUR	909.000 Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	702.328	0,88		Total de España	937.337	1,18
EUR	339.000 Stedin Holding NV 2.38% 03/06/2030	753.387	0,94				
		315.902	0,39				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*				Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
SUECIA					REINO UNIDO (continuación)				
EUR	606.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	492.599	0,61	EUR	401.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	307.470	0,38
		Total de Suecia	492.599	0,61					
SUIZA					EUR	368.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	282.167	0,35
EUR	874.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	689.676	0,86	EUR	417.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	337.571	0,42
EUR	519.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	340.784	0,43	USD	898.000	Nationwide Building Society 1.50% 13/10/2026	727.725	0,91
EUR	5.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	3.283	0,00	USD	576.000	NatWest Markets plc 1.60% 29/09/2026	462.957	0,58
EUR	200.000	Credit Suisse Group AG FRN 02/04/2032	167.599	0,21	GBP	290.000	NatWest Markets plc 6.38% 08/11/2027	343.321	0,43
EUR	200.000	UBS AG 0.50% 31/03/2031	155.124	0,19	EUR	601.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	506.218	0,63
		Total de Suiza	1.356.466	1,69	EUR	480.000	Thames Water Kemble Finance plc 0.19% 23/10/2023	471.161	0,59
REINO UNIDO					EUR	295.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	255.067	0,32
EUR	213.000	Anglo American Capital plc 4.75% 21/09/2032	214.775	0,27	GBP	820.000	Virgin Money UK plc FRN 24/04/2026	865.602	1,08
EUR	336.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	250.268	0,31	EUR	167.000	Virgin Money UK plc FRN 29/10/2028	159.310	0,20
EUR	173.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	128.858	0,16			Total de Reino Unido	10.311.574	12,86
EUR	534.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	495.104	0,62	ESTADOS UNIDOS				
EUR	415.000	British American Tobacco plc FRN 27/12/2169	338.757	0,42	EUR	441.000	Air Products and Chemicals Inc. 4.00% 03/03/2035	444.090	0,55
EUR	51.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	41.145	0,05	USD	313.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	294.718	0,37
EUR	345.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	278.333	0,35	USD	324.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	306.553	0,38
GBP	491.524	Delamare Finance plc 5.55% 19/02/2029	556.385	0,69	EUR	217.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	179.703	0,22
EUR	420.000	Diageo Finance plc 0.50% 19/06/2024	406.006	0,51	EUR	200.000	AT&T Inc. 1.80% 14/09/2039	140.395	0,18
EUR	330.000	Diageo Finance plc 1.00% 22/04/2025	315.075	0,39	EUR	81.000	AT&T Inc. 1.80% 14/09/2039	56.860	0,07
EUR	332.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	298.606	0,38	EUR	227.000	AT&T Inc. 3.15% 04/09/2036	201.466	0,25
EUR	415.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	404.547	0,50	EUR	242.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	192.089	0,24
USD	784.000	HSBC Holdings plc FRN 11/08/2033	715.212	0,89	EUR	345.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	273.846	0,34
EUR	475.000	Imperial Brands Finance plc 3.38% 26/02/2026	465.508	0,58	EUR	277.000	Bank of America Corp. FRN 27/04/2033	247.315	0,31
EUR	328.000	Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	276.413	0,34	EUR	319.000	Berkshire Hathaway Finance Corp. 1.50% 18/03/2030	280.797	0,35
EUR	416.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	408.013	0,51	EUR	185.000	Exxon Mobil Corp. 0.52% 26/06/2028	159.279	0,20

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*				Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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				
EUR	485.000	General Motors Financial Company Inc. 0.60% 20/05/2027	419.474	0,52	EUR	754.000	European Bank for Reconstruction & Development 0.00% 10/01/2024	735.576	0,92
EUR	200.000	General Motors Financial Company Inc. 4.30% 15/02/2029	197.236	0,25	EUR	742.000	European Investment Bank 0.00% 15/11/2027	650.589	0,81
EUR	470.000	Honeywell International Inc. 4.13% 02/11/2034	477.100	0,60	EUR	1.044.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.00% 15/01/2027	932.409	1,17
EUR	368.000	International Business Machines Corp. 3.63% 06/02/2031	368.033	0,46	Total de supranacional			2.318.574	2,90
EUR	486.000	JPMorgan Chase & Company FRN 17/02/2033	362.926	0,45	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			4.710.976	5,88
EUR	323.000	JPMorgan Chase & Company FRN 23/03/2030	285.715	0,36	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			77.490.393	96,71
EUR	505.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	470.984	0,59	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
EUR	688.000	Metropolitan Life Global Funding I 3.75% 05/12/2030	679.575	0,85	Bonos				
EUR	1.242.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	1.198.966	1,50	PAÍSES BAJOS				
EUR	488.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	480.193	0,60	USD	1.150.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	1.051.225	1,30
EUR	859.000	New York Life Global Funding 3.63% 09/01/2030	839.891	1,04	Total de Países Bajos			1.051.225	1,30
EUR	547.000	Northwestern Mutual Global Funding 4.11% 15/03/2030	554.299	0,69	Total de bonos			1.051.225	1,30
EUR	181.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	116.015	0,14	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
EUR	440.000	Verizon Communications Inc. 0.75% 22/03/2032	337.565	0,42	1.051.225 1,30				
EUR	505.000	Verizon Communications Inc. 4.25% 31/10/2030	521.944	0,65	Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				
Total de Estados Unidos			10.087.027	12,58	Bonos				
Total de bonos			72.779.417	90,83	PORTUGAL				
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					EUR	600.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	66.000	0,08
ALEMANIA					Total de Portugal			66.000	0,08
EUR	211.000	Germany (Govt of) 0.00% 09/10/2026	193.945	0,24					
EUR	565.000	Germany (Govt of) 0.00% 16/04/2027	513.851	0,64					
EUR	132.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/05/2036	96.609	0,12					
EUR	780.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 18/02/2025	738.158	0,92					
EUR	879.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.05% 30/05/2024	849.839	1,06					
Total de Alemania			2.392.402	2,98					

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)

REINO UNIDO

EUR	350.000	Lehman Brothers UK Capital Funding III LP Perp 3.88%**	0	0,00
Total de Reino Unido			0	0,00
Total de bonos			66.000	0,08
Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			66.000	0,08

Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios

Fondos

IRLANDA

52	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	5.189	0,01
	Total de Irlanda	5.189	0,01
Total de fondos		5.189	0,01
Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		5.189	0,01
Valor total de las inversiones		78.612.807	98,10

(Coste total: 86.746.277 EUR)

* Diferencias menores debido al redondeo.

** Título a su valor razonable.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

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	1.050.000	Azelis Finance NV 5.75% 15/03/2028	1.065.749	0,26	EUR	2.500.000	Casino Guichard Perrachon SA 3.58% 07/02/2025	768.856	0,19
EUR	3.100.000	Belfius Bank SA Perp FRN	3.007.000	0,75	EUR	885.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	271.916	0,07
EUR	900.000	Solvay SA FRN 02/03/2169	807.293	0,20	EUR	433.000	Chrome Bidco SASU 3.50% 31/05/2028	361.129	0,09
EUR	300.000	Solvay SA Perp FRN	298.463	0,07	EUR	334.000	Chrome Holdco SASU 5.00% 31/05/2029	248.361	0,06
Total de Bélgica		5.178.505	1,28	EUR	2.946.000	Constellium SE 3.13% 15/07/2029	2.396.999	0,60	
CANADÁ				EUR	1.126.000	Crown European Holdings SA 2.63% 30/09/2024	1.103.939	0,27	
EUR	1.193.000	Primo Water Holdings Inc. 3.88% 31/10/2028	1.040.864	0,26	EUR	587.000	Crown European Holdings SA 2.88% 01/02/2026	563.870	0,14
Total de Canadá		1.040.864	0,26	EUR	650.000	Crown European Holdings SA 3.38% 15/05/2025	640.792	0,16	
REPÚBLICA CHECA				EUR	3.000.000	Electricite de France SA FRN 01/06/2170	2.388.137	0,59	
EUR	937.000	Allwyn International AS 4.13% 20/11/2024	923.607	0,23	EUR	1.800.000	Electricite de France SA FRN 15/03/2169	1.513.552	0,38
Total de República Checa		923.607	0,23	EUR	3.600.000	Electricite de France SA FRN 22/01/2049	3.332.965	0,82	
FINLANDIA				EUR	2.400.000	Electricite de France SA FRN 29/12/2049	2.300.725	0,57	
EUR	683.000	Teollisuuden Voima Oyj 1.13% 09/03/2026	622.055	0,15	GBP	1.300.000	Electricite de France SA FRN 31/12/2049	1.231.201	0,31
EUR	594.000	Teollisuuden Voima Oyj 1.38% 23/06/2028	509.193	0,13	EUR	600.000	Electricite de France SA FRN 06/12/2171	588.475	0,15
EUR	339.000	Teollisuuden Voima Oyj 2.13% 04/02/2025	327.048	0,08	EUR	400.000	Electricite de France SA - Perp FRN	299.942	0,07
EUR	1.936.000	Teollisuuden Voima Oyj 2.63% 31/03/2027	1.816.836	0,45	EUR	1.231.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	1.081.035	0,27
Total de Finlandia		3.275.132	0,81	EUR	600.000	Elis SA 1.00% 03/04/2025	567.430	0,14	
FRANCIA				EUR	1.054.000	Emeria SASU 7.75% 31/03/2028	1.002.899	0,25	
EUR	400.000	Accor SA - Perp FRN	389.423	0,10	EUR	5.152.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2027	4.507.112	1,12
EUR	400.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	373.670	0,09	EUR	100.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	81.543	0,02
EUR	1.287.000	Altice France SA 3.38% 15/01/2028	1.009.921	0,25	EUR	2.261.000	Faurecia SE 2.75% 15/02/2027	2.015.909	0,50
EUR	542.000	Altice France SA 4.00% 15/07/2029	407.985	0,10	EUR	100.000	Faurecia SE 3.13% 15/06/2026	94.041	0,02
EUR	561.000	Altice France SA 4.13% 15/01/2029	434.016	0,11	EUR	1.163.000	Faurecia SE 3.75% 15/06/2028	1.044.700	0,26
EUR	104.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	78.417	0,02	EUR	633.000	Faurecia SE 7.25% 15/06/2026	654.231	0,16
EUR	1.264.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	953.065	0,24	EUR	576.000	Foncia Management SA 3.38% 31/03/2028	457.261	0,11
EUR	2.385.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	2.113.706	0,52	EUR	685.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	666.041	0,17
EUR	1.421.000	CAB Selsas 3.38% 01/02/2028	1.170.206	0,29	EUR	1.864.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	1.812.410	0,45
				EUR	4.077.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	3.936.678	0,98	
				EUR	1.185.000	Iliad Holding SASU 5.63% 15/10/2028	1.105.970	0,27	
				EUR	500.000	iliad SA 1.88% 11/02/2028	420.966	0,10	
				EUR	1.300.000	iliad SA 5.38% 14/06/2027	1.292.081	0,32	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado	% de valor			Valor de mercado	% de valor			
Valor nominal	Inversión	EUR	liquidativo*	Valor nominal	Inversión	EUR	liquidativo*			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)						
FRANCIA (continuación)				ALEMANIA (continuación)						
EUR	700.000	iliad SA 5.63% 15/02/2030	680.479	0,17	EUR	500.000	Bayer AG FRN 25/03/2082	461.153	0,11	
EUR	500.000	Iliad SA 0.75% 11/02/2024	486.368	0,12	EUR	2.124.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	1.965.742	0,49	
EUR	400.000	Iliad SA 2.38% 17/06/2026	367.737	0,09	EUR	265.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	247.407	0,06	
EUR	578.000	Laboratoire Eimer Selas 5.00% 01/02/2029	435.465	0,11	EUR	598.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	558.300	0,14	
EUR	1.484.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	1.446.523	0,36	EUR	400.000	Deutsche Bank AG FRN 30/04/2171	373.167	0,09	
EUR	429.000	Loxam SAS 3.75% 15/07/2026	399.525	0,10	EUR	500.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	482.440	0,12	
EUR	305.000	Loxam SAS 5.75% 15/07/2027	264.293	0,07	EUR	3.500.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	3.164.217	0,79	
EUR	200.000	Orano SA 3.38% 23/04/2026	194.553	0,05	EUR	2.800.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	2.615.133	0,65	
EUR	1.389.000	Paprec Holding SA 3.50% 01/07/2028	1.217.286	0,30	EUR	1.400.000	Deutsche Lufthansa AG 3.75% 11/02/2028	1.279.914	0,32	
EUR	1.511.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	1.496.723	0,36	EUR	1.649.000	Gruenenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	1.560.942	0,39	
EUR	1.242.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	1.253.048	0,31	EUR	804.000	Gruenenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	733.092	0,18	
EUR	429.000	Picard Groupe SAS 3.88% 01/07/2026	383.661	0,10	EUR	1.285.000	Gruenenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	1.171.670	0,29	
EUR	500.000	Renault SA 1.25% 24/06/2025	463.078	0,11	EUR	599.000	HT Troplast GmbH 9.25% 15/07/2025	594.545	0,15	
EUR	400.000	Renault SA 2.00% 28/09/2026	357.316	0,09	EUR	550.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.88% 15/05/2027	484.881	0,12	
EUR	1.000.000	Renault SA 2.38% 25/05/2026	916.864	0,23	EUR	2.115.876	IHO Verwaltungs GmbH 8.75% 15/05/2028	2.169.770	0,54	
EUR	400.000	Renault SA 2.50% 02/06/2027	353.334	0,09	EUR	100.000	Ineos Styrolution Group GmbH 2.25% 16/01/2027	87.013	0,02	
EUR	1.455.000	Rexel SA 2.13% 15/06/2028	1.283.706	0,32	EUR	500.000	Infineon Technologies AG FRN 01/04/2168	475.250	0,12	
EUR	961.000	Rexel SA 2.13% 15/12/2028	838.597	0,21	EUR	500.000	Infineon Technologies AG FRN 01/04/2168	455.363	0,11	
EUR	103.000	Rexel SA 2.13% 15/12/2028	89.881	0,02	EUR	3.400.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	2.605.813	0,65	
EUR	2.132.000	Solvay Finance SACA Perp FRN	2.128.361	0,54	EUR	2.626.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	2.292.104	0,57	
EUR	1.200.000	SPIE SA 2.63% 18/06/2026	1.132.020	0,28	EUR	1.548.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	1.345.258	0,33	
EUR	716.000	Tereos Finance Groupe I SA 7.25% 15/04/2028	703.974	0,17	EUR	1.318.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	1.073.460	0,26	
EUR	300.000	Valeo 1.00% 03/08/2028	239.963	0,06	EUR	434.000	ProGroup AG 3.00% 31/03/2026	405.921	0,10	
EUR	500.000	Valeo 1.50% 18/06/2025	472.360	0,12	EUR	1.300.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	1.263.540	0,31	
EUR	600.000	Valeo 1.63% 18/03/2026	552.820	0,14	EUR	900.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	874.759	0,22	
EUR	1.300.000	Valeo 5.38% 28/05/2027	1.296.151	0,32	EUR	1.200.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	1.101.502	0,27	
EUR	600.000	Veolia Environnement SA FRN 15/02/2171	499.166	0,12	EUR	700.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	642.543	0,16	
EUR	1.100.000	Veolia Environnement SA FRN 20/04/2169	989.192	0,25	EUR	1.629.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 2.00% 15/07/2025	1.521.573	0,38	
EUR	300.000	Veolia Environnement SA FRN 20/04/2170	269.779	0,07						
EUR	400.000	Veolia Environnement SA FRN 20/04/2171	328.766	0,08						
EUR	1.400.000	Verallia SA 1.63% 14/05/2028	1.228.616	0,31						
Total de Francia		68.451.180	17,00							
ALEMANIA										
EUR	500.000	Bayer AG FRN 12/11/2079	465.598	0,12						
EUR	1.100.000	Bayer AG FRN 12/11/2079	955.655	0,24						
EUR	2.500.000	Bayer AG FRN 25/03/2082	2.324.281	0,57						

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*				Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
ALEMANIA (continuación)					ITALIA (continuación)				
EUR	1.251.099	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	1.192.363	0,30	EUR	1.327.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2.63% 28/04/2025	1.211.351	0,30
EUR	200.000	ZF Finance GmbH 2.00% 06/05/2027	173.159	0,04	EUR	928.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3.63% 24/09/2024	884.578	0,22
EUR	100.000	ZF Finance GmbH 2.75% 25/05/2027	89.453	0,02	EUR	310.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA FRN 02/03/2026	304.055	0,08
EUR	1.200.000	ZF Finance GmbH 3.00% 21/09/2025	1.143.666	0,28	EUR	1.687.000	FIS Fabbbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	1.506.913	0,37
EUR	700.000	ZF Finance GmbH 3.75% 21/09/2028	626.594	0,16	EUR	1.288.000	IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3.75% 15/01/2028	1.135.587	0,28
Total de Alemania			38.977.241	9,67	EUR	471.000	International Design Group SpA 6.50% 15/11/2025	454.774	0,11
GIBRALTAR					EUR	832.000	Lottomatica SpA 5.13% 15/07/2025	822.285	0,20
EUR	1.066.000	888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027	907.516	0,23	EUR	522.000	Lottomatica SpA 6.25% 15/07/2025	521.681	0,13
Total de Gibraltar			907.516	0,23	EUR	805.000	Lottomatica SpA 9.75% 30/09/2027	855.591	0,21
GRECIA					EUR	303.000	Marcolin SpA 6.13% 15/11/2026	256.583	0,06
EUR	450.000	Eurobank SA FRN 05/05/2027	377.392	0,09	EUR	935.000	Mundys SpA 1.63% 03/02/2025	886.233	0,22
EUR	1.846.000	Eurobank SA FRN 26/01/2029	1.799.580	0,45	EUR	625.000	Mundys SpA 1.88% 12/02/2028	526.460	0,13
EUR	1.050.000	National Bank of Greece SA FRN 22/11/2027	1.060.140	0,26	EUR	3.174.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	2.888.961	0,72
Total de Grecia			3.237.112	0,80	EUR	1.042.000	Nexi SpA 2.13% 30/04/2029	857.904	0,21
IRLANDA					EUR	1.520.000	Telecom Italia SpA 2.38% 12/10/2027	1.315.713	0,33
EUR	4.471.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	4.247.768	1,05	EUR	2.412.000	Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	2.306.839	0,57
GBP	1.258.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 4.88% 15/07/2028	1.223.116	0,30	EUR	375.000	Telecom Italia SpA 2.88% 28/01/2026	351.042	0,09
Total de Irlanda			5.470.884	1,35	EUR	920.000	Telecom Italia SpA 3.63% 25/05/2026	883.536	0,22
ISLA DE MAN					EUR	1.175.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	1.167.131	0,29
EUR	440.755	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	439.519	0,11	EUR	600.000	Telecom Italia SpA 5.25% 17/03/2055	491.040	0,12
EUR	119.000	Playtech plc 4.25% 07/03/2026	114.722	0,03	GBP	1.000.000	Telecom Italia SpA 5.88% 19/05/2023	1.137.645	0,28
Total de Isla de Man			554.241	0,14	EUR	1.332.000	Telecom Italia SpA 6.88% 15/02/2028	1.362.920	0,34
ITALIA					Total de Italia		25.495.318	6,32	
EUR	1.035.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 26/06/2026	957.509	0,24	JERSEY - ISLAS DEL CANAL				
EUR	1.468.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 01/02/2027	1.337.308	0,33	EUR	175.757	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	175.369	0,04
EUR	633.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	549.011	0,14	EUR	3.023.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	2.954.118	0,72
EUR	609.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	522.668	0,13	EUR	849.000	Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	786.740	0,20

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)			
GBP	1.418.000 Kane Bidco Limited 6.50% 15/02/2027	1.449.170	0,36	EUR	960.000 Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	893.007	0,22
	Total de Jersey - Islas del Canal	5.365.397	1,32	EUR	1.110.000 Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/01/2033	1.191.004	0,30
LUXEMBURGO				EUR	2.700.000 Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	2.474.058	0,62
EUR	912.000 Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	860.338	0,21		Total de Luxemburgo	27.023.429	6,73
EUR	1.598.000 Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	1.277.902	0,32	PAÍSES BAJOS			
EUR	117.000 Altice Financing SA 4.25% 15/08/2029	94.477	0,02	EUR	1.400.000 Abertis Infraestructuras Finance BV - Perp FRN	1.140.837	0,28
EUR	2.200.000 Altice Finco SA 4.75% 15/01/2028	1.659.963	0,42	EUR	2.493.000 Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	2.151.475	0,54
EUR	3.962.000 Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	2.974.451	0,74	EUR	848.000 Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/01/2025	839.454	0,21
GBP	564.000 B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	604.444	0,15	EUR	100.000 Constellium SE 4.25% 15/02/2026	97.670	0,02
EUR	1.395.000 Canpack SA 2.38% 01/11/2027	1.140.591	0,28	EUR	2.436.000 Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	2.370.606	0,59
EUR	257.000 Cirsia Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	249.103	0,06	EUR	1.762.000 Dufry One BV 2.00% 15/02/2027	1.525.960	0,38
EUR	370.437 Cirsia Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	370.402	0,09	EUR	200.000 Dufry One BV 2.50% 15/10/2024	196.949	0,05
EUR	989.000 Cirsia Finance International Sarl 10.38% 30/11/2027	1.052.052	0,26	EUR	472.000 Dufry One BV 3.38% 15/04/2028	416.211	0,10
EUR	443.000 CPI Property Group SA Perp FRN	189.538	0,05	EUR	128.000 Goodyear Europe BV 2.75% 15/08/2028	104.614	0,03
EUR	430.000 Eurofins Scientific SE FRN 13/11/2166	397.290	0,10	EUR	1.107.000 LKQ European Holdings BV 4.13% 01/04/2028	1.073.315	0,27
EUR	871.000 Eurofins Scientific SE FRN 24/07/2171	866.973	0,22	EUR	400.000 Naturgy Finance BV FRN 29/12/2049	387.896	0,10
EUR	1.073.953 Gamma Bondco Sarl 8.13% 15/11/2026	1.043.610	0,26	EUR	1.000.000 Naturgy Finance BV - Perp FRN	872.209	0,22
EUR	539.000 Garfunkelux Holdco 3 SA 6.75% 01/11/2025	415.192	0,10	EUR	1.426.000 Nobel Bidco BV 3.13% 15/06/2028	1.010.924	0,25
GBP	960.000 Garfunkelux Holdco 3 SA 7.75% 01/11/2025	832.224	0,21	EUR	1.720.000 OI European Group BV 2.88% 15/02/2025	1.676.810	0,42
EUR	4.924.000 InPost SA 2.25% 15/07/2027	4.200.766	1,04	EUR	200.000 Phoenix Pib Dutch Finance BV 2.38% 05/08/2025	190.565	0,05
EUR	770.431 LHMC Finco 2 Sarl 7.25% 02/10/2025	713.441	0,18	EUR	624.000 Ppf Telecom Group BV 2.13% 31/01/2025	590.536	0,15
EUR	102.423 LHMC Finco 2 Sarl 7.25% 02/10/2025	94.847	0,02	EUR	500.000 PPF Telecom Group BV 3.13% 27/03/2026	469.673	0,12
EUR	1.176.395 Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	1.170.830	0,29	EUR	459.000 PPF Telecom Group BV 3.25% 29/09/2027	422.224	0,10
EUR	1.233.000 Loarre Investments Sarl 6.50% 15/05/2029	1.150.870	0,29	EUR	612.000 PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	603.770	0,15
EUR	490.000 Loarre Investments Sarl FRN 15/05/2029	472.842	0,12	EUR	622.000 Q-Park Holding I BV 1.50% 01/03/2025	574.534	0,14
EUR	684.000 Matterhorn Telecom SA 4.00% 15/11/2027	633.214	0,16	EUR	2.174.000 Repsol International Finance BV FRN 22/03/2170	1.896.563	0,48
				EUR	907.000 Repsol International Finance BV FRN 11/06/2169	856.479	0,21

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*			Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valor nominal	Inversión			Valor nominal	Inversión				
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 FRN 11/06/2169	436.266	0,11	EUR	214.000	United Group BV 5.25% 01/02/2030	152.649	0,04
EUR	843.000	Repsol International Finance BV FRN 31/12/2049	758.992	0,19	EUR	974.000	Villa Dutch Bidco BV 9.00% 03/11/2029	923.427	0,23
EUR	1.061.305	Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	832.735	0,21	EUR	1.379.000	VZ Secured Financing BV 3.50% 15/01/2032	1.103.733	0,27
EUR	999.395	Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	784.158	0,19	EUR	1.119.000	VZ Vendor Financing II BV 2.88% 15/01/2029	896.793	0,22
EUR	1.000.000	Telefonica Europe BV FRN 24/09/2170	851.453	0,21	EUR	1.300.000	ZF Europe Finance BV 2.00% 23/02/2026	1.186.868	0,29
EUR	1.600.000	Telefonica Europe BV FRN 24/05/2170	1.333.326	0,33	Total de Países Bajos		49.038.170	12,19	
EUR	300.000	Telefonica Europe BV FRN 03/05/2171	290.322	0,07	PORTUGAL				
EUR	400.000	Telefonica Europe BV FRN 23/11/2171	408.091	0,10	EUR	700.000	Edp - Energias de Portugal SA FRN 20/07/2080	634.661	0,16
EUR	3.700.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	3.427.880	0,85	EUR	1.400.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 14/03/2082	1.178.196	0,29
EUR	2.900.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	2.837.211	0,70	EUR	2.300.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 23/04/2083	2.260.007	0,56
EUR	2.198.000	Tennet Holding BV FRN 22/10/2168	2.053.385	0,51	Total de Portugal		4.072.864	1,01	
EUR	495.000	TenneT Holding BV Perp FRN	487.052	0,12	RUMANÍA				
EUR	589.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.63% 15/10/2028	458.056	0,11	EUR	1.600.000	RCS & RDS SA 2.50% 05/02/2025	1.513.283	0,38
EUR	525.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.88% 31/03/2027	445.260	0,11	EUR	400.000	RCS & RDS SA 3.25% 05/02/2028	338.060	0,08
EUR	2.270.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.75% 09/05/2027	2.058.456	0,51	Total de Rumanía		1.851.343	0,46	
EUR	1.413.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.38% 09/05/2030	1.199.633	0,30	ESPAÑA				
EUR	1.499.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	1.482.219	0,37	EUR	1.100.000	Banco de SAbadell SA FRN 07/02/2029	1.043.820	0,26
EUR	1.058.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7.38% 15/09/2029	1.074.274	0,27	EUR	1.800.000	Cellnex Finance Company SA 1.00% 15/09/2027	1.539.436	0,38
EUR	231.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7.88% 15/09/2031	238.879	0,06	EUR	2.500.000	Cellnex Finance Company SA 1.25% 15/01/2029	2.046.363	0,51
EUR	1.214.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	1.123.763	0,28	EUR	1.800.000	Cellnex Finance Company SA 1.50% 08/06/2028	1.536.376	0,38
EUR	2.228.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	1.842.953	0,46	EUR	1.200.000	Cellnex Finance Company SA 2.00% 15/02/2033	921.342	0,23
EUR	346.000	United Group BV 4.63% 15/08/2028	256.639	0,06	EUR	900.000	Cellnex Finance Company SA 2.25% 12/04/2026	846.804	0,21
EUR	641.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	624.423	0,16	EUR	1.100.000	Cellnex Telecom SA 1.00% 20/04/2027	964.671	0,24
					EUR	2.000.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	1.667.193	0,42
					EUR	600.000	Cellnex Telecom SA 2.88% 18/04/2025	588.087	0,15

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*				Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
ESPAÑA (continuación)					REINO UNIDO (continuación)				
EUR	2.558.000	Grifols Escrow Issuer SA 3.88% 15/10/2028	2.002.104	0,50	EUR	1.565.000	BCP V Modular Services Finance II plc 4.75% 30/11/2028	1.333.598	0,33
EUR	1.085.000	Grifols SA 1.63% 15/02/2025	1.023.996	0,25	GBP	410.000	Bellis Acquisition Company plc 4.50% 16/02/2026	395.724	0,10
EUR	2.011.000	Grifols SA 2.25% 15/11/2027	1.712.352	0,43					
EUR	1.586.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	1.447.118	0,36	GBP	1.676.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	1.246.388	0,31
EUR	400.000	International Consolidated Airlines Group SA 2.75% 25/03/2025	382.490	0,09	EUR	1.101.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	1.020.805	0,25
EUR	967.000	Kaixo Bondco Telecom SA 5.13% 30/09/2029	851.352	0,21	EUR	686.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	599.220	0,15
EUR	4.228.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	3.892.824	0,97	GBP	510.000	Centrica plc FRN 10/04/2075	548.682	0,14
	Total de España		22.466.328	5,59	GBP	1.029.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	1.099.324	0,27
SUECIA					GBP	100.000	Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	112.998	0,03
EUR	1.540.000	Heimstaden Bostad AB FRN 01/05/2169	792.425	0,20	GBP	937.000	Co-Operative Group Limited FRN 08/07/2026	992.879	0,25
EUR	932.000	Heimstaden Bostad AB FRN 01/05/2170	479.571	0,12	GBP	1.623.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	1.542.653	0,39
EUR	530.000	Heimstaden Bostad AB FRN 19/02/2168	328.209	0,08	EUR	1.371.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	1.267.215	0,31
EUR	1.420.000	Heimstaden Bostad AB FRN 15/04/2169	756.025	0,19	EUR	454.000	INEOS Finance plc 2.13% 15/11/2025	426.862	0,11
EUR	866.608	Intrum AB 3.13% 15/07/2024	834.168	0,21	EUR	2.200.000	INEOS Finance plc 2.88% 01/05/2026	2.051.726	0,51
EUR	1.720.000	Intrum AB 3.50% 15/07/2026	1.435.500	0,36	EUR	577.000	INEOS Finance plc 3.38% 31/03/2026	541.363	0,13
EUR	2.044.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	1.894.138	0,46	EUR	396.000	INEOS Finance plc 3.38% 31/03/2026	371.542	0,09
EUR	1.190.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB - Perp FRN	441.134	0,11	EUR	1.003.000	INEOS Finance plc 6.63% 15/05/2028	1.012.941	0,25
EUR	1.775.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	1.578.593	0,39	EUR	904.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	813.666	0,20
EUR	798.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	709.700	0,18	EUR	2.074.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	1.866.750	0,46
EUR	486.000	Verisure Holding AB 3.88% 15/07/2026	452.263	0,11	GBP	981.000	Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	1.062.669	0,26
EUR	305.000	Verisure Holding AB 7.13% 01/02/2028	305.938	0,08	EUR	1.592.000	International Game Technology plc 2.38% 15/04/2028	1.407.450	0,35
EUR	583.000	Verisure Holding AB 9.25% 15/10/2027	627.063	0,16	EUR	120.666	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	120.088	0,03
EUR	1.932.000	Verisure Midholding A 5.25% 15/02/2029	1.609.799	0,40	EUR	2.677.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	2.589.990	0,64
EUR	628.000	Verisure Midholding A 5.25% 15/02/2029	523.268	0,13	GBP	1.538.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	1.662.826	0,41
	Total de Suecia		12.767.794	3,18	EUR	320.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.20% 15/01/2024	313.257	0,08
REINO UNIDO					EUR	102.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 4.50% 15/07/2028	83.910	0,02
GBP	340.000	Barclays plc FRN 14/11/2032	400.224	0,10					
GBP	523.000	Barclays plc FRN 15/06/2171	540.050	0,13					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*				Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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	1.068.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	1.051.286	0,26	EUR	2.316.000	Vodafone Group plc FRN 03/01/2079	2.284.969	0,57
EUR	2.587.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	2.477.512	0,61	EUR	2.629.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	2.405.822	0,60
GBP	578.000	Jerrold Finco plc 4.88% 15/01/2026	569.930	0,14	GBP	335.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	363.446	0,09
GBP	1.481.000	Jerrold Finco plc 5.25% 15/01/2027	1.422.118	0,35	USD	1.727.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	1.556.168	0,39
GBP	1.617.000	Ladbrokes Group Finance plc 5.13% 08/09/2023	1.831.335	0,45	GBP	3.131.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	2.695.844	0,67
GBP	1.245.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	1.283.429	0,32	Total de Reino Unido			66.518.018	16,50
GBP	490.000	Marks & Spencer plc 6.00% 12/06/2025	551.475	0,14	ESTADOS UNIDOS				
GBP	435.000	NatWest Markets plc 6.38% 08/11/2027	514.981	0,13	EUR	1.576.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	1.305.121	0,32
EUR	1.280.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	1.187.145	0,29	EUR	333.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3.00% 01/09/2029	248.595	0,06
GBP	1.333.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	1.404.817	0,35	EUR	2.488.000	Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	2.400.546	0,60
GBP	850.000	Premier Foods Finance plc 3.50% 15/10/2026	878.871	0,22	EUR	150.000	Avantor Funding Inc. 3.88% 15/07/2028	140.313	0,03
GBP	333.000	Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	331.633	0,08	EUR	2.106.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	1.899.805	0,47
EUR	895.000	Rolls-Royce plc 1.63% 09/05/2028	744.498	0,18	EUR	535.000	Ford Motor Credit Company LLC 1.74% 19/07/2024	513.963	0,13
GBP	730.000	Rolls-Royce plc 3.38% 18/06/2026	756.394	0,19	EUR	2.138.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.33% 25/11/2025	1.994.881	0,50
GBP	2.263.000	Rolls-Royce plc 5.75% 15/10/2027	2.465.299	0,61	EUR	271.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	252.852	0,06
GBP	1.377.000	Santander UK plc Perp 10.06%	2.272.974	0,56	EUR	291.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	271.513	0,07
EUR	1.616.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	1.393.845	0,35	GBP	1.543.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	1.673.956	0,42
EUR	2.098.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	1.930.868	0,48	EUR	440.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	433.096	0,11
EUR	931.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	755.061	0,19	EUR	1.697.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	1.630.228	0,40
EUR	886.000	Victoria plc 3.75% 15/03/2028	698.585	0,17	EUR	715.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	686.867	0,17
GBP	988.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.13% 15/08/2030	916.616	0,23	GBP	1.055.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	1.154.331	0,29
GBP	603.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.25% 15/01/2030	559.901	0,14	EUR	2.646.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.87% 03/08/2027	2.568.339	0,63
GBP	969.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.00% 15/04/2027	1.036.341	0,26	GBP	1.405.000	Ford Motor Credit Company LLC 6.86% 05/06/2026	1.597.410	0,40
GBP	1.062.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	1.056.036	0,26	EUR	3.334.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	2.966.015	0,74
EUR	1.964.000	Vmed O2 UK Financing I plc 3.25% 31/01/2031	1.607.554	0,40	EUR	599.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/03/2029	511.731	0,13
GBP	1.324.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.50% 15/07/2031	1.205.587	0,30					
EUR	979.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	882.878	0,22					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

(continuación)

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*
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
76.636	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	7.575.412	1,88
3.803	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	4.329	0,00
4.597	Insight Liquidity Funds plc	5.232	0,00
	Total de Irlanda	7.584.973	1,88
	Total de fondos	7.584.973	1,88
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	7.584.973	1,88
	Valor total de las inversiones	394.430.856	97,93
	(Coste total: 431.319.513 EUR)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

** Título a su valor razonable.

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

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

			Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*				Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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					ALEMANIA				
EUR	200.000	Azelis Finance NV 5.75% 15/03/2028	203.000	0,29	EUR	453.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	419.247	0,60
	Total de Bélgica		203.000	0,29	EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 2.00% 14/07/2024	194.119	0,28
FINLANDIA					EUR	400.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	385.952	0,55
EUR	400.000	Teollisuuden Voima Oyj 1.13% 09/03/2026	364.307	0,52	EUR	300.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	271.219	0,39
EUR	540.000	Teollisuuden Voima Oyj 2.13% 04/02/2025	520.962	0,74	EUR	300.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	280.193	0,40
	Total de Finlandia		885.269	1,26	EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	186.795	0,27
FRANCIA					EUR	1.026.000	Gruenenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	971.209	1,39
EUR	316.000	Altice France SA 2.13% 15/02/2025	292.741	0,42	EUR	499.000	HT Troplast GmbH 9.25% 15/07/2025	495.289	0,71
EUR	1.256.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	1.173.323	1,68	EUR	684.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.63% 15/05/2025	682.256	0,97
EUR	391.000	Banijay Entertainment SASU 3.50% 01/03/2025	381.210	0,54	EUR	200.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.88% 15/05/2027	176.320	0,25
EUR	300.000	Casino Guichard Perrachon SA 3.58% 07/02/2025	92.263	0,13	EUR	180.000	IHO Verwaltungs GmbH 8.75% 15/05/2028	184.585	0,26
EUR	200.000	Crown European Holdings SA 2.88% 01/02/2026	192.119	0,27	EUR	529.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	459.717	0,66
EUR	100.000	Crown European Holdings SA 3.38% 15/05/2025	98.583	0,14	EUR	600.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	583.172	0,83
EUR	300.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	263.453	0,38	EUR	146.000	SGL Carbon SE 4.63% 30/09/2024	145.615	0,21
EUR	100.000	Elis SA 1.00% 03/04/2025	94.572	0,14	EUR	530.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 2.00% 15/07/2025	495.048	0,71
EUR	500.000	Elis SA 2.88% 15/02/2026	484.572	0,69	EUR	500.000	TUI Cruises GmbH 6.50% 15/05/2026	450.217	0,64
EUR	260.000	Emeria SASU 7.75% 31/03/2028	247.395	0,35	EUR	100.000	ZF Finance GmbH 3.00% 21/09/2025	95.306	0,14
EUR	102.000	Faurecia SE 2.63% 15/06/2025	97.948	0,14		Total de Alemania		6.476.259	9,26
EUR	1.091.000	Faurecia SE 2.63% 15/06/2025	1.047.663	1,50	GIBRALTAR				
EUR	250.000	Faurecia SE 2.75% 15/02/2027	222.900	0,32	EUR	340.000	888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027	289.452	0,41
EUR	1.028.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	999.548	1,43		Total de Gibraltar		289.452	0,41
EUR	1.356.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	1.309.330	1,87	IRLANDA				
EUR	100.000	iliad SA 5.38% 14/06/2027	99.391	0,14	EUR	416.000	Eircom Finance Dac 1.75% 01/11/2024	410.106	0,59
EUR	100.000	Iliad SA 0.75% 11/02/2024	97.274	0,14	EUR	744.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	706.853	1,01
EUR	381.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	371.378	0,53		Total de Irlanda		1.116.959	1,60
EUR	177.178	Loxam SAS 6.00% 15/04/2025	171.243	0,24					
EUR	820.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	812.251	1,16					
EUR	713.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	719.342	1,03					
EUR	174.000	Tereos Finance Groupe I SA 7.25% 15/04/2028	171.078	0,24					
EUR	300.000	Valeo 3.25% 22/01/2024	298.254	0,43					
EUR	400.000	Valeo 5.38% 28/05/2027	398.816	0,57					
	Total de Francia		10.136.647	14,48					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

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

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado	% de valor				Valor de mercado	% de valor
Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo*	Valor nominal	Inversión		EUR	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)				
ISLA DE MAN					LUXEMBURGO				
EUR	368.302	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	367.269	0,53	EUR	750.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	707.515	1,01
EUR	110.000	Playtech plc 4.25% 07/03/2026	106.046	0,15	GBP	837.000	B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	897.021	1,29
Total de Isla de Man			473.315	0,68	EUR	800.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	654.102	0,93
ITALIA					EUR	100.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	96.927	0,14
EUR	325.000	Autostrade per l'Italia SpA 4.38% 16/09/2025	326.810	0,47	EUR	150.588	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	150.574	0,22
EUR	419.000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	374.272	0,53	EUR	214.000	Gamma Bondco Sarl 8.13% 15/11/2026	207.954	0,30
EUR	300.000	International Design Group SpA 6.50% 15/11/2025	289.665	0,41	EUR	200.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 6.75% 01/11/2025	154.060	0,22
EUR	686.000	Lottomatica SpA 5.13% 15/07/2025	677.990	0,97	GBP	143.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.75% 01/11/2025	123.967	0,18
EUR	578.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	526.092	0,75	EUR	493.000	HSE Finance Sarl 5.63% 15/10/2026	249.483	0,36
EUR	681.000	Rossini Sarl 6.75% 30/10/2025	684.455	0,98	EUR	611.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	521.257	0,74
EUR	277.000	Telecom Italia SpA 2.50% 19/07/2023	275.576	0,39	EUR	171.671	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	170.859	0,24
EUR	100.000	Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	95.640	0,14	EUR	800.000	Matterhorn Telecom SA 2.63% 15/09/2024	793.165	1,13
EUR	185.000	Telecom Italia SpA 2.88% 28/01/2026	173.181	0,25	EUR	280.000	Matterhorn Telecom SA 3.13% 15/09/2026	259.978	0,37
EUR	300.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	297.991	0,43	EUR	375.000	PLT VII Finance Sarl 4.63% 05/01/2026	352.415	0,50
EUR	115.000	Telecom Italia SpA 6.88% 15/02/2028	117.669	0,17	EUR	100.000	PLT VII Finance Sarl 4.63% 05/01/2026	93.977	0,13
Total de Italia			3.839.341	5,49	EUR	222.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	206.508	0,29
JAPÓN					Total de Luxemburgo				
EUR	130.000	SoftBank Group Corp 4.00% 20/04/2023	129.977	0,19				5.639.762	8,05
EUR	300.000	SoftBank Group Corp. 2.13% 06/07/2024	284.918	0,41					
Total de Japón			414.895	0,60	MÉXICO				
					EUR	247.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 21/02/2024	243.357	0,35
					Total de México			243.357	0,35
JERSEY - ISLAS DEL CANAL					PAÍSES BAJOS				
EUR	111.642	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	111.395	0,16	EUR	350.000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/01/2025	346.473	0,49
EUR	344.000	Avis Budget Finance plc 4.13% 15/11/2024	342.925	0,49	EUR	610.000	Constellium SE 4.25% 15/02/2026	595.785	0,85
EUR	370.000	Avis Budget Finance plc 4.50% 15/05/2025	364.937	0,52	EUR	775.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	754.196	1,07
EUR	233.000	Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	215.913	0,31	EUR	327.273	Kongsberg Actuation Systems BV 5.00% 15/07/2025	312.083	0,45
GBP	162.000	Kane Bidco Limited 6.50% 15/02/2027	165.561	0,24	EUR	353.000	OI European Group BV 2.88% 15/02/2025	344.136	0,49
Total de Jersey - Islas del Canal			1.200.731	1,72					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

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

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*				Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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	485.000	OI European Group BV 3.13% 15/11/2024	475.597	0,68	EUR	300.000	International Consolidated Airlines Group SA 0.50% 04/07/2023	297.224	0,42
EUR	475.000	PPF Telecom Group BV 2.13% 31/01/2025	449.527	0,64	EUR	300.000	International Consolidated Airlines Group SA 2.75% 25/03/2025	286.868	0,41
EUR	468.000	PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	461.706	0,66	EUR	600.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	552.435	0,79
EUR	246.000	Q-Park Holding I BV 1.50% 01/03/2025	227.227	0,32	Total de España			4.668.171	6,66
EUR	141.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	139.422	0,20					
EUR	340.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	314.728	0,45	SUECIA				
EUR	650.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	537.665	0,76	EUR	65.660	Intrum AB 3.13% 15/07/2024	63.202	0,09
EUR	440.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	428.621	0,61	EUR	777.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	720.031	1,03
EUR	300.000	ZF Europe Finance BV 2.00% 23/02/2026	273.893	0,39	EUR	473.000	Verisure Holding AB 3.88% 15/07/2026	440.166	0,63
Total de Países Bajos			5.661.059	8,06	EUR	100.000	Verisure Holding AB 7.13% 01/02/2028	100.308	0,14
					EUR	280.000	Verisure Holding AB 9.25% 15/10/2027	301.163	0,43
					Total de Suecia			1.624.870	2,32
PANAMÁ					REINO UNIDO				
EUR	100.000	Carnival Corp. 7.63% 01/03/2026	89.590	0,13	GBP	306.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	227.562	0,33
EUR	212.000	Carnival Corp. 10.13% 01/02/2026	223.524	0,32	GBP	145.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	154.910	0,22
Total de Panamá			313.114	0,45	GBP	145.000	Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	163.847	0,23
RUMANÍA					GBP	124.000	Co-Operative Group Limited FRN 08/07/2026	131.395	0,19
EUR	600.000	RCS & RDS SA 2.50% 05/02/2025	567.481	0,81	EUR	489.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	451.983	0,65
Total de Rumanía			567.481	0,81	EUR	365.000	EG Global Finance plc 3.63% 07/02/2024	358.417	0,51
ESPAÑA					EUR	100.000	INEOS Finance plc 2.13% 15/11/2025	94.022	0,13
EUR	400.000	Banco de SAbadell SA FRN 24/03/2026	376.053	0,54	EUR	1.153.000	INEOS Finance plc 2.88% 01/05/2026	1.075.291	1,54
EUR	600.000	Cellnex Finance Company SA 2.25% 12/04/2026	564.536	0,81	EUR	300.000	INEOS Finance plc 3.38% 31/03/2026	281.471	0,40
EUR	300.000	Cellnex Telecom SA 2.88% 18/04/2025	294.044	0,42	EUR	482.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	433.835	0,62
EUR	545.000	Gestamp Automocion SA 3.25% 30/04/2026	520.645	0,74	EUR	394.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	354.629	0,51
EUR	100.000	Grifols SA 1.63% 15/02/2025	94.378	0,13	GBP	247.000	Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	267.563	0,38
EUR	1.383.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	1.261.894	1,80	EUR	77.092	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	76.723	0,11
EUR	500.000	Grupo Antolin-Irausa SA 3.38% 30/04/2026	420.094	0,60					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

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

Estado de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado	% de valor			Valor de mercado	% de valor		
Valor nominal	Inversión	EUR	liquidativo*	Valor nominal	Inversión	EUR	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	1.090.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	1.054.572	1,51	GBP	270.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	295.421	0,42
GBP	900.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	973.045	1,39	EUR	418.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.87% 03/08/2027	405.733	0,58
EUR	100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.20% 15/01/2024	97.893	0,14	EUR	464.000	IQVIA Inc. 1.75% 15/03/2026	433.383	0,62
EUR	240.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	236.244	0,34	EUR	750.000	IQVIA Inc. 2.88% 15/09/2025	737.981	1,05
EUR	413.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	395.521	0,56	GBP	657.000	MPT Operating Partnership LP 2.55% 05/12/2023	711.631	1,02
GBP	543.000	Jerrold Finco plc 4.88% 15/01/2026	535.418	0,76	EUR	175.000	Netflix Inc. 3.00% 15/06/2025	172.319	0,25
GBP	835.000	Ladbrokes Group Finance plc 5.13% 08/09/2023	945.680	1,35	USD	260.000	Occidental Petroleum Corp. 5.88% 01/09/2025	242.441	0,35
GBP	200.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	206.173	0,29	EUR	1.380.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	1.347.822	1,94
EUR	404.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	374.692	0,54	EUR	400.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	378.276	0,54
GBP	300.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	316.163	0,45	EUR	1.000.000	ZF North America Capital 2.75% 27/04/2023	999.248	1,43
GBP	400.000	Premier Foods Finance plc 3.50% 15/10/2026	413.587	0,59	Total de Estados Unidos		7.487.574	10,72	
EUR	238.000	Rolls-Royce plc 0.88% 09/05/2024	229.303	0,33	Total de bonos		64.052.546	91,51	
EUR	350.000	Rolls-Royce plc 4.63% 16/02/2026	347.244	0,49	Bonos - convertibles				
EUR	482.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	415.739	0,59	FRANCIA				
EUR	400.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	368.135	0,53	EUR	10.988	Elis SA 0.00% 06/10/2023	343.029	0,49
EUR	975.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	790.746	1,13	Total de Francia		343.029	0,49	
GBP	600.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.00% 15/04/2027	641.697	0,92	Total de bonos - convertibles		343.029	0,49	
GBP	462.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	397.790	0,57	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				
Total de Reino Unido		12.811.290	18,30	64.395.575				92,00	
ESTADOS UNIDOS				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente					
Bonos				Bonos					
ESTADOS UNIDOS				ESTADOS UNIDOS					
EUR	857.000	Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	826.876	1,18	USD	122.000	Occidental Petroleum Corp. 6.95% 01/07/2024	113.766	0,16
EUR	290.000	Ball Corp. 0.88% 15/03/2024	282.721	0,40	Total de Estados Unidos		113.766	0,16	
EUR	200.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.33% 25/11/2025	186.612	0,27	Total de bonos		113.766	0,16	
GBP	191.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	207.210	0,30	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
EUR	144.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	141.740	0,20			113.766	0,16	
EUR	123.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	118.160	0,17					

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*
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
Bonos			
REINO UNIDO			
GBP	520.000	Bellis Acquisition Company plc 3.25% 16/02/2026	486.717 0,70
GBP	1.405.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	1.500.398 2,14
GBP	178.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	169.673 0,24
GBP	267.000	Talktalk Telecom Group plc 3.88% 20/02/2025	254.077 0,36
Total de Reino Unido		2.410.865	3,44
Total de bonos		2.410.865	3,44
Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario		2.410.865	3,44
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
162	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	16.045	0,02
Total de Irlanda		16.045	0,02
Total de fondos		16.045	0,02
Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		16.045	0,02
Valor total de las inversiones		66.936.251	95,62

(Coste total: 70.953.282 EUR)

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

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	326.458	0,09	EUR	1.600.000	CNP Assurances FRN 18/07/2053	1.548.980	0,44
EUR	100.000	Erste Group Bank AG 0.13% 17/05/2028	81.614	0,02	EUR	9.500.000	Credit Agricole SA 0.13% 09/12/2027	8.033.738	2,27
EUR	2.800.000	Erste Group Bank AG FRN 16/01/2031	2.758.920	0,78	EUR	2.000.000	Credit Agricole SA FRN 21/09/2029	1.647.088	0,46
EUR	2.200.000	Telekom Finanzmanagement GmbH 1.50% 07/12/2026	2.047.713	0,58	EUR	2.600.000	Credit Mutuel Arkea SA 0.38% 03/10/2028	2.136.301	0,60
Total de Austria			5.214.705	1,47	EUR	700.000	Credit Mutuel Arkea SA FRN 11/06/2029	601.956	0,17
BÉLGICA				EUR	4.300.000	Danone SA 1.00% 26/03/2025	4.139.960	1,17	
EUR	700.000	Bpost SA 1.25% 11/07/2026	650.294	0,18	EUR	700.000	Electricite de France SA 1.00% 29/11/2033	502.625	0,14
EUR	1.000.000	KBC Group NV FRN 16/06/2027	892.947	0,25	EUR	300.000	Electricite de France SA 1.00% 29/11/2033	215.411	0,06
EUR	900.000	VGP NV 1.63% 17/01/2027	700.477	0,20	EUR	1.200.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	978.514	0,28
Total de Bélgica			2.243.718	0,63	EUR	675.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	656.318	0,19
DINAMARCA				EUR	800.000	Ile-de-France Mobilites 0.40% 28/05/2031	649.289	0,18	
EUR	5.471.000	Danske Bank AS FRN 10/01/2031	5.498.088	1,55	EUR	3.400.000	La Banque Postale SA 0.75% 23/06/2031	2.588.961	0,73
EUR	550.000	Nykredit Realkredit AS 0.38% 17/01/2028	458.186	0,13	EUR	800.000	La Poste SA 1.38% 21/04/2032	658.463	0,19
EUR	700.000	Orsted A/S FRN 24/11/3017	665.068	0,19	EUR	3.700.000	Orange SA 0.13% 16/09/2029	2.988.055	0,84
Total de Dinamarca			6.621.342	1,87	EUR	300.000	Orange SA 0.13% 16/09/2029	242.275	0,07
FINLANDIA				EUR	900.000	Orange SA 2.38% 18/05/2032	816.060	0,23	
EUR	1.500.000	Elenia Verkko Oyj 0.38% 06/02/2027	1.310.847	0,37	EUR	400.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	396.220	0,11
EUR	900.000	OP Corporate Bank plc 0.38% 26/02/2024	873.863	0,25	EUR	800.000	Regie Autonome des Transports Parisiens 0.88% 25/05/2027	732.458	0,21
Total de Finlandia			2.184.710	0,62	EUR	1.100.000	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR 0.75% 12/01/2034	833.363	0,23
FRANCIA				EUR	700.000	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR 1.88% 23/10/2037	557.645	0,16	
EUR	1.400.000	AXA SA FRN 07/10/2041	1.054.066	0,30	EUR	2.800.000	Sanofi 1.50% 01/04/2030	2.510.660	0,71
EUR	2.700.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.00% 21/11/2029	2.756.018	0,78	EUR	1.600.000	Schneider Electric SE 1.84% 13/10/2025	1.533.985	0,43
EUR	2.000.000	BNP Paribas SA FRN 14/10/2027	1.752.547	0,49	EUR	200.000	SNCF Réseau 2.25% 20/12/2047	154.173	0,04
EUR	2.200.000	BNP Paribas SA 1.00% 17/04/2024	2.139.842	0,60	EUR	1.100.000	Societe du Grand Paris EPIC 1.63% 08/04/2042	794.591	0,22
EUR	2.400.000	BPCE SA 0.63% 26/09/2023	2.368.979	0,67	EUR	2.500.000	Societe Generale SA FRN 02/12/2027	2.165.831	0,61
EUR	2.400.000	BPCE SA FRN 02/02/2034	1.972.241	0,56	EUR	900.000	Societe Generale SA FRN 02/12/2027	779.699	0,22
EUR	2.400.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/11/2026	2.158.399	0,61	EUR	1.800.000	Suez SACA 4.63% 03/11/2028	1.852.208	0,52
EUR	1.500.000	Caisse des Depots et Consignations 0.01% 15/09/2025	1.392.566	0,39	EUR	1.500.000	Unedic Asseo 0.25% 25/11/2029	1.259.671	0,36
EUR	1.500.000	Caisse des Depots et Consignations 0.01% 01/06/2026	1.366.485	0,39	Total de Francia			58.935.641	16,63

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*				Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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					ALEMANIA (continuación)				
EUR	3.300.000	Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032	3.363.995	0,95	EUR	300.000	Vantage Towers AG 0.38% 31/03/2027	298.761	0,08
EUR	900.000	Bayerische Landesbodenkreditanstalt 0.25% 21/03/2036	630.725	0,18	EUR	900.000	Vantage Towers AG 0.75% 31/03/2030	896.263	0,26
EUR	1.100.000	Bayerische Landesbodenkreditanstalt 0.63% 22/11/2027	989.255	0,28	EUR	100.000	Vantage Towers AG 0.75% 31/03/2030	99.585	0,03
EUR	2.900.000	Commerzbank AG FRN 24/03/2026	2.669.007	0,75	EUR	2.600.000	Vonovia SE 1.38% 28/01/2026	2.355.823	0,65
EUR	1.500.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 0.35% 29/09/2031	1.187.205	0,33	EUR	3.900.000	Vonovia SE 1.50% 14/06/2041	2.055.797	0,58
EUR	600.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 0.63% 08/12/2050	305.912	0,09	EUR	2.600.000	Vonovia SE 1.88% 28/06/2028	2.217.763	0,63
EUR	2.700.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	2.533.886	0,71	EUR	1.100.000	Vonovia SE 4.75% 23/05/2027	1.076.499	0,30
EUR	2.000.000	Deutsche Bank AG FRN 23/02/2028	1.736.251	0,49	Total de Alemania			42.130.675	11,85
EUR	500.000	Deutsche Bank AG FRN 24/05/2028	453.981	0,13	IRLANDA				
EUR	425.000	Deutsche Kreditbank AG 0.01% 07/11/2029	349.101	0,10	EUR	2.620.000	AIB Group plc FRN 04/04/2028	2.377.042	0,67
EUR	600.000	Deutsche Kreditbank AG 0.88% 02/10/2028	534.266	0,15	EUR	5.214.000	AIB Group plc FRN 23/07/2029	5.108.561	1,44
EUR	1.985.000	E.ON SE 0.60% 01/10/2032	1.506.724	0,42	EUR	1.000.000	Bank of Ireland Group plc FRN 10/05/2027	881.710	0,25
EUR	1.700.000	E.ON SE 0.35% 28/02/2030	1.356.247	0,38	EUR	3.183.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	2.736.691	0,77
EUR	915.000	E.ON SE 0.60% 01/10/2032	694.535	0,20	EUR	750.000	Bank of Ireland Group plc FRN 16/07/2028	752.229	0,21
EUR	2.000.000	E.ON SE 1.63% 29/03/2031	1.730.507	0,49	EUR	600.000	ESB Finance DAC 1.00% 19/07/2034	458.337	0,13
EUR	4.500.000	Eurogrid GmbH 1.11% 15/05/2032	3.669.940	1,02	EUR	1.250.000	Kerry Group Financial Services Unltd Company 0.88% 01/12/2031	992.994	0,28
EUR	600.000	Hamburger Hochbahn AG 0.13% 24/02/2031	473.654	0,13	EUR	800.000	Lunar Funding V for Swisscom AG 1.13% 12/10/2026	734.793	0,21
EUR	300.000	Hamburger Hochbahn AG 0.13% 24/02/2031	236.827	0,07	Total de Irlanda			14.042.357	3,96
EUR	750.000	Mercedes-Benz Group AG 0.75% 10/09/2030	625.080	0,17	ITALIA				
EUR	250.000	Mercedes-Benz Group AG 0.75% 10/09/2030	208.360	0,06	EUR	700.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	563.733	0,16
EUR	2.800.000	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG FRN 26/05/2041	2.103.444	0,59	EUR	700.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	563.733	0,16
EUR	1.000.000	NRW Bank 0.10% 09/07/2035	693.123	0,20	EUR	1.100.000	Assicurazioni Generali SpA 1.71% 30/06/2032	822.938	0,23
EUR	2.900.000	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 05/07/2025	2.767.219	0,78	EUR	400.000	Banco BPM SpA 0.88% 15/07/2026	355.518	0,10
EUR	1.900.000	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 05/07/2025	1.813.005	0,51	EUR	1.200.000	Ferrovie dello Stato Italiane SpA 1.13% 09/07/2026	1.113.749	0,31
EUR	500.000	Vantage Towers AG 0.38% 31/03/2027	497.935	0,14	EUR	1.300.000	Ferrovie dello Stato Italiane SpA 1.50% 27/06/2025	1.244.598	0,35
					EUR	2.450.000	Intesa Sanpaolo SpA 5.25% 13/01/2030	2.544.074	0,72
					EUR	1.800.000	Snam SpA 0.00% 07/12/2028	1.454.244	0,41
					EUR	1.800.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.38% 23/06/2029	1.478.826	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)				
ITALIA (continuación)					PAÍSES BAJOS (continuación)				
EUR	400.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale FRN 09/02/2171	335.270	0,09	EUR	300.000	EnBW International Finance BV 1.88% 31/10/2033	250.903	0,07
EUR	200.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale FRN 09/02/2171	167.635	0,05	EUR	2.200.000	Enel Finance International NV 1.50% 21/07/2025	2.111.378	0,60
Total de Italia			10.644.318	3,00	EUR	1.775.000	Enexis Holding NV 0.38% 14/04/2033	1.322.493	0,37
LUXEMBURGO					EUR	221.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	172.893	0,05
EUR	2.850.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	2.645.430	0,75	EUR	1.029.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	805.007	0,23
EUR	400.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 12/02/2036	284.546	0,08	EUR	1.597.000	GSK Consumer Healthcare Capital NL BV 1.75% 29/03/2030	1.401.216	0,40
EUR	2.150.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	1.345.535	0,38	GBP	3.300.000	ING Groep NV FRN 07/12/2028	3.079.660	0,87
EUR	600.000	CPI Property Group SA 1.75% 14/01/2030	345.058	0,10	EUR	1.900.000	ING Groep NV 2.50% 15/11/2030	1.729.942	0,49
EUR	900.000	CPI Property Group SA 2.75% 12/05/2026	715.886	0,20	EUR	600.000	NE Property BV 3.38% 14/07/2027	528.578	0,15
EUR	1.259.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	946.873	0,27	EUR	100.000	NE Property BV 3.38% 14/07/2027	88.096	0,02
EUR	241.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	181.252	0,05	EUR	250.000	Nederlandse Financierings-Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV 0.13% 03/04/2027	223.116	0,06
EUR	4.600.000	Prologis International Funding II SA 1.63% 17/06/2032	3.433.248	0,97	EUR	1.200.000	Rentokil Initial Finance BV 3.88% 27/06/2027	1.198.534	0,34
EUR	2.100.000	Prologis International Funding II SA 3.13% 01/06/2031	1.810.449	0,51	EUR	900.000	Royal Schiphol Group NV 1.50% 05/11/2030	776.321	0,22
EUR	1.600.000	Segro Capital Sarl 0.50% 22/09/2031	1.089.248	0,31	EUR	300.000	Royal Schiphol Group NV 2.00% 06/04/2029	275.725	0,08
EUR	2.150.000	SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	1.976.122	0,56	EUR	1.000.000	Stedin Holding NV 0.00% 16/11/2026	890.395	0,25
Total de Luxemburgo			14.773.647	4,18	EUR	3.400.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	2.817.951	0,79
PAÍSES BAJOS					EUR	364.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	306.472	0,09
EUR	1.029.000	Achmea BV 3.63% 29/11/2025	1.027.058	0,29	EUR	2.200.000	Swisscom Finance BV 0.38% 14/11/2028	1.861.382	0,52
EUR	1.100.000	Allianz Finance II BV 0.00% 22/11/2026	987.468	0,28	EUR	500.000	Tennet Holding BV 0.50% 30/11/2040	326.138	0,09
EUR	2.600.000	Allianz Finance II BV 1.50% 15/01/2030	2.344.322	0,67	EUR	1.393.000	TenneT Holding BV 0.88% 16/06/2035	1.080.104	0,30
EUR	800.000	Cooperatieve Rabobank UA 0.25% 30/10/2026	718.120	0,20	EUR	1.160.000	TenneT Holding BV 3.88% 28/10/2028	1.188.823	0,34
USD	550.000	Cooperatieve Rabobank UA 1.00% 24/09/2026	454.950	0,13	EUR	1.100.000	TenneT Holding BV Perp FRN	1.082.337	0,30
GBP	1.000.000	Cooperatieve Rabobank UA 4.63% 23/05/2029	1.041.304	0,29	EUR	4.000.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	3.004.297	0,85
EUR	1.450.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	1.132.266	0,32	Total de Países Bajos			36.741.993	10,37
EUR	3.290.000	Digital Intrepid Holding BV 0.63% 15/07/2031	2.273.497	0,64	NORUEGA				
USD	251.000	EDP Finance BV 6.30% 11/10/2027	241.247	0,07	EUR	200.000	Avinor AS 0.75% 01/10/2030	163.063	0,05
					EUR	1.050.000	Avinor AS 0.75% 01/10/2030	856.079	0,24

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*				Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
NORUEGA (continuación)					REINO UNIDO (continuación)				
EUR	1.850.000	Avinor AS 1.00% 29/04/2025	1.753.478	0,49	GBP	740.000	Cadent Finance plc 5.75% 14/03/2034	858.285	0,24
EUR	200.000	Avinor AS 1.25% 09/02/2027	183.081	0,05					
EUR	2.326.000	DNB Bank ASA FRN 21/09/2027	2.288.336	0,65	GBP	200.000	Cardiff University 3.00% 07/12/2055	166.372	0,05
Total de Noruega			5.244.037	1,48	GBP	810.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	865.357	0,24
PORTUGAL					GBP	630.000	Ds Smith plc 2.88% 26/07/2029	618.066	0,17
EUR	700.000	Caixa Geral de Depositos SA FRN 31/10/2028	723.086	0,20	GBP	400.000	DWR Cymru Financing UK plc 2.38% 31/03/2034	339.250	0,10
Total de Portugal			723.086	0,20	GBP	300.000	Legal & General Group plc FRN 27/10/2045	333.382	0,09
ESPAÑA					EUR	950.000	Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	800.587	0,23
EUR	800.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.75% 04/06/2025	752.640	0,21	EUR	3.800.000	Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	3.202.350	0,90
EUR	1.000.000	Banco de Sabadell SA FRN 11/03/2027	903.286	0,25	EUR	3.000.000	Motability Operations Group plc 3.50% 17/07/2031	2.962.823	0,83
EUR	1.100.000	Banco Santander SA 1.13% 23/06/2027	984.331	0,28	EUR	308.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	302.087	0,09
EUR	4.200.000	CaixaBank SA FRN 21/01/2028	3.730.767	1,05	EUR	1.167.000	National Grid plc 3.88% 16/01/2029	1.161.072	0,33
EUR	1.000.000	CaixaBank SA FRN 26/05/2028	860.920	0,24	EUR	300.000	Nationwide Building Society 2.00% 28/04/2027	278.463	0,08
EUR	1.700.000	Iberdrola Finanzas SA 1.38% 11/03/2032	1.461.968	0,41	EUR	8.050.000	Natwest Group plc FRN 26/02/2030	6.469.674	1,83
EUR	1.600.000	Telefonica Emisiones SA 2.59% 25/05/2031	1.476.275	0,42	EUR	1.944.000	NatWest Group plc FRN 14/03/2028	1.967.532	0,55
Total de España			10.170.187	2,86	GBP	900.000	Pearson Funding plc 3.75% 04/06/2030	921.034	0,26
SUECIA					GBP	270.000	Platform HG Financing plc 1.93% 15/09/2041	201.320	0,06
EUR	1.500.000	Essity AB 1.13% 27/03/2024	1.464.887	0,41	GBP	400.000	RCB Bonds plc 3.50% 08/12/2031	387.270	0,11
EUR	100.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	89.915	0,03	GBP	500.000	RL Finance Bonds No. 2 plc FRN 30/11/2043	563.379	0,16
EUR	500.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	449.575	0,13	GBP	500.000	Severn Trent Utilities Finance plc 2.00% 02/06/2040	358.072	0,10
Total de Suecia			2.004.377	0,57	GBP	200.000	Stonewater Funding plc 1.63% 10/09/2036	155.592	0,04
SUIZA					EUR	5.130.000	Thames Water Utilities Finance plc 4.38% 18/01/2031	5.136.431	1,45
EUR	1.000.000	Credit Suisse AG 0.45% 19/05/2025	908.495	0,26	GBP	200.000	University College London 1.63% 04/06/2061	117.569	0,03
Total de Suiza			908.495	0,26	GBP	300.000	University of Southampton 2.25% 11/04/2057	203.073	0,06
REINO UNIDO					USD	1.000.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	901.082	0,25
GBP	250.000	Aster Treasury plc 1.41% 27/01/2036	196.297	0,06					
EUR	2.100.000	AstraZeneca plc 0.38% 03/06/2029	1.753.489	0,49					
GBP	800.000	BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	875.126	0,25					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado	% de valor				Valor de mercado	% de valor
Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo*	Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				
REINO UNIDO (continuación)					FRANCIA (continuación)				
EUR	8.450.000	WellCome Trust Limited 1.13% 21/01/2027	7.787.801	2,19	EUR	400.000	Agence France Locale 0.20% 20/03/2029	337.161	0,10
GBP	1.600.000	Yorkshire Building Society FRN 11/10/2030	1.586.602	0,44	EUR	1.000.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/02/2028	865.980	0,24
Total de Reino Unido			41.469.437	11,68	EUR	1.200.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/11/2030	957.563	0,27
ESTADOS UNIDOS					GBP	1.200.000	Caisse D'amortissement de la Dette Sociale 0.13% 15/12/2025	1.218.099	0,34
EUR	292.000	Air Products and Chemicals Inc. 4.00% 03/03/2035	294.046	0,08	EUR	300.000	Caisse Francaise de Financement Local 0.01% 07/05/2025	279.883	0,08
USD	2.600.000	Roche Holdings Inc. 2.38% 28/01/2027	2.239.780	0,63	EUR	1.100.000	Caisse Francaise de Financement Local 0.50% 19/02/2027	991.020	0,28
Total de Estados Unidos			2.533.826	0,71	EUR	2.100.000	City of Paris 1.38% 20/11/2034	1.705.894	0,48
Total de bonos			256.586.551	72,34	EUR	400.000	France (Govt of) 1.75% 25/06/2039	333.088	0,09
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					EUR	1.200.000	Region Ile de France 0.00% 20/04/2028	1.031.406	0,29
AUSTRIA					EUR	700.000	Region of Ile de France 0.50% 14/06/2025	661.393	0,19
EUR	700.000	Oesterreichische Kontrollbank AG 0.00% 08/10/2026	629.493	0,18	EUR	400.000	Region of Ile de France 0.61% 02/07/2040	251.192	0,07
Total de Austria			629.493	0,18	EUR	700.000	SNCF SA 1.00% 19/01/2061	296.525	0,08
BÉLGICA					EUR	600.000	Societe du Grand Paris EPIC 0.00% 25/11/2030	473.813	0,13
EUR	250.000	Belgium (Govt of) 1.25% 22/04/2033	214.516	0,06	EUR	100.000	Societe du Grand Paris EPIC 1.70% 25/05/2050	67.073	0,02
EUR	2.400.000	Communaute Francaise de Belgique 0.63% 11/06/2035	1.726.956	0,49	EUR	3.000.000	Unedic Asseo 0.00% 25/11/2028	2.542.674	0,72
EUR	1.400.000	Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap 0.38% 15/04/2030	1.164.173	0,33	EUR	1.700.000	Unedic Asseo 0.00% 19/11/2030	1.365.440	0,38
EUR	1.800.000	Region Wallonne 1.05% 22/06/2040	1.201.126	0,34	EUR	1.200.000	Unedic Asseo 0.10% 25/11/2026	1.081.014	0,30
Total de Bélgica			4.306.771	1,22	EUR	600.000	Unedic Asseo 1.75% 25/11/2032	536.618	0,15
FINLANDIA					Total de Francia				
EUR	1.700.000	Kuntarahoitus Oyj 0.05% 10/09/2035	1.171.158	0,33				18.647.059	5,24
Total de Finlandia			1.171.158	0,33	ALEMANIA				
FRANCIA					EUR	8.140.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2030	6.928.606	1,95
EUR	2.500.000	Action Logement Services 3.13% 28/09/2037	2.362.471	0,67	EUR	441.000	Germany (Govt of) 1.30% 15/10/2027	422.394	0,12
USD	1.400.000	Agence Francaise de Developpement EPIC 4.00% 21/09/2027	1.288.752	0,36	EUR	400.000	Hesse (Govt of) 0.01% 18/06/2031	315.901	0,09
					EUR	2.000.000	Investitionsbank Berlin 2.75% 04/10/2027	1.986.679	0,56
					EUR	2.453.000	Land Berlin 2.75% 14/02/2033	2.417.644	0,68
					EUR	3.500.000	Landwirtschaftliche Rentenbank 0.00% 22/09/2027	3.069.142	0,86

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal		Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal		Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				
ALEMANIA (continuación)					PAÍSES BAJOS (continuación)				
EUR	1.475.000	State of North Rhine-Westphalia 0.60% 04/06/2041	944.427	0,27	EUR	500.000	Netherlands (Govt of) 0.50% 15/01/2040	351.200	0,10
EUR	600.000	State of North Rhine-Westphalia Germany 0.95% 13/03/2028	545.457	0,15	Total de Países Bajos			5.043.796	1,44
Total de Alemania			16.630.250	4,68	REPÚBLICA DE COREA (SUR)				
					USD	571.000	Export-Import Bank of Korea 5.13% 11/01/2033	548.426	0,15
					Total de República de Corea (Sur)			548.426	0,15
HUNGRÍA					ESPAÑA				
EUR	1.777.000	Hungary (Govt of) 5.00% 22/02/2027	1.791.397	0,51	EUR	1.400.000	Autonomous Community of Andalusia 0.50% 30/04/2031	1.110.130	0,31
EUR	250.000	MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt 1.38% 24/06/2025	230.254	0,06	EUR	1.000.000	Autonomous Community of Andalusia 2.40% 30/04/2032	913.014	0,26
Total de Hungría			2.021.651	0,57	EUR	1.700.000	Autonomous Community of Madrid 0.42% 30/04/2030	1.393.384	0,39
IRLANDA					EUR	700.000	Autonomous Community of Madrid 1.57% 30/04/2029	635.070	0,18
EUR	25.000	Ireland (Govt of) 1.35% 18/03/2031	22.672	0,01	EUR	3.200.000	Autonomous Community of Madrid 1.72% 30/04/2032	2.766.825	0,78
Total de Irlanda			22.672	0,01	EUR	300.000	Basque (Govt of) 1.88% 30/07/2033	258.479	0,07
ITALIA					EUR	1.500.000	Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2025	1.409.226	0,41
EUR	800.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 1.00% 11/02/2030	653.277	0,18	EUR	200.000	Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2025	187.897	0,05
EUR	700.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 2.00% 20/04/2027	654.689	0,18	EUR	700.000	Instituto de Credito Oficial 0.25% 30/04/2024	679.020	0,19
EUR	800.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 2.13% 21/03/2026	765.117	0,22	EUR	1.810.000	Instituto de Credito Oficial 0.75% 31/10/2023	1.782.823	0,51
EUR	250.000	Italy (Govt of) 1.50% 30/04/2045	151.373	0,04	EUR	25.000	Spain (Govt of) 1.00% 30/07/2042	15.837	0,00
Total de Italia			2.224.456	0,62	EUR	400.000	Xunta de Galicia 0.08% 30/07/2027	351.421	0,10
LUXEMBURGO					Total de España			11.503.126	3,25
EUR	775.000	Luxembourg (Govt of) 0.00% 14/09/2032	590.271	0,17	SUPRANACIONAL				
Total de Luxemburgo			590.271	0,17	CAD	300.000	Asian Development Bank 1.50% 04/05/2028	186.602	0,05
PAÍSES BAJOS					CAD	800.000	Asian Development Bank 1.63% 28/01/2025	520.850	0,15
EUR	1.800.000	BNG Bank NV 3.00% 11/01/2033	1.784.622	0,50	GBP	1.500.000	Asian Development Bank FRN 23/05/2029	1.774.905	0,50
EUR	600.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 0.13% 03/09/2035	413.809	0,12	USD	200.000	Central American Bank for Economic Integration 5.00% 09/02/2026	186.040	0,05
EUR	800.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 1.50% 15/06/2039	627.208	0,18					
EUR	1.900.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 2.75% 17/12/2029	1.866.957	0,54					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado	% de valor			Valor de mercado	% de valor			
Valor nominal	Inversión	EUR	liquidativo*	Valor nominal	Inversión	EUR	liquidativo*			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)						
SUPRANACIONAL (continuación)				SUECIA						
EUR	1.000.000	Council of Europe Development Bank 0.00% 10/04/2026	912.814	0,26	SEK	3.000.000	Sweden (Govt of) 0.13% 09/09/2030	228.207	0,06	
EUR	1.450.000	Council of Europe Development Bank 0.38% 27/03/2025	1.371.154	0,39	Total de Suecia			228.207	0,06	
EUR	5.000.000	Council of Europe Development Bank 1.00% 13/04/2029	4.460.697	1,26	REINO UNIDO					
EUR	4.000.000	Council Of Europe Development Bank 0.00% 09/04/2027	3.547.004	0,99	GBP	1.118.000	International Finance Facility for Immunisation Company 2.75% 07/06/2025	1.232.254	0,35	
EUR	2.000.000	European Investment Bank 0.00% 15/05/2028	1.724.362	0,49	GBP	5.000	United Kingdom Gilt 0.88% 31/07/2033	4.387	0,00	
GBP	975.000	European Investment Bank 0.88% 15/05/2026	1.006.748	0,28	Total de Reino Unido			1.236.641	0,35	
EUR	100.000	European Union 0.00% 04/07/2035	68.428	0,02	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				91.675.946	25,84
EUR	700.000	European Union 0.00% 04/07/2035	478.995	0,14	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				348.262.497	98,18
EUR	1.700.000	European Union 0.10% 04/10/2040	988.051	0,28	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios					
EUR	5.240.000	European Union 0.30% 04/11/2050	2.486.704	0,69	Fondos					
EUR	1.500.000	European Union 0.75% 04/01/2047	889.415	0,25	IRLANDA					
EUR	500.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.01% 24/04/2028	430.756	0,12	260	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	25.702	0,01		
EUR	399.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.20% 21/01/2061	145.182	0,04	Total de Irlanda			25.702	0,01	
EUR	300.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.70% 22/10/2046	180.188	0,05	Total de fondos				25.702	0,01
EUR	100.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.70% 22/10/2046	60.063	0,02	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				25.702	0,01
USD	2.790.000	International Finance Facility for Immunisation Company 0.38% 06/11/2023	2.502.767	0,71	Valor total de las inversiones				348.288.199	98,19
USD	1.950.000	International Finance Facility for Immunisation Company 1.00% 21/04/2026	1.632.950	0,46	(Coste total: 397.241.488 EUR)					
SEK	3.000.000	Nordic Investment Bank 0.10% 13/10/2025	244.988	0,07						
EUR	1.100.000	Nordic Investment Bank 2.50% 30/01/2030	1.072.306	0,30						
Total de supranacional		26.871.969	7,57							

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

			Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*				Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos					Bonos (continuación)				
AUSTRALIA					DINAMARCA				
EUR	823.000	APA Infrastructure Limited 1.25% 15/03/2033	606.813	0,45	USD	1.819.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	1.466.217	1,07
EUR	935.000	APA Infrastructure Limited 2.00% 15/07/2030	794.491	0,58	Total de Dinamarca			1.466.217	1,07
EUR	418.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	318.911	0,23	FRANCIA				
EUR	250.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	190.736	0,14	EUR	152.000	Altice France SA 3.38% 15/01/2028	119.276	0,09
EUR	600.000	Australia & New Zealand Banking Group Limited FRN 05/05/2031	522.993	0,38	EUR	363.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	273.704	0,20
EUR	1.135.000	NBN Company Limited 4.13% 15/03/2029	1.161.260	0,86	EUR	1.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.13% 13/03/2029	1.019.315	0,75
GBP	840.000	Pacific National Finance Pty Limited 5.00% 19/09/2023	947.711	0,70	EUR	1.000.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	720.135	0,53
EUR	1.200.000	Westpac Banking Corp. 3.80% 17/01/2030	1.192.964	0,87	USD	850.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	686.393	0,50
USD	1.270.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	1.128.593	0,83	EUR	377.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	115.833	0,09
Total de Australia			6.864.472	5,04	EUR	480.000	Chrome Holdco SASU 5.00% 31/05/2029	356.926	0,26
					EUR	515.000	Constellium SE 3.13% 15/07/2029	419.027	0,31
					EUR	200.000	Electricite de France SA FRN 06/12/2171	196.158	0,14
BÉLGICA					EUR	431.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	378.494	0,28
EUR	364.000	Azelis Finance NV 5.75% 15/03/2028	369.460	0,27	EUR	357.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2027	312.313	0,23
EUR	400.000	Kbc Group NV Perp FRN	338.138	0,25	EUR	239.000	Faurecia SE 7.25% 15/06/2026	247.016	0,18
Total de Bélgica			707.598	0,52	EUR	367.000	Foncia Management SA 3.38% 31/03/2028	291.345	0,21
					EUR	677.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	658.262	0,48
BERMUDAS					EUR	554.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	534.933	0,39
USD	833.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	754.369	0,56	EUR	200.000	iliad SA 1.50% 14/10/2024	191.917	0,14
Total de Bermudas			754.369	0,56	EUR	200.000	iliad SA 1.88% 11/02/2028	168.386	0,12
					EUR	400.000	iliad SA 5.38% 14/06/2027	397.563	0,29
					EUR	270.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	267.449	0,20
					Total de Francia			7.354.445	5,39
CANADÁ					ALEMANIA				
EUR	299.000	Primo Water Holdings Inc. 3.88% 31/10/2028	260.870	0,19	EUR	700.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	578.640	0,43
Total de Canadá			260.870	0,19	EUR	1.000.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	739.132	0,54
					EUR	600.000	Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032	611.635	0,45
ISLAS CAIMÁN					EUR	477.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	441.460	0,33
USD	889.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	697.453	0,52	EUR	131.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	122.303	0,09
GBP	2.605.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	2.567.986	1,88	EUR	400.000	Commerzbank AG FRN 29/12/2031	329.461	0,24
USD	534.000	Tencent Holdings Limited 3.24% 03/06/2050	324.641	0,24	EUR	200.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	188.219	0,14
Total de Islas Caimán			3.590.080	2,64					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*				Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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)					GUATEMALA				
EUR	200.000	Commerzbank AG FRN 06/12/2032	198.150	0,15	USD	800.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	679.215	0,50
EUR	500.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	394.691	0,29	Total de Guatemala			679.215	0,50
EUR	300.000	Deutsche Bank AG FRN 05/09/2030	286.882	0,21	INDIA				
USD	200.000	Deutsche Bank AG FRN 10/02/2034	171.477	0,13	USD	1.328.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	935.154	0,68
EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	192.976	0,14	USD	535.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	432.482	0,32
EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	186.795	0,14	Total de India			1.367.636	1,00
EUR	400.000	Hannover Rueck SE FRN 26/08/2043	408.844	0,30	IRLANDA				
EUR	338.960	IHO Verwaltungs GmbH 8.75% 15/05/2028	347.594	0,26	EUR	450.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	408.141	0,30
EUR	7.500.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.01% 05/05/2027	6.671.201	4,90	EUR	461.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	430.490	0,32
EUR	600.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	459.850	0,34	EUR	720.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	619.044	0,46
EUR	513.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	447.773	0,32	EUR	969.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	920.619	0,68
EUR	492.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	427.563	0,32	GBP	135.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 4.88% 15/07/2028	131.257	0,10
EUR	705.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	574.195	0,42	Total de Irlanda			2.509.551	1,86
EUR	316.511	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	301.652	0,22	ITALIA				
EUR	200.000	Vier Gas Transport GmbH 0.13% 10/09/2029	158.482	0,12	EUR	880.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 26/09/2029	741.587	0,55
EUR	500.000	Vier Gas Transport GmbH 4.00% 26/09/2027	502.633	0,37	EUR	565.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	458.197	0,34
EUR	1.400.000	Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	1.446.289	1,06	EUR	216.000	Autostrade per l'Italia SpA 4.75% 24/01/2031	213.502	0,16
EUR	1.200.000	Volkswagen Financial Services AG 0.38% 12/02/2030	929.637	0,68	EUR	371.000	ENI SpA - Perp FRN	309.979	0,23
EUR	300.000	Vonovia SE 5.00% 23/11/2030	281.364	0,21	EUR	387.000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	345.688	0,25
Total de Alemania			17.398.898	12,80	EUR	586.000	IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3.75% 15/01/2028	516.657	0,38
GIBRALTAR					EUR	287.000	International Design Group SpA 6.50% 15/11/2025	277.113	0,20
EUR	160.000	888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027	136.213	0,10	USD	400.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	321.858	0,24
Total de Gibraltar			136.213	0,10	EUR	150.000	Lottomatica SpA 6.25% 15/07/2025	149.908	0,11
GRECIA					EUR	178.000	Lottomatica SpA 9.75% 30/09/2027	189.187	0,14
EUR	774.000	Eurobank SA FRN 26/01/2029	754.537	0,55					
Total de Grecia			754.537	0,55					

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)			
ITALIA (continuación)				LUXEMBURGO (continuación)			
EUR	241.000 Telecom Italia SpA 6.88% 15/02/2028	246.594	0,18	EUR	1.542.000 SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	1.417.292	1,04
	Total de Italia	3.770.270	2,78		Total de Luxemburgo	10.627.287	7,81
JERSEY - ISLAS DEL CANAL				MÉXICO			
GBP	196.000 Heathrow Funding Limited 6.45% 10/12/2031	237.712	0,17	EUR	486.000 Petroleos Mexicanos 3.75% 16/04/2026	435.236	0,32
EUR	245.000 Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	227.033	0,17	EUR	214.000 Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	169.584	0,12
	Total de Jersey - Islas del Canal	464.745	0,34		Total de México	604.820	0,44
LUXEMBURGO				PAÍSES BAJOS			
EUR	428.000 Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	342.267	0,25	EUR	362.000 ASR Nederland NV FRN 07/12/2043	375.845	0,28
EUR	843.000 Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	632.878	0,46	USD	505.000 Braskem Netherlands Finance BV 7.25% 13/02/2033	449.108	0,33
EUR	2.200.000 Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	1.476.812	1,09	EUR	160.000 Constellium SE 4.25% 15/02/2026	156.272	0,11
GBP	300.000 Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	215.830	0,16	EUR	525.000 Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	510.907	0,38
GBP	383.000 B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	410.464	0,30	EUR	350.000 Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	246.706	0,18
EUR	662.000 Canpack SA 2.38% 01/11/2027	541.270	0,40	EUR	545.000 Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	384.157	0,28
EUR	128.869 Cirsia Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	128.856	0,09	GBP	1.508.000 E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	1.809.972	1,34
EUR	311.000 Gamma Bondco Sarl 8.13% 15/11/2026	302.213	0,22	EUR	700.000 ING Groep NV FRN 29/09/2028	585.947	0,43
GBP	266.000 Garfunkelux Holdco 3 SA 7.75% 01/11/2025	230.595	0,17	EUR	800.000 ING Groep NV FRN 16/02/2031	673.362	0,50
EUR	1.200.000 Grand City Properties SA 0.13% 11/01/2028	848.448	0,62	EUR	450.000 LKQ European Holdings BV 4.13% 01/04/2028	436.307	0,32
USD	200.000 Greensaif Pipelines Bidco Sarl 6.13% 23/02/2038	189.732	0,14	USD	667.000 Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	526.134	0,39
EUR	1.430.000 InPost SA 2.25% 15/07/2027	1.219.963	0,90	EUR	416.000 Nobel Bidco BV 3.13% 15/06/2028	294.912	0,22
EUR	301.169 Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	299.744	0,22	EUR	519.000 Sagax Euro Mtn NL BV 0.75% 26/01/2028	380.696	0,28
EUR	280.000 Loarre Investments Sarl 6.50% 15/05/2029	261.350	0,20	EUR	1.258.000 Stedin Holding NV - Perp FRN	1.059.182	0,78
EUR	160.000 Loarre Investments Sarl FRN 15/05/2029	154.397	0,11	EUR	610.000 Stichting AK Rabobank Certificaten 6.50% 29/03/2070	590.608	0,43
USD	812.700 Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	691.238	0,51	EUR	496.921 Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	389.901	0,29
EUR	1.406.000 P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	1.057.430	0,78	EUR	100.000 Telefonica Europe BV FRN 23/11/2171	102.023	0,07
EUR	222.000 Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	206.508	0,15	EUR	100.000 Telefonica Europe BV - Perp FRN	83.333	0,06
				EUR	600.000 Telefonica Europe BV Perp FRN	587.009	0,43
				EUR	1.147.000 Tennet Holding BV FRN 22/10/2168	1.071.534	0,79

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*				Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
PAÍSES BAJOS (continuación)					SUIZA (continuación)				
EUR	1.000.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	751.074	0,55	EUR	1.255.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	824.054	0,61
EUR	280.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	259.187	0,19	EUR	300.000	Credit Suisse Group AG FRN 02/04/2032	251.399	0,18
EUR	261.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	215.893	0,16	Total de Suiza			1.751.714	1,29
EUR	109.000	United Group BV 4.63% 15/08/2028	80.849	0,06	REINO UNIDO				
EUR	284.000	Villa Dutch Bidco BV 9.00% 03/11/2029	269.254	0,20	GBP	500.000	Anglian Water Osprey Financing plc 2.00% 31/07/2028	459.493	0,34
Total de Países Bajos			12.290.172	9,05	EUR	318.000	Anglo American Capital plc 4.75% 21/09/2032	320.649	0,24
ESPAÑA					EUR	220.000	Anglo American Capital plc 5.00% 15/03/2031	225.995	0,17
GBP	700.000	Banco Santander SA 5.13% 25/01/2030	782.950	0,58	EUR	300.000	BCP V Modular Services Finance II plc 4.75% 30/11/2028	255.642	0,19
EUR	300.000	Cellnex Finance Company SA 0.75% 15/11/2026	265.046	0,20	GBP	710.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	528.004	0,38
EUR	200.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	166.719	0,12	EUR	1.113.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	1.031.931	0,76
EUR	823.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	750.932	0,55	EUR	936.000	British American Tobacco plc FRN 27/12/2169	764.040	0,56
EUR	155.000	Kaixo Bondco Telecom SA 5.13% 30/09/2029	136.463	0,10	EUR	825.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	665.580	0,49
EUR	553.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	509.161	0,37	GBP	350.000	Cadent Finance plc 2.25% 10/10/2035	280.604	0,21
EUR	298.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	278.398	0,20	GBP	548.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	585.451	0,43
Total de España			2.889.669	2,12	GBP	509.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	483.802	0,35
SUECIA					EUR	632.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	584.157	0,42
EUR	345.000	Heimstaden Bostad AB FRN 01/05/2170	177.524	0,13	EUR	1.074.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	1.046.949	0,77
EUR	660.000	Heimstaden Bostad AB FRN 15/04/2169	351.392	0,26	USD	728.000	HSBC Holdings plc FRN 11/08/2033	664.125	0,49
EUR	91.194	Intrum AB 3.13% 15/07/2024	87.781	0,06	USD	304.000	HSBC Holdings plc FRN 09/03/2044	296.718	0,22
EUR	164.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	151.976	0,11	GBP	576.000	HSBC Holdings plc FRN 16/11/2034	689.430	0,51
EUR	1.371.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	1.114.444	0,82	EUR	158.000	INEOS Finance plc 2.13% 15/11/2025	148.555	0,11
EUR	194.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	172.533	0,13	EUR	331.000	INEOS Finance plc 3.38% 31/03/2026	310.556	0,23
EUR	115.000	Verisure Holding AB 7.13% 01/02/2028	115.354	0,08	EUR	61.000	INEOS Finance plc 3.38% 31/03/2026	57.232	0,04
EUR	555.000	Verisure Midholding A 5.25% 15/02/2029	462.442	0,34	EUR	303.000	INEOS Finance plc 6.63% 15/05/2028	306.003	0,22
Total de Suecia			2.633.446	1,93	EUR	192.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	172.814	0,13
SUIZA									
EUR	857.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	676.261	0,50					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado	% de valor			Valor de mercado	% de valor		
Valor nominal	Inversión	EUR	liquidativo*	Valor nominal	Inversión	EUR	liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
REINO UNIDO (continuación)				ESTADOS UNIDOS					
EUR	130.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	117.009	0,09	EUR	1.034.000	Air Products and Chemicals Inc. 4.00% 03/03/2035	1.041.245	0,77
GBP	304.000	Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	329.308	0,24	USD	209.000	Amgen Inc. 4.20% 22/02/2052	163.436	0,12
GBP	315.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	340.566	0,25	USD	560.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	527.290	0,39
GBP	175.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	180.402	0,13	USD	901.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	852.482	0,62
GBP	380.733	Mitchells & Butlers Finance plc 6.01% 15/12/2028	404.394	0,30	USD	295.000	Amgen Inc. 5.75% 02/03/2063	282.706	0,21
EUR	483.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	473.727	0,35	EUR	660.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	546.561	0,40
EUR	600.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	485.713	0,36	EUR	190.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3.00% 01/09/2029	141.841	0,10
EUR	602.000	NatWest Group plc FRN 14/09/2032	493.418	0,36	EUR	540.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	428.629	0,32
EUR	1.587.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	1.336.719	0,98	EUR	713.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	565.949	0,42
EUR	244.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	226.300	0,17	EUR	521.000	Bank of America Corp. FRN 24/05/2032	409.990	0,30
GBP	297.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	313.001	0,23	EUR	889.000	Berkshire Hathaway Finance Corp. 1.50% 18/03/2030	782.533	0,58
GBP	165.000	Santander UK plc Perp 10.06% 15/11/2026	272.361	0,20	USD	243.000	Boeing Company 5.93% 01/05/2060	223.689	0,16
EUR	481.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	414.876	0,31	EUR	485.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	437.514	0,32
EUR	340.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	312.915	0,23	GBP	319.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	346.074	0,25
GBP	620.000	Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	624.817	0,46	EUR	113.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	108.554	0,08
EUR	800.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	691.708	0,51	GBP	145.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	158.652	0,12
EUR	489.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	396.589	0,29	EUR	938.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.87% 03/08/2027	910.470	0,67
GBP	221.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.25% 15/01/2030	205.204	0,15	GBP	491.000	Ford Motor Credit Company LLC 6.86% 05/06/2026	558.241	0,41
GBP	400.000	Virgin Money UK plc FRN 24/04/2026	422.245	0,31	USD	118.000	Goodman USA Finance Three LLC 3.70% 15/03/2028	100.373	0,07
EUR	317.000	Virgin Money UK plc FRN 29/10/2028	302.403	0,22	EUR	428.000	Honeywell International Inc. 4.13% 02/11/2034	434.466	0,32
GBP	429.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.00% 31/01/2029	404.884	0,30	GBP	342.000	International Business Machines Corp. 4.88% 06/02/2038	376.130	0,28
EUR	432.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	395.327	0,29	USD	560.000	JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	428.343	0,31
USD	650.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	585.703	0,43	USD	1.627.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	1.259.305	0,92
GBP	227.000	Wessex Water Services Finance plc 5.13% 31/10/2032	255.144	0,19	EUR	576.000	Metropolitan Life Global Funding I 3.75% 05/12/2030	568.947	0,42
GBP	752.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	647.485	0,48	GBP	492.000	Morgan Stanley FRN 18/11/2033	571.148	0,42
					GBP	200.000	MPT Operating Partnership LP 2.55% 05/12/2023	216.631	0,16
		Total de Reino Unido	20.509.948	15,09					

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)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)						
ESTADOS UNIDOS (continuación)				COSTA DE MARFIL (continuación)						
EUR	1.728.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	1.668.125	1,23	EUR	290.000	Ivory Coast (Govt of) 5.88% 17/10/2031	238.859	0,18	
EUR	2.160.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	2.125.447	1,56						
EUR	1.212.000	New York Life Global Funding 3.63% 09/01/2030	1.185.038	0,86	Total de Costa de Marfil		444.939	0,33		
EUR	638.000	Northwestern Mutual Global Funding 4.11% 15/03/2030	646.514	0,48						
USD	220.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	214.005	0,16	SENEGAL					
USD	265.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	284.007	0,21	EUR	390.000	Senegal (Govt of) 4.75% 13/03/2028	328.643	0,24	
EUR	513.000	Olympus Water USA Holding Corp. 3.88% 01/10/2028	418.976	0,31	Total de Senegal		328.643	0,24		
EUR	280.000	Southern Company FRN 15/09/2081	221.999	0,16	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				4.298.403	3,16
USD	1.070.000	Stellantis Finance USA Inc. 6.38% 12/09/2032	1.033.720	0,76	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				125.607.063	92,33
GBP	350.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	384.569	0,28						
USD	1.738.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	1.298.889	0,95	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente					
Total de Estados Unidos		21.922.488	16,10							
Total de bonos		121.308.660	89,17							
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda										
EGIPTO										
EUR	450.000	Egypt (Govt of) 5.63% 16/04/2030	270.450	0,20						
Total de Egipto		270.450	0,20							
ALEMANIA										
EUR	2.300.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.01% 31/03/2025	2.168.516	1,59						
GBP	800.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.13% 04/07/2025	852.983	0,63						
Total de Alemania		3.021.499	2,22							
HUNGRÍA										
EUR	231.000	Hungary (Govt of) 5.00% 22/02/2027	232.872	0,17						
Total de Hungría		232.872	0,17							
COSTA DE MARFIL										
EUR	250.000	Ivory Coast (Govt of) 5.25% 22/03/2030	206.080	0,15						
									</	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)				
Bonos (continuación)				
REINO UNIDO				
EUR	451.000	BCP V Modular Services Finance II plc 6.75% 30/11/2029	361.422	0,27
GBP	812.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	867.134	0,64
GBP	375.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	357.457	0,26
Total de Reino Unido			1.586.013	1,17
Total de bonos			1.597.013	1,18
Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			1.597.013	1,18

Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios

Fondos

IRLANDA

10.150	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	1.003.346	0,74
Total de Irlanda		1.003.346	0,74
Total de fondos		1.003.346	0,74
Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		1.003.346	0,74
Valor total de las inversiones		128.688.046	94,60
(Coste total: 144.483.819 EUR)			

* Diferencias menores debido al redondeo.

** Título a su valor razonable.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

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					COLOMBIA				
USD	200.000	Ooredoo International Finance Limited 2.63% 08/04/2031	173.952	0,45	USD	500.000	Ecopetrol SA 4.63% 02/11/2031	389.133	1,01
					USD	500.000	Ecopetrol SA 6.88% 29/04/2030	460.957	1,20
		Total de Bermudas	173.952	0,45			Total de Colombia	850.090	2,21
BRASIL					GHANA				
USD	500.000	Light Servicos de Eletricidade SA 4.38% 18/06/2026	147.813	0,38	USD	200.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	119.750	0,31
		Total de Brasil	147.813	0,38			Total de Ghana	119.750	0,31
CANADÁ					GUATEMALA				
USD	300.000	MEGlobal Canada ULC 5.00% 18/05/2025	298.266	0,77	USD	460.000	CT Trust 5.13% 03/02/2032	384.813	1,00
					USD	600.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	553.450	1,43
		Total de Canadá	298.266	0,77			Total de Guatemala	938.263	2,43
ISLAS CAIMÁN					HONG KONG				
USD	200.000	AAC Technologies Holdings Inc. 3.00% 27/11/2024	186.380	0,48	USD	800.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	807.390	2,09
USD	200.000	CIFI Holdings Group Company Limited 0.00% 16/07/2025	42.769	0,11	USD	214.000	Lenovo Group Limited 6.54% 27/07/2032	216.863	0,56
USD	200.000	CK Hutchison International 17 II Limited 3.25% 29/09/2027	189.145	0,49	USD	330.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	250.763	0,65
USD	440.000	Country Garden Holdings Company Limited 3.13% 22/10/2025	258.299	0,67			Total de Hong Kong	1.275.016	3,30
USD	212.000	ENN Energy Holdings Limited 2.63% 17/09/2030	177.723	0,46	INDIA				
USD	400.000	Goodman HK Finance 3.00% 22/07/2030	342.638	0,89	USD	250.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	179.688	0,47
USD	400.000	Meituan 3.05% 28/10/2030	320.404	0,83	USD	220.000	Adani Green Energy Limited 4.38% 08/09/2024	190.575	0,49
USD	400.000	Melco Resorts Finance Limited 5.75% 21/07/2028	342.500	0,89	USD	400.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	317.351	0,82
USD	200.000	MGM China Holdings Limited 4.75% 01/02/2027	178.187	0,46	USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.20% 04/08/2027	159.023	0,41
USD	200.000	QNB Finance Limited 2.75% 12/02/2027	186.108	0,48	USD	200.000	Bharti Airtel Limited 4.38% 10/06/2025	196.977	0,51
USD	200.000	QNB Finance Limited 2.75% 12/02/2027	186.108	0,48	USD	400.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	351.304	0,91
USD	400.000	Saudi Electricity Global Sukuk Company 5 2.41% 17/09/2030	346.568	0,90	USD	200.000	Indian Railway Finance Corp. Limited 3.57% 21/01/2032	174.447	0,45
USD	200.000	Tencent Holdings Limited 2.88% 22/04/2031	172.474	0,45	USD	200.000	JSW Steel Limited 5.95% 18/04/2024	197.944	0,52
USD	367.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp. 1.63% 24/09/2025	336.791	0,87	USD	250.000	Reliance Industries Limited 3.67% 30/11/2027	235.268	0,61
USD	200.000	Vale Overseas Limited 3.75% 08/07/2030	178.840	0,46					
		Total de Islas Caimán	3.444.934	8,92					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión					
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)						
INDIA (continuación)					LUXEMBURGO						
USD	475.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	397.577	1,03	USD	500.000	Altice Financing SA 5.00% 15/01/2028	406.875	1,05		
	Total de India		2.400.154	6,22	USD	400.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl 6.13% 23/02/2038	412.269	1,07		
INDONESIA					USD	550.000	Hidroviás International Finance SARL 4.95% 08/02/2031	392.831	1,02		
USD	295.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT 4.75% 13/05/2025	291.739	0,76	USD	250.000	MHP Lux SA 6.95% 03/04/2026	127.883	0,33		
USD	250.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.45% 15/05/2030	246.997	0,64	USD	500.000	MHP SE 7.75% 10/05/2024	277.489	0,72		
USD	600.000	Sri Rejeki Isman TBK PT 7.25% 16/01/2025	22.500	0,06	USD	544.500	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	503.159	1,30		
	Total de Indonesia		561.236	1,46	Total de Luxemburgo			2.120.506	5,49		
IRLANDA					MAURICIO						
USD	400.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	253.020	0,66	USD	200.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	192.794	0,50		
USD	200.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 3.05% 23/01/2025	150.284	0,39	USD	400.000	HTA Group Limited 7.00% 18/12/2025	380.750	0,99		
	Total de Irlanda		403.304	1,05	USD	300.000	Network I2i Limited Perp FRN	283.986	0,74		
ISLA DE MAN					Total de Mauricio					857.530	2,23
USD	200.000	AngloGold Ashanti Holdings plc 3.75% 01/10/2030	175.051	0,45	MÉXICO						
USD	400.000	Gohl Capital Limited 4.25% 24/01/2027	368.502	0,95	USD	500.000	BBVA Bancomer SA FRN 13/09/2034	436.875	1,13		
	Total de Isla de Man		543.553	1,40	USD	400.000	Braskem Idesa SAPI 6.99% 20/02/2032	302.750	0,78		
JERSEY - ISLAS DEL CANAL					USD	400.000	Cemex SAB de CV 7.38% 05/06/2027	413.220	1,07		
USD	200.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	164.822	0,43	USD	200.000	Cemex SAB de CV FRN 14/06/2171	201.443	0,52		
USD	440.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 3.25% 30/09/2040	348.725	0,90	USD	237.000	Gruma SAB de CV 4.88% 01/12/2024	235.815	0,61		
	Total de Jersey - Islas del Canal		513.547	1,33	USD	400.000	Petroleos Mexicanos 6.70% 16/02/2032	319.347	0,83		
KAZAJISTÁN					USD	118.000	Petroleos Mexicanos 10.00% 07/02/2033	112.690	0,29		
USD	400.000	KazMunayGas National Company JSC 4.75% 24/04/2025	389.906	1,01	USD	400.000	Sitios Latinoamerica SAB de CV 5.38% 04/04/2032	360.467	0,93		
USD	400.000	KazMunayGas National Company JSC 6.38% 24/10/2048	333.750	0,86	Total de México			2.382.607	6,16		
	Total de Kazajistán		723.656	1,87	MARRUECOS						
					USD	240.000	OCP SA 3.75% 23/06/2031	198.382	0,51		
					USD	557.000	OCP SA 6.88% 25/04/2044	507.572	1,32		
					Total de Marruecos			705.954	1,83		

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal		Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal		Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
PAÍSES BAJOS					ARABIA SAUDÍ				
USD	330.000	Braskem Netherlands Finance BV 4.50% 31/01/2030	281.418	0,73	USD	400.000	Saudi Arabian Oil Company 2.25% 24/11/2030	338.454	0,88
USD	357.200	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	321.480	0,83	USD	500.000	Saudi Arabian Oil Company 2.25% 24/11/2030	423.068	1,10
USD	230.000	Metinvest BV 8.50% 23/04/2026	142.600	0,37	USD	400.000	Saudi Arabian Oil Company 3.50% 16/04/2029	375.204	0,97
USD	500.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	428.499	1,11	USD	200.000	Saudi Arabian Oil Company 3.50% 16/04/2029	187.602	0,49
USD	392.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 3.15% 01/10/2026	355.005	0,92	Total de Arabia Saudí			1.324.328	3,44
USD	250.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 4.75% 09/05/2027	234.780	0,61	SINGAPUR				
USD	200.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 7.88% 15/09/2029	209.625	0,54	USD	200.000	BOC Aviation Limited 2.63% 17/09/2030	171.157	0,44
Total de Países Bajos		1.973.407	5,11	USD	600.000	DBS Group Holdings Limited FRN 11/12/2028	596.860	1,55	
PERÚ					USD	200.000	SingTel Group Treasury Pte Limited 2.38% 28/08/2029	175.482	0,45
USD	500.000	Auna SAA 6.50% 20/11/2025	378.125	0,98	USD	450.000	United Overseas Bank Limited FRN 16/03/2031	403.184	1,04
USD	95.000	Volcan Compania Minera SAA 4.38% 11/02/2026	79.167	0,21	Total de Singapur			1.346.683	3,48
Total de Perú		457.292	1,19	SUDÁFRICA					
FILIPINAS					USD	200.000	Eskom Holdings 6.75% 06/08/2023	198.737	0,51
USD	250.000	Globe Telecom Inc. 2.50% 23/07/2030	200.720	0,52	USD	250.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	246.384	0,64
USD	200.000	International Container Terminal Services Inc. 4.75% 17/06/2030	188.513	0,49	Total de Sudáfrica			445.121	1,15
USD	357.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	325.537	0,84	TAILANDIA				
USD	200.000	PLDT Inc. 2.50% 23/01/2031	162.060	0,42	USD	700.000	Bangkok Bank plc FRN 25/09/2034	596.625	1,55
USD	230.000	SMC Global Power Holdings Corp. Perp FRN	188.781	0,49	USD	235.000	GC Treasury Center Company Limited 4.30% 18/03/2051	170.595	0,44
Total de Filipinas		1.065.611	2,76	USD	200.000	GCTreasury Centre Company 2.98% 18/03/2031	164.568	0,43	
CATAR					USD	200.000	Kasikornbank plc FRN 02/10/2031	176.378	0,46
USD	410.000	QatarEnergy 2.25% 12/07/2031	348.836	0,90	Total de Tailandia			1.108.166	2,88
Total de Catar		348.836	0,90	TURQUÍA					
REPÚBLICA DE COREA (SUR)					USD	380.000	KOC Holding AS 6.50% 11/03/2025	379.109	0,99
USD	200.000	Kookmin Bank 4.50% 01/02/2029	190.018	0,49	USD	450.000	Turk Telekomunikasyon AS 6.88% 28/02/2025	433.683	1,13
Total de República de Corea (Sur)		190.018	0,49	Total de Turquía			812.792	2,12	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
EMIRATOS ÁRABES UNIDOS					TURQUÍA				
USD	700.000	DP World Limited 6.85% 02/07/2037	782.431	2,03	USD	200.000	Turkey (Govt of) 4.88% 09/10/2026	181.232	0,47
		Total de Emiratos Árabes Unidos	782.431	2,03	USD	310.000	Turkey (Govt of) 9.38% 19/01/2033	317.108	0,82
					Total de Turquía				
					Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				
REINO UNIDO									
USD	300.000	Gazprom PJSC Via Gaz Finance plc 3.25% 25/02/2030	189.375	0,49					
USD	450.000	Nak Naftogaz Ukraine Via Kondor Finance plc 7.63% 08/11/2026	89.250	0,23					
		Total de Reino Unido	278.625	0,72					
ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)					Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				
USD	460.000	Central American Bottling Corp. 5.25% 27/04/2029	427.789	1,11	Fondos				
USD	400.000	Contemporary Ruiding Development Limited 2.63% 17/09/2030	339.978	0,88	IRLANDA				
USD	400.000	Elect Global Investments Limited Perp FRN	359.519	0,93	2.549.478	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund		2.549.478	6,61
USD	450.000	FPC Resources Limited 4.38% 11/09/2027	419.605	1,09	Total de Irlanda				
USD	400.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	403.613	1,04	Total de fondos				
USD	511.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	456.896	1,19	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				
USD	728.000	JGSH Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	655.548	1,70	Valor total de las inversiones				
USD	400.000	Studio City Finance Limited 5.00% 15/01/2029	308.000	0,80	(Coste total: 41.167.386 USD)				
USD	467.000	Tsmc Global Limited 0.75% 28/09/2025	423.170	1,10	* Diferencias menores debido al redondeo.				
		Total de Islas Vírgenes (Británicas)	3.794.118	9,84					
Total de bonos			32.387.559	83,92					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*					Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*			
Valor nominal		Inversión				Valor nominal		Inversión						
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						INDIA (continuación)								
USD	200.000	Azerbaijan (Govt of)	3.50%	01/09/2032	170.901	0,56	USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited	4.00%	30/07/2027	158.675	0,52	
Total de Azerbaiyán					170.901	0,56	Total de India					302.425	0,99	
BERMUDAS						INDONESIA								
USD	200.000	Ooredoo International Finance Limited	2.63%	08/04/2031	173.952	0,57	USD	450.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	5.45%	15/05/2030	444.594	1,46	
Total de Bermudas					173.952	0,57	Total de Indonesia					444.594	1,46	
ISLAS CAIMÁN						IRLANDA								
USD	319.000	Gaci First Investment Company	4.88%	14/02/2035	313.786	1,03	USD	200.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC	2.60%	16/09/2028	126.510	0,42	
USD	343.000	Gaci First Investment Company	5.25%	13/10/2032	356.801	1,18	Total de Irlanda					126.510	0,42	
Total de Islas Caimán					670.587	2,21								
COLOMBIA						ISLA DE MAN								
USD	345.000	Ecopetrol SA	6.88%	29/04/2030	318.061	1,05	USD	200.000	AngloGold Ashanti Holdings plc	3.75%	01/10/2030	175.051	0,58	
Total de Colombia					318.061	1,05	Total de Isla de Man					175.051	0,58	
GHANA						JERSEY - ISLAS DEL CANAL								
USD	230.000	Tullow Oil plc	7.00%	01/03/2025	137.713	0,45	USD	253.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited	2.63%	31/03/2036	208.500	0,69	
Total de Ghana					137.713	0,45	USD	263.108	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited	2.94%	30/09/2040	214.167	0,70	
GUATEMALA						Total de Jersey - Islas del Canal								
USD	200.000	Energuate Trust	5.88%	03/05/2027	184.483	0,61						422.667	1,39	
Total de Guatemala					184.483	0,61								
HONG KONG						KAZAJISTÁN								
USD	200.000	Lenovo Group Limited	5.88%	24/04/2025	201.848	0,66	USD	200.000	KazMunayGas National Company JSC	4.75%	19/04/2027	184.624	0,61	
USD	274.000	Lenovo Group Limited	6.54%	27/07/2032	277.665	0,92	USD	400.000	KazMunayGas National Company JSC	5.38%	24/04/2030	357.040	1,16	
USD	210.000	Xiaomi Best Time International Limited	2.88%	14/07/2031	159.577	0,52	Total de Kazajistán					541.664	1,77	
Total de Hong Kong					639.090	2,10								
INDIA						LUXEMBURGO								
USD	200.000	Adani Electricity Mumbai Limited	3.95%	12/02/2030	143.750	0,47	USD	200.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl	6.13%	23/02/2038	206.135	0,68	
							USD	180.000	Millicom International Cellular SA	6.25%	25/03/2029	166.334	0,55	
							Total de Luxemburgo					372.469	1,23	

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)				
MALASIA					EMIRATOS ÁRABES UNIDOS				
USD	200.000	Petronas Capital Limited 3.50% 21/04/2030	187.133	0,62	USD	200.000	Abu Dhabi Ports Company PJSC 2.50% 06/05/2031	169.500	0,56
		Total de Malasia	187.133	0,62	USD	500.000	DP World Limited 6.85% 02/07/2037	558.879	1,84
MÉXICO					USD	200.000	MDGH GMTN RSC Limited 5.50% 28/04/2033	213.127	0,70
USD	450.000	Comision Federal de Electricidad 3.88% 26/07/2033	344.796	1,14			Total de Emiratos Árabes Unidos	941.506	3,10
USD	300.000	Petroleos Mexicanos 5.95% 28/01/2031	229.896	0,76	REINO UNIDO				
USD	430.000	Petroleos Mexicanos 6.38% 23/01/2045	272.794	0,90	USD	204.000	Gazprom PJSC Via Gaz Finance plc 3.25% 25/02/2030	128.775	0,42
USD	900.000	Petroleos Mexicanos 6.70% 16/02/2032	718.531	2,35			Total de Reino Unido	128.775	0,42
USD	200.000	Petroleos Mexicanos 7.69% 23/01/2050	141.370	0,47	ESTADOS UNIDOS				
USD	96.000	Petroleos Mexicanos 10.00% 07/02/2033	91.680	0,30	USD	378.000	Petroleos Mexicanos 6.63% 15/06/2035	276.316	0,91
		Total de México	1.799.067	5,92			Total de Estados Unidos	276.316	0,91
PAÍSES BAJOS					ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)				
USD	250.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	214.250	0,70	USD	220.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	221.988	0,73
		Total de Países Bajos	214.250	0,70	USD	489.000	JGSH Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	440.333	1,45
CATAR					USD	200.000	State Grid Overseas Investment BVI Limited 1.63% 05/08/2030	165.157	0,54
USD	356.000	QatarEnergy 2.25% 12/07/2031	302.892	1,00	USD	265.000	Studio City Finance Limited 5.00% 15/01/2029	204.050	0,67
		Total de Catar	302.892	1,00			Total de Islas Vírgenes (Británicas)	1.031.528	3,39
ARABIA SAUDÍ					Total de bonos				
USD	400.000	Saudi Arabian Oil Company 2.25% 24/11/2030	338.454	1,11	Valores respaldados por hipotecas y activos				
		Total de Arabia Saudí	338.454	1,11	LUXEMBURGO				
SUDÁFRICA					USD	180.000	Millicom International Cellular SA 5.13% 15/01/2028	160.763	0,53
USD	200.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	197.107	0,65			Total de Luxemburgo	160.763	0,53
		Total de Sudáfrica	197.107	0,65	Total de valores respaldados por hipotecas y activos				
TURQUÍA									
USD	200.000	Turk Telekomunikasyon AS 6.88% 28/02/2025	192.747	0,64					
		Total de Turquía	192.747	0,64					

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					Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				
ANGOLA					COLOMBIA (continuación)				
USD	200.000	Angola (Govt of) 8.00% 26/11/2029	171.697	0,56	USD	223.000	Colombia (Govt of) 3.25% 22/04/2032	167.005	0,55
USD	200.000	Angola (Govt of) 9.38% 08/05/2048	157.896	0,52	Total de Colombia		1.065.066	3,49	
Total de Angola			329.593	1,08					
ARGENTINA					CROACIA				
USD	1.850.000	Argentina (Govt of) FRN 09/07/2035	485.311	1,60	USD	200.000	Croatia (Govt of) 6.00% 26/01/2024	201.577	0,66
USD	90.000	Argentina (Govt of) 1.50% 09/07/2046	24.297	0,08	Total de Croacia		201.577	0,66	
Total de Argentina			509.608	1,68					
BARÉIN					REPÚBLICA DOMINICANA				
USD	300.000	Bahrain (Govt of) 5.63% 18/05/2034	263.661	0,87	USD	200.000	Dominican Republic (Govt of) 4.88% 23/09/2032	170.820	0,56
USD	333.000	CBB International Sukuk Programme Company WLL 3.88% 18/05/2029	301.968	0,99	USD	222.000	Dominican Republic (Govt of) 5.88% 30/01/2060	170.558	0,56
Total de Baréin			565.629	1,86	USD	151.000	Dominican Republic (Govt of) 6.40% 05/06/2049	126.878	0,42
					USD	106.000	Dominican Republic (Govt of) 7.45% 30/04/2044	102.452	0,34
Total de República Dominicana			570.708	1,88					
BRASIL					ECUADOR				
USD	433.000	Brazil (Govt of) 3.88% 12/06/2030	388.621	1,28	USD	192.950	Ecuador (Govt of) 1.50% 31/07/2040	58.781	0,19
USD	200.000	Brazil (Govt of) 5.00% 27/01/2045	158.261	0,52	USD	344.160	Ecuador (Govt of) 2.50% 31/07/2035	114.868	0,38
Total de Brasil			546.882	1,80	Total de Ecuador		173.649	0,57	
CHILE					EGIPTO				
USD	200.000	Chile (Govt of) 3.50% 25/01/2050	150.766	0,50	EUR	200.000	Egypt (Govt of) 6.38% 11/04/2031	130.317	0,43
Total de Chile			150.766	0,50	USD	250.000	Egypt (Govt of) 7.30% 30/09/2033	154.412	0,51
CHINA					USD	250.000	Egypt (Govt of) 7.63% 29/05/2032	159.666	0,53
USD	200.000	China (Govt of) 1.95% 03/12/2024	192.568	0,63	USD	300.000	Egypt (Govt of) 7.90% 21/02/2048	167.563	0,55
Total de China			192.568	0,63	Total de Egipto		611.958	2,02	
COLOMBIA					GHANA				
USD	800.000	Colombia (Govt of) 3.00% 30/01/2030	629.543	2,06	USD	364.000	Ghana (Govt of) 0.00% 07/05/2042	124.215	0,41
USD	350.000	Colombia (Govt of) 3.13% 15/04/2031	268.518	0,88	Total de Ghana		124.215	0,41	
					GUATEMALA				
					USD	250.000	Guatemala (Govt of) 6.13% 01/06/2050	238.571	0,78
Total de Guatemala			238.571	0,78	Total de Guatemala		238.571	0,78	

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)			
HUNGRÍA				MONGOLIA			
USD	200.000 Hungary (Govt of) 2.13% 22/09/2031	154.624	0,51	USD	200.000 Mongolia (Govt of) 8.65% 19/01/2028	197.219	0,65
USD	200.000 Hungary (Govt of) 3.13% 21/09/2051	123.910	0,41	Total de Mongolia		197.219	0,65
EUR	58.000 Hungary (Govt of) 5.00% 22/02/2027	63.525	0,21	NIGERIA			
USD	200.000 Hungary (Govt of) 6.75% 25/09/2052	208.090	0,68	USD	250.000 Nigeria (Govt of) 7.38% 28/09/2033	178.123	0,59
Total de Hungría		550.149	1,81	USD	200.000 Nigeria (Govt of) 7.63% 28/11/2047	128.542	0,42
INDIA				Total de Nigeria		306.665	1,01
USD	400.000 Export-Import Bank of India 3.25% 15/01/2030	353.054	1,16	OMÁN			
Total de India		353.054	1,16	USD	200.000 Oman (Govt of) 6.25% 25/01/2031	204.420	0,67
INDONESIA				USD	220.000 Oman (Govt of) 6.75% 17/01/2048	209.178	0,69
USD	200.000 Indonesia (Govt of) 3.70% 30/10/2049	159.593	0,53	Total de Omán		413.598	1,36
USD	200.000 Indonesia (Govt of) 4.30% 31/03/2052	174.410	0,57	PAKISTÁN			
USD	350.000 Indonesia (Govt of) 4.75% 18/07/2047	329.285	1,08	USD	200.000 Pakistan (Govt of) 6.88% 05/12/2027	72.970	0,24
IDR	5.360.000.000 Indonesia (Govt of) 6.38% 15/04/2032	349.885	1,15	Total de Pakistán		72.970	0,24
USD	200.000 Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 2.30% 23/06/2025	190.963	0,63	PANAMÁ			
Total de Indonesia		1.204.136	3,96	USD	200.000 Panama (Govt of) 2.25% 29/09/2032	153.842	0,51
COSTA DE MARFIL				USD	302.000 Panama (Govt of) 3.30% 19/01/2033	253.438	0,83
EUR	477.000 Ivory Coast (Govt of) 5.88% 17/10/2031	426.846	1,40	USD	200.000 Panama (Govt of) 4.50% 19/01/2063	144.971	0,48
Total de Costa de Marfil		426.846	1,40	USD	200.000 Panama (Govt of) 6.40% 14/02/2035	209.273	0,69
MÉXICO				Total de Panamá		761.524	2,51
USD	650.000 Mexico (Govt of) 3.25% 16/04/2030	584.361	1,92	PARAGUAY			
USD	300.000 Mexico (Govt of) 4.60% 10/02/2048	245.944	0,81	USD	340.000 Paraguay (Govt of) 5.60% 13/03/2048	303.297	1,00
MXN	85.000 Mexico (Govt of) 8.50% 31/05/2029	463.752	1,53	USD	200.000 Paraguay (Govt of) 6.10% 11/08/2044	194.031	0,64
Total de México		1.294.057	4,26	Total de Paraguay		497.328	1,64

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Estado de la Cartera

(continuación)

				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*					Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*			
Valor nominal	Inversión					Valor nominal	Inversión							
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)								
PERÚ						TURQUÍA (continuación)								
USD	132.000	Peru (Govt of)	3.00%	15/01/2034	108.211	0,36	USD	425.000	Turkey (Govt of)	6.00%	25/03/2027	394.366	1,30	
		Total de Perú			108.211	0,36	USD	250.000	Turkey (Govt of)	6.88%	17/03/2036	215.401	0,71	
FILIPINAS						USD	315.000	Turkey (Govt of)	9.38%	14/03/2029	321.885	1,06		
USD	539.000	Philippine (Govt of)	3.20%	06/07/2046	402.120	1,32	USD	375.000	Turkey (Govt of)	9.38%	19/01/2033	383.599	1,26	
		Total de Filipinas			402.120	1,32	Total de Turquía			1.693.541	5,57			
CATAR						UCRANIA								
USD	450.000	Qatar (Govt of)	3.75%	16/04/2030	441.067	1,45	USD	518.000	Ukraine (Govt of)	0.00%	21/05/2031	92.123	0,30	
USD	200.000	Qatar (Govt of)	4.82%	14/03/2049	197.907	0,65	USD	560.000	Ukraine (Govt of)	7.75%	01/09/2026	107.100	0,35	
USD	200.000	Qatar (Govt of)	5.10%	23/04/2048	204.318	0,67	Total de Ucrania			199.223	0,65			
		Total de Catar			843.292	2,77	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda						16.753.854	55,11
RUMANÍA						Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa						27.204.559	89,49	
USD	252.000	Romania (Govt of)	3.00%	27/02/2027	230.088	0,76	Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario							
USD	300.000	Romania (Govt of)	4.00%	14/02/2051	211.265	0,69	Bonos							
USD	246.000	Romania (Govt of)	5.25%	25/11/2027	242.997	0,80	LUXEMBURGO							
		Total de Rumanía			684.350	2,25	USD	210.000	Hidroviás International Finance SARL 4.95%	08/02/2031	149.990	0,49		
ARABIA SAUDÍ						Total de Luxemburgo						149.990	0,49	
USD	300.000	Saudi (Govt of)	3.45%	02/02/2061	213.411	0,70	VENEZUELA							
USD	500.000	Saudi (Govt of)	3.75%	21/01/2055	387.805	1,28	USD	1.999.683	Petroleos de Venezuela SA 6.00%	15/11/2026	99.584	0,33		
USD	285.000	Saudi (Govt of)	4.50%	26/10/2046	251.115	0,83	Total de Venezuela			99.584	0,33			
USD	239.000	Saudi (Govt of)	4.88%	18/07/2033	243.062	0,80	Total de bonos						249.574	0,82
		Total de Arabia Saudí			1.095.393	3,61								
SUDÁFRICA														
USD	500.000	South Africa (Govt of)	5.75%	30/09/2049	369.388	1,22								
		Total de Sudáfrica			369.388	1,22								
TURQUÍA														
USD	430.000	Turkey (Govt of)	5.13%	17/02/2028	378.290	1,24								

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*
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)			
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			
VENEZUELA			
USD	2.004.400 Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024	220.484	0,73
Total de Venezuela		220.484	0,73
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda		220.484	0,73
Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario		470.058	1,55
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
1.596.398	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	1.596.398	5,25
Total de Irlanda		1.596.398	5,25
Total de fondos		1.596.398	5,25
Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		1.596.398	5,25
Valor total de las inversiones		29.271.015	96,29
(Coste total: 36.073.701 USD)			

* Diferencias menores debido al redondeo.

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

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión					
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)						
BRASIL					INDIA (continuación)						
USD	600.000	Light Servicios de Eletricidade SA 4.38% 18/06/2026	177.375	0,30	USD	600.000	JSW Steel Limited 5.95% 18/04/2024	593.831	0,99		
	Total de Brasil		177.375	0,30	USD	700.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	585.905	0,98		
					Total de India					1.786.111	2,98
CANADÁ					INDONESIA						
USD	400.000	MEGlobal Canada ULC 5.00% 18/05/2025	397.688	0,66	USD	1.200.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 4.75% 15/05/2025	1.186.658	1,98		
	Total de Canadá		397.688	0,66	USD	700.000	Pertamina Persero PT 1.40% 09/02/2026	636.556	1,06		
ISLAS CAIMÁN					USD	1.200.000	Sri Rejeki Isman TBK PT 7.25% 16/01/2025	45.000	0,08		
USD	600.000	CIFI Holdings Group Company Limited 0.00% 16/07/2025	128.306	0,21	Total de Indonesia					1.868.214	3,12
USD	700.000	Country Garden Holdings Company Limited 3.13% 22/10/2025	410.931	0,69	IRLANDA						
USD	975.000	Gaci First Investment Company 5.00% 13/10/2027	990.847	1,65	USD	400.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	253.020	0,42		
USD	650.000	Meituan 3.05% 28/10/2030	520.657	0,87	USD	300.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 3.05% 23/01/2025	225.427	0,38		
USD	500.000	MGM China Holdings Limited 4.75% 01/02/2027	445.466	0,74	Total de Irlanda					478.447	0,80
USD	1.300.000	SA Global Sukuk Limited 1.60% 17/06/2026	1.192.945	1,99	JERSEY - ISLAS DEL CANAL						
Total de Islas Caimán					3.689.152	6,15	USD	1.021.118	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 1.75% 30/09/2027	953.829	1,59
GHANA					Total de Jersey - Islas del Canal					953.829	1,59
USD	600.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	359.250	0,60	KAZAJISTÁN						
Total de Ghana					359.250	0,60	USD	1.500.000	KazMunayGas National Company JSC 4.75% 24/04/2025	1.462.147	2,44
GUATEMALA					Total de Kazajistán					1.462.147	2,44
USD	820.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	756.382	1,26	LUXEMBURGO						
Total de Guatemala					756.382	1,26	USD	500.000	Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA 5.15% 11/02/2026	382.500	0,64
HONG KONG					USD	750.000	Millicom International Cellular SA 4.50% 27/04/2031	601.875	1,01		
USD	380.000	Lenovo Group Limited 5.83% 27/01/2028	383.706	0,64	USD	200.000	TMS Issuer Sarl 5.78% 23/08/2032	208.648	0,35		
USD	500.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	504.619	0,84	Total de Luxemburgo					1.193.023	2,00
Total de Hong Kong					888.325	1,48					
INDIA											
USD	700.000	Adani Green Energy Limited 4.38% 08/09/2024	606.375	1,01							

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

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

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal		Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal		Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)						
MAURICIO					ARABIA SAUDÍ (continuación)						
USD	1.000.000	HTA Group Limited 7.00% 18/12/2025	951.875	1,59	USD	450.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	440.442	0,73		
Total de Mauricio				951.875	Total de Arabia Saudí				783.008	1,30	
MÉXICO					SUDÁFRICA						
USD	650.000	Cemex SAB de CV 7.38% 05/06/2027	671.483	1,12	USD	1.000.000	Eskom Holdings 6.75% 06/08/2023	993.685	1,65		
USD	1.200.000	Petroleos Mexicanos 4.25% 15/01/2025	1.146.217	1,91	USD	300.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	295.660	0,49		
USD	800.000	Petroleos Mexicanos 6.49% 23/01/2027	727.381	1,21	Total de Sudáfrica				1.289.345	2,14	
USD	800.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 16/10/2025	794.499	1,33	TURQUÍA						
USD	2.600.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 04/08/2026	2.471.366	4,12	USD	600.000	Turk Telekomunikasyon AS 6.88% 28/02/2025	578.244	0,96		
Total de México				5.810.946	Total de Turquía				578.244	0,96	
PAÍSES BAJOS					REINO UNIDO						
USD	421.000	Braskem Netherlands Finance BV 7.25% 13/02/2033	406.772	0,68	USD	200.000	Nak Naftogaz Ukraine Via Kondor Finance plc 7.63% 08/11/2026	39.667	0,07		
USD	883.600	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	795.240	1,33	Total de Reino Unido				39.667	0,07	
USD	500.000	Metinvest BV 8.50% 23/04/2026	310.000	0,52	ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)						
USD	1.000.000	Syngenta Finance NV 4.44% 24/04/2023	999.341	1,67	USD	800.000	Central American Bottling Corp. 5.25% 27/04/2029	743.980	1,24		
Total de Paises Bajos				2.511.353	4,20	USD	400.000	Elect Global Investments Limited Perp FRN	359.519	0,60	
PERÚ					USD	1.000.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	998.548	1,67		
USD	800.000	Auna SAA 6.50% 20/11/2025	605.000	1,01	USD	700.000	Studio City Finance Limited 6.00% 15/07/2025	651.463	1,09		
Total de Perú				605.000	1,01	USD	700.000	Tsmc Global Limited 0.75% 28/09/2025	634.302	1,06	
FILIPINAS					Total de Islas Vírgenes (Británicas)				3.387.812	5,66	
USD	693.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	631.925	1,05	Total de bonos					31.234.976	52,11
Total de Filipinas				631.925	1,05	Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					
CATAR					ANGOLA						
USD	700.000	QatarEnergy 1.38% 12/09/2026	635.858	1,06	USD	800.000	Angola (Govt of) 9.50% 12/11/2025	799.420	1,33		
Total de Catar				635.858	1,06	Total de Angola				799.420	1,33
ARABIA SAUDÍ											
USD	350.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	342.566	0,57							

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

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

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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					INDONESIA				
USD	1.500.000	Brazil (Govt of) 2.88% 06/06/2025	1.439.240	2,40	USD	640.000	Indonesia (Govt of) 4.55% 11/01/2028	641.636	1,07
USD	400.000	Brazil (Govt of) 4.25% 07/01/2025	396.816	0,66	Total de Indonesia		641.636	1,07	
Total de Brasil			1.836.056	3,06					
COLOMBIA					MONGOLIA				
USD	500.000	Colombia (Govt of) 3.13% 15/04/2031	383.596	0,64	USD	200.000	Mongolia (Govt of) 8.65% 19/01/2028	197.219	0,33
Total de Colombia			383.596	0,64	Total de Mongolia		197.219	0,33	
COSTA RICA					MARRUECOS				
USD	300.000	Costa Rica (Govt of) 4.38% 30/04/2025	294.572	0,49	USD	320.000	Morocco (Govt of) 5.95% 08/03/2028	327.408	0,55
Total de Costa Rica			294.572	0,49	Total de Marruecos		327.408	0,55	
REPÚBLICA DOMINICANA					NIGERIA				
USD	1.000.000	Dominican Republic (Govt of) 5.50% 27/01/2025	991.605	1,65	USD	900.000	Nigeria (Govt of) 6.50% 28/11/2027	736.478	1,23
USD	1.000.000	Dominican Republic (Govt of) 6.85% 29/01/2026	1.018.007	1,70	Total de Nigeria		736.478	1,23	
Total de República Dominicana			2.009.612	3,35					
EGIPTO					OMÁN				
USD	700.000	Egypt (Govt of) 3.88% 16/02/2026	519.808	0,87	USD	1.000.000	Oman (Govt of) 4.40% 01/06/2024	988.426	1,65
USD	400.000	Egypt (Govt of) 5.25% 06/10/2025	318.359	0,53	USD	1.700.000	Oman (Govt of) 4.75% 15/06/2026	1.666.510	2,78
USD	400.000	Egypt (Govt of) 5.80% 30/09/2027	282.259	0,47	Total de Omán		2.654.936	4,43	
USD	1.300.000	Egypt (Govt of) 5.88% 11/06/2025	1.067.159	1,78					
Total de Egipto			2.187.585	3,65	PAKISTÁN				
					USD	500.000	Pakistan (Govt of) 6.00% 08/04/2026	186.253	0,31
					USD	200.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 30/09/2025	78.750	0,13
Total de Ghana			256.060	0,43	Total de Pakistán		265.003	0,44	
GHANA					PANAMÁ				
USD	700.000	Ghana (Govt of) 0.00% 11/02/2027	256.060	0,43	USD	1.350.000	Panama (Govt of) 3.75% 16/03/2025	1.321.121	2,20
Total de Ghana			256.060	0,43	Total de Panamá		1.321.121	2,20	
HUNGRÍA					CATAR				
EUR	174.000	Hungary (Govt of) 5.00% 22/02/2027	190.574	0,32	USD	1.500.000	Qatar (Govt of) 3.25% 02/06/2026	1.465.470	2,45
USD	307.000	Hungary (Govt of) 6.13% 22/05/2028	315.671	0,53	Total de Catar		1.465.470	2,45	
Total de Hungría			506.245	0,85					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

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

Estado de la Cartera

(continuación)

				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*					Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	
Valor nominal	Inversión					Valor nominal	Inversión					
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						VENEZUELA						
USD	646.000	Romania (Govt of)	3.00%			USD	3.288.783	Petroleos de Venezuela SA				
		27/02/2027		589.829	0,98			6.00% 16/05/2024	153.619	0,26		
		Total de Rumanía		589.829	0,98	USD	491.751	Petroleos de Venezuela SA				
								6.00% 15/11/2026	24.489	0,04		
								Total de Venezuela	178.108	0,30		
								Total de bonos	178.108	0,30		
SUDÁFRICA						Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda						
USD	600.000	South Africa (Govt of)	4.30%			VENEZUELA						
		12/10/2028		540.765	0,90	USD	1.245.400	Venezuela (Govt of)	8.25%			
USD	350.000	South Africa (Govt of)	4.85%					13/10/2024	136.994	0,23		
		30/09/2029		315.428	0,53			Total de Venezuela	136.994	0,23		
		Total de Sudáfrica		856.193	1,43			Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda	136.994	0,23		
SRI LANKA								Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	315.102	0,53		
USD	860.000	Sri Lanka (Govt of)	5.75%			Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios						
		18/04/2023		311.807	0,52	Fondos						
		Total de Sri Lanka		311.807	0,52	IRLANDA						
TURQUÍA							2.809.014	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.809.014	4,69		
USD	1.200.000	Hazine Mustesarligi Varlik						Total de Irlanda	2.809.014	4,69		
		Kiralama AS 7.25% 24/02/2027		1.161.211	1,94			Total de fondos	2.809.014	4,69		
USD	1.100.000	Turkey (Govt of)	4.88%					Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	2.809.014	4,69		
		09/10/2026		996.776	1,66			Valor total de las inversiones	57.453.232	95,87		
USD	2.000.000	Turkey (Govt of)	6.00%					(Coste total: 67.085.417 USD)				
		25/03/2027		1.855.841	3,11			* Diferencias menores debido al redondeo.				
USD	935.000	Turkey (Govt of)	9.38%									
		14/03/2029		955.438	1,59							
		Total de Turquía		4.969.266	8,30							
UCRANIA												
USD	2.534.000	Ukraine (Govt of)	7.75%									
		01/09/2026		484.628	0,81							
		Total de Ucrania		484.628	0,81							
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda						23.094.140	38,54					
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa						54.329.116	90,65					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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	282.000	Nabors Industries Limited 7.25% 15/01/2026	269.310	0,23	USD	282.000	Transocean Titan Financing Limited 8.38% 01/02/2028	290.331	0,24
USD	55.000	Nabors Industries Limited 7.50% 15/01/2028	51.123	0,04	Total de Islas Caimán			860.654	0,72
USD	246.000	NCL Corp. Limited 5.88% 15/03/2026	209.241	0,17	FRANCIA				
Total de Bermudas			529.674	0,44	USD	411.000	Altice France SA 5.13% 15/07/2029	310.305	0,26
CANADÁ					USD	311.000	Altice France SA 5.50% 15/01/2028	255.393	0,21
USD	570.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc. 3.88% 15/01/2028	530.456	0,44	USD	304.000	Altice France SA 5.50% 15/10/2029	231.800	0,19
USD	164.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc. 4.38% 15/01/2028	151.368	0,13	USD	160.000	Altice France SA 8.13% 01/02/2027	147.600	0,12
USD	55.000	1375209 BC Limited 9.00% 30/01/2028	54.725	0,05	USD	617.000	Constellium SE 3.75% 15/04/2029	535.248	0,45
USD	276.000	Air Canada 3.88% 15/08/2026	250.942	0,21	USD	346.000	Constellium SE 5.63% 15/06/2028	330.444	0,28
USD	164.000	Bausch Health Companys Inc. 6.13% 01/02/2027	106.551	0,09	USD	325.000	Iliad Holding SASU 6.50% 15/10/2026	312.078	0,26
USD	161.000	Bausch Health Cos Inc. 4.88% 01/06/2028	96.040	0,08	USD	679.000	Iliad Holding SASU 7.00% 15/10/2028	646.111	0,55
USD	167.000	Bausch Health Cos Inc. 5.50% 01/11/2025	139.504	0,12	Total de Francia			2.768.979	2,32
USD	98.000	Bausch Health Cos Inc. 11.00% 30/09/2028	72.357	0,06	ALEMANIA				
USD	19.000	Bausch Health Cos Inc. 14.00% 15/10/2030	10.878	0,01	USD	261.000	IHO Verwaltungs GmbH 4.75% 15/09/2026	234.732	0,20
USD	349.000	Bombardier Inc. 7.88% 15/04/2027	353.714	0,30	USD	384.000	IHO Verwaltungs GmbH 6.38% 15/05/2029	341.596	0,29
USD	166.000	Clarios Global LP 6.75% 15/05/2025	168.079	0,14	USD	261.000	TK Elevator Holdco GmbH 7.63% 15/07/2028	229.632	0,19
USD	843.000	Hudbay Minerals Inc. 4.50% 01/04/2026	785.538	0,65	Total de Alemania			805.960	0,68
USD	178.000	Hudbay Minerals Inc. 6.13% 01/04/2029	168.433	0,14	AGENCIAS INTERNACIONALES				
USD	316.000	Nova Chemicals Corp. 4.25% 15/05/2029	259.910	0,22	USD	207.000	Clarios Global LP 6.25% 15/05/2026	207.277	0,17
USD	268.000	Nova Chemicals Corp. 5.25% 01/06/2027	244.681	0,20	Total de agencias internacionales			207.277	0,17
USD	63.000	Ritchie Bros Holdings Inc. 6.75% 15/03/2028	64.919	0,05	IRLANDA				
USD	142.000	Ritchie Bros Holdings Inc. 7.75% 15/03/2031	148.996	0,13	USD	313.000	James Hardie International Finance Dac 5.00% 15/01/2028	295.150	0,25
Total de Canadá			3.607.091	3,02	Total de Irlanda			295.150	0,25
ISLAS CAIMÁN					LIBERIA				
USD	601.627	Hawaiian Brand Intellectual Property Limited 5.75% 20/01/2026	570.323	0,48	USD	420.000	Royal Caribbean Cruises Limited 3.70% 15/03/2028	344.873	0,29

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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)				
LIBERIA (continuación)					PANAMÁ (continuación)				
USD	306.000	Royal Caribbean Cruises Limited 4.25% 01/07/2026	274.826	0,23	USD	660.000	Carnival Corp. 6.00% 01/05/2029	525.525	0,45
USD	179.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.38% 15/07/2027	159.869	0,13	Total de Panamá			1.183.706	1,00
USD	223.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.50% 31/08/2026	207.390	0,17	POLONIA				
USD	42.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.50% 01/04/2028	37.154	0,03	USD	350.000	Canpack SA 3.88% 15/11/2029	288.400	0,24
USD	345.000	Royal Caribbean Cruises Limited 7.25% 15/01/2030	347.372	0,29	Total de Polonia			288.400	0,24
Total de Liberia			1.371.484	1,14	ESPAÑA				
					USD	221.000	Grifols Escrow Issuer SA 4.75% 15/10/2028	181.773	0,15
					Total de España			181.773	0,15
LUXEMBURGO					SUPRANACIONAL				
USD	284.000	Altice France Holding SA 6.00% 15/02/2028	181.429	0,15	USD	319.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 6.00% 15/06/2027	315.682	0,26
USD	280.000	Axalta Coating Systems LLC 4.75% 15/06/2027	266.756	0,22	USD	350.000	Clarios Global LP 8.50% 15/05/2027	351.969	0,29
USD	319.000	Camelot Finance SA 4.50% 01/11/2026	301.854	0,25	Total de supranacional			667.651	0,55
USD	331.000	Fage International SA 5.63% 15/08/2026	310.844	0,26	REINO UNIDO				
USD	422.000	Herens Holdco Sarl 4.75% 15/05/2028	337.864	0,28	USD	308.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 3.38% 15/01/2026	283.125	0,24
USD	440.000	Ion Trading Technologies Sarl 5.75% 15/05/2028	353.100	0,30	USD	215.000	International Game Technology plc 4.13% 15/04/2026	207.948	0,17
Total de Luxemburgo			1.751.847	1,46	USD	140.000	International Game Technology plc P.P. 144A 6.50% 15/02/2025	141.575	0,12
PAÍSES BAJOS					USD	293.000	Virgin Media Finance plc 5.00% 15/07/2030	242.142	0,20
USD	187.000	Clear Channel International BV 6.63% 01/08/2025	183.026	0,15	USD	282.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.50% 15/08/2030	243.131	0,20
USD	193.000	Constellium SE 5.88% 15/02/2026	193.333	0,16	USD	237.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.50% 15/05/2029	220.825	0,18
USD	427.000	Trivium Packaging Finance BV 5.50% 15/08/2026	409.500	0,34	USD	631.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.25% 31/01/2031	535.062	0,45
USD	300.000	VZ Secured Financing BV 5.00% 15/01/2032	244.688	0,20	Total de Reino Unido			1.873.808	1,56
USD	178.000	Ziggo Bond Company BV 5.13% 28/02/2030	143.913	0,12	ESTADOS UNIDOS				
USD	171.000	Ziggo Bond Finance BV 6.00% 15/01/2027	158.068	0,13	USD	354.000	Acadia Healthcare Company Inc. 5.00% 15/04/2029	333.203	0,28
USD	738.000	Ziggo BV 4.88% 15/01/2030	634.434	0,53	USD	76.000	Acadia Healthcare Company Inc. 5.50% 01/07/2028	73.673	0,06
Total de Países Bajos			1.966.962	1,63	USD	534.000	AdaptHealth LLC 5.13% 01/03/2030	454.809	0,37
PANAMÁ									
USD	411.000	Carnival Corp. 4.00% 01/08/2028	354.488	0,30					
USD	367.000	Carnival Corp. 5.75% 01/03/2027	303.693	0,25					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado	% de valor			Valor de mercado	% de valor		
Valor nominal	Inversión	USD	liquidativo*	Valor nominal	Inversión	USD	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	390.000	AG TTMT Escrow Issuer LLC 8.63% 30/09/2027	393.811	0,33	USD	279.000	Avient Corp. 7.13% 01/08/2030	288.242	0,24
USD	353.000	Albertsons Companies Inc. 3.25% 15/03/2026	332.243	0,28	USD	180.000	Axalta Coating Systems LLC 3.38% 15/02/2029	156.600	0,13
USD	317.000	Albertsons Companies Inc. 5.88% 15/02/2028	315.371	0,26	USD	457.000	Bath & Body Works Inc. 6.63% 01/10/2030	446.091	0,37
USD	235.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 4.25% 15/10/2027	210.452	0,18	USD	67.000	Bath & Body Works Inc. 6.88% 01/11/2035	60.875	0,05
USD	268.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 5.88% 01/11/2029	227.381	0,19	USD	221.000	Bath & Body Works Inc. 7.50% 15/06/2029	226.025	0,19
USD	489.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 6.75% 15/10/2027	455.063	0,38	USD	210.000	Beacon Roofing Supply Inc. 4.13% 15/05/2029	185.543	0,16
USD	604.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 6.75% 15/04/2028	604.256	0,50	USD	196.000	Beacon Roofing Supply Inc. 4.50% 15/11/2026	185.955	0,16
USD	961.121	American Airlines Inc. 5.50% 20/04/2026	948.515	0,80	USD	334.000	Black Knight Infoserv LLC 3.63% 01/09/2028	303.312	0,25
USD	391.110	American Airlines Inc. 5.75% 20/04/2029	375.221	0,31	USD	346.000	Blackstone Mortgage Trust Inc. 3.75% 15/01/2027	274.922	0,23
USD	202.000	American Airlines Inc. 11.75% 15/07/2025	221.156	0,18	USD	275.000	Boyd Gaming Corp. 4.75% 15/06/2031	250.078	0,21
USD	316.000	American Builders & Contractors Supply Company Inc. 4.00% 15/01/2028	288.577	0,24	USD	350.000	BroadStreet Partners Inc. 5.88% 15/04/2029	299.548	0,25
USD	142.000	Apache Corp. 5.25% 01/02/2042	119.981	0,10	USD	291.000	BWX Technologies Inc. 4.13% 30/06/2028	264.901	0,22
USD	386.000	Arches Buyer Inc. 4.25% 01/06/2028	322.841	0,27	USD	663.000	Caesars Entertainment Inc. 4.63% 15/10/2029	582.263	0,49
USD	559.000	Arches Buyer Inc. 6.13% 01/12/2028	463.970	0,39	USD	529.000	Caesars Entertainment Inc. 6.25% 01/07/2025	529.529	0,45
USD	257.000	Archrock Partners LP Archrock Partners Finance Corp. 6.25% 01/04/2028	246.881	0,21	USD	531.000	Caesars Entertainment Inc. 7.00% 15/02/2030	541.288	0,45
USD	807.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 4.00% 01/09/2029	633.060	0,54	USD	453.000	Caesars Entertainment Inc. 8.13% 01/07/2027	462.626	0,39
USD	165.000	Asbury Automotive Group Inc. 4.63% 15/11/2029	147.778	0,12	USD	354.000	Caesars Resort Collection LLC 5.75% 01/07/2025	355.632	0,30
USD	262.000	Asbury Automotive Group Inc. 5.00% 15/02/2032	230.382	0,19	USD	280.000	Carnival Holdings Bermuda Limited 10.38% 01/05/2028	301.115	0,25
USD	405.000	Assuredpartners Inc. 5.63% 15/01/2029	349.414	0,29	USD	204.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 3.13% 15/02/2029	180.158	0,15
USD	200.000	AssuredPartners Inc. 7.00% 15/08/2025	195.780	0,16	USD	343.000	CCO Holdings LCC 5.13% 01/05/2027	324.349	0,27
USD	557.000	AthenaHealth Group Inc. 6.50% 15/02/2030	453.097	0,38	USD	438.000	CCO Holdings LLC 4.25% 01/02/2031	361.624	0,30
USD	122.000	ATI Inc. 4.88% 01/10/2029	112.016	0,09	USD	755.000	CCO Holdings LLC 4.75% 01/03/2030	657.321	0,55
USD	506.000	ATI Inc. 5.13% 01/10/2031	461.093	0,39	USD	428.000	CCO Holdings LLC 4.75% 01/02/2032	360.055	0,30
USD	539.000	Avantor Funding Inc. 3.88% 01/11/2029	483.753	0,40	USD	479.000	CCO Holdings LLC 5.00% 01/02/2028	444.512	0,37
USD	162.000	Avantor Funding Inc. 4.63% 15/07/2028	154.001	0,13	USD	678.000	CD&R Smokey Buyer Inc. 6.75% 15/07/2025	584.351	0,49

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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	244.000	Cedar Fair LP/ Canada's Wonderland Company 5.50% 01/05/2025	243.948	0,20	USD	763.000	CrownRock LP 5.63% 15/10/2025	752.115	0,63
					USD	304.000	CSC Holdings LLC 3.38% 15/02/2031	211.280	0,18
USD	313.000	Cengage Learning Inc. 9.50% 15/06/2024	302.734	0,25	USD	420.000	CSC Holdings LLC 4.13% 01/12/2030	304.500	0,25
USD	159.000	Charles River Laboratories International Inc. 3.75% 15/03/2029	142.705	0,12	USD	319.000	CSC Holdings LLC 4.63% 01/12/2030	157.108	0,13
USD	161.000	Charles River Laboratories International Inc. 4.25% 01/05/2028	150.650	0,13	USD	218.000	CSC Holdings LLC 5.00% 15/11/2031	109.436	0,09
USD	197.000	Chart Industries Inc. 7.50% 01/01/2030	203.425	0,17	USD	131.000	CSC Holdings LLC 5.38% 01/02/2028	108.299	0,09
USD	67.000	Chart Industries Inc. 9.50% 01/01/2031	70.834	0,06	USD	403.000	CSC Holdings LLC 6.50% 01/02/2029	334.490	0,28
USD	896.000	CHS/ Community Health Systems Inc. 5.25% 15/05/2030	687.679	0,57	USD	524.000	DISH DBS Corp. 5.75% 01/12/2028	391.577	0,33
USD	200.000	CHS/ Community Health Systems Inc. 6.88% 15/04/2029	123.730	0,10	USD	741.000	DISH Network Corp. 11.75% 15/11/2027	713.675	0,61
USD	101.000	Cinemark USA Inc. 5.25% 15/07/2028	87.643	0,07	USD	535.000	DT Midstream Inc. 4.13% 15/06/2029	473.141	0,40
USD	537.000	Cinemark USA Inc. 5.88% 15/03/2026	508.260	0,42	USD	207.000	DT Midstream Inc. 4.38% 15/06/2031	180.782	0,15
USD	314.000	Cinemark USA Inc. 8.75% 01/05/2025	322.243	0,27	USD	354.000	Element Solutions Inc. 3.88% 01/09/2028	310.414	0,26
USD	372.000	Clarivate Science Holdings Corp. 3.88% 01/07/2028	332.987	0,28	USD	142.000	Encompass Health Corp. 4.50% 01/02/2028	132.505	0,11
USD	528.000	Clarivate Science Holdings Corp. 4.88% 01/07/2029	477.837	0,40	USD	330.000	Endeavor Energy Resources LP 5.75% 30/01/2028	327.938	0,27
USD	561.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc. 5.13% 15/08/2027	504.198	0,42	USD	623.000	Entegris Escrow Corp. 5.95% 15/06/2030	603.485	0,50
USD	177.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc. 7.50% 01/06/2029	125.670	0,10	USD	227.000	EQM Midstream Partner LP 4.50% 15/01/2029	193.234	0,16
USD	521.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc. 7.75% 15/04/2028	391.076	0,33	USD	799.000	EQM Midstream Partner LP 4.75% 15/01/2031	668.204	0,56
USD	587.000	Clearway Energy Operating LLC 3.75% 15/02/2031	506.654	0,43	USD	275.000	EQM Midstream Partner LP 5.50% 15/07/2028	251.218	0,21
USD	173.000	Clearway Energy Operating LLC 3.75% 15/01/2032	145.184	0,12	USD	369.000	EQM Midstream Partner LP 6.00% 01/07/2025	364.487	0,30
USD	290.000	Clearway Energy Operating LLC 4.75% 15/03/2028	277.131	0,23	USD	118.000	EQM Midstream Partner LP 7.50% 01/06/2027	117.464	0,10
USD	677.000	Cloud Software Group Holdings Inc. 6.50% 31/03/2029	590.259	0,49	USD	281.000	Fertitta Entertainment LLC 6.75% 15/01/2030	231.363	0,19
USD	317.000	CNX Midstream Partners LP 4.75% 15/04/2030	271.926	0,23	USD	328.000	Ford Motor Company 3.25% 12/02/2032	259.074	0,22
USD	317.000	Cnx Resources Corp. 6.00% 15/01/2029	297.879	0,25	USD	385.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.70% 10/08/2026	343.252	0,29
USD	138.000	CommScope Technologies LLC P.P. 144A 6.00% 15/06/2025	131.470	0,11	USD	257.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.90% 16/02/2028	221.097	0,18
USD	274.000	CrownRock LP 5.00% 01/05/2029	254.902	0,21	USD	402.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.38% 13/11/2025	377.353	0,32

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	414.000 Ford Motor Credit Company LLC 3.66% 08/09/2024	400.382	0,33	USD	188.000 Holly Energy Partners Corp. 6.38% 15/04/2027	187.754	0,16
USD	378.000 Ford Motor Credit Company LLC 4.00% 13/11/2030	322.036	0,27	USD	343.000 HUB International Limited 5.63% 01/12/2029	299.268	0,25
USD	299.000 Ford Motor Credit Company LLC 4.39% 08/01/2026	284.050	0,24	USD	494.000 HUB International Limited 7.00% 01/05/2026	488.896	0,41
USD	244.000 Ford Motor Credit Company LLC 4.95% 28/05/2027	231.119	0,19	USD	391.000 iHeartCommunications Inc. 4.75% 15/01/2028	312.800	0,26
USD	486.000 Ford Motor Credit Company LLC 5.13% 16/06/2025	477.238	0,39	USD	282.000 iHeartCommunications Inc. 5.25% 15/08/2027	232.074	0,19
USD	279.000 Ford Motor Credit Company LLC 7.35% 04/11/2027	288.681	0,24	USD	249.000 Ingevity Corp. 3.88% 01/11/2028	215.976	0,18
USD	270.000 Frontier Communications Holdings LLC 8.63% 15/03/2031	265.059	0,22	USD	171.000 Interface Inc. 5.50% 01/12/2028	140.889	0,12
USD	214.000 Frontier Communications Holdings LLC 8.75% 15/05/2030	213.547	0,18	USD	344.000 IRB Holding Corp. 7.00% 15/06/2025	346.173	0,29
USD	735.000 Gates Global LLC 6.25% 15/01/2026	729.399	0,61	USD	237.000 Iron Mountain Inc. 5.00% 15/07/2028	220.677	0,18
USD	160.000 Goodyear Tire & Rubber Company 5.00% 15/07/2029	142.844	0,12	USD	299.000 Iron Mountain Inc. 5.25% 15/03/2028	284.137	0,24
USD	628.000 GoTo Group Inc 5.50% 01/09/2027	324.205	0,27	USD	145.000 ITT Holdings LLC 6.50% 01/08/2029	122.426	0,10
USD	275.000 Group 1 Automotive Inc. 4.00% 15/08/2028	242.254	0,20	USD	184.000 Kaiser Aluminum Corp. 4.50% 01/06/2031	151.631	0,13
USD	82.000 GTCR AP Finance Inc. 8.00% 15/05/2027	78.720	0,07	USD	161.000 Kaiser Aluminum Corp. 4.63% 01/03/2028	145.316	0,12
USD	466.000 H&E Equipment Services Inc. 3.88% 15/12/2028	410.318	0,34	USD	915.000 KAR Auction Services Inc. 5.13% 01/06/2025	904.135	0,76
USD	289.000 Hanesbrands Inc. 9.00% 15/02/2031	296.141	0,25	USD	200.000 Ladder Capital Finance Holdings LLLP 4.25% 01/02/2027	158.125	0,13
USD	329.000 HB Fuller Company 4.25% 15/10/2028	294.077	0,25	USD	772.000 Ladder Capital Finance Holdings LLLP 4.75% 15/06/2029	559.217	0,48
USD	135.000 HealthEquity Inc. 4.50% 01/10/2029	121.872	0,10	USD	371.000 Ladder Capital Finance Holdings LLLP 5.25% 01/10/2025	328.457	0,27
USD	486.000 Helios Software Holdings Inc. 4.63% 01/05/2028	397.305	0,33	USD	180.000 Lithia Motors Inc. 4.38% 15/01/2031	155.138	0,13
USD	307.000 Herc Holdings Inc. 5.50% 15/07/2027	296.831	0,25	USD	157.000 Live Nation Entertainment Inc. 4.75% 15/10/2027	145.870	0,12
USD	377.000 Hightower Holding LLC 6.75% 15/04/2029	321.106	0,27	USD	229.000 Live Nation Entertainment Inc. 4.88% 01/11/2024	224.563	0,19
USD	283.000 Hilcorp Energy I LP 5.75% 01/02/2029	263.190	0,22	USD	254.000 Live Nation Entertainment Inc. 6.50% 15/05/2027	257.016	0,21
USD	152.000 Hilcorp Energy I LP 6.00% 15/04/2030	141.514	0,12	USD	147.000 Madison IAQ LLC 4.13% 30/06/2028	128.032	0,11
USD	197.000 Hilcorp Energy I LP 6.25% 01/11/2028	189.136	0,16	USD	372.000 Madison IAQ LLC 5.88% 30/06/2029	287.919	0,24
USD	237.000 Hilcorp Energy I LP 6.25% 15/04/2032	220.366	0,18	USD	115.000 Match Group Holdings II LLC 3.63% 01/10/2031	93.498	0,08
USD	372.000 Holly Energy Partners Corp. 5.00% 01/02/2028	349.689	0,29	USD	463.000 Match Group Holdings II LLC 4.63% 01/06/2028	430.011	0,36
				USD	753.000 McAfee Corp. 7.38% 15/02/2030	630.167	0,53

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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	67.000	Medline Borrower LP 3.88% 01/04/2029	58.164	0,05	USD	260.000	Olympus Water USA Holding Corp. 7.13% 01/10/2027	244.698	0,20
USD	800.000	Medline Borrower LP 5.25% 01/10/2029	695.165	0,58	USD	126.000	OneMain Finance Corp. 4.00% 15/09/2030	95.722	0,08
USD	416.000	Meritage Homes Corp. 3.88% 15/04/2029	369.460	0,31	USD	216.000	OneMain Finance Corp. 6.13% 15/03/2024	210.821	0,18
USD	214.000	Midwest Gaming Borrower LLC 4.88% 01/05/2029	186.407	0,16	USD	189.000	OneMain Finance Corp. 6.88% 15/03/2025	183.683	0,15
USD	403.299	Mileage Plus Holdings LLC 6.50% 20/06/2027	402.038	0,34	USD	375.000	Organon & Company 4.13% 30/04/2028	342.656	0,29
USD	170.000	Nabors Industries Inc. 7.38% 15/05/2027	166.439	0,14	USD	196.000	Outfront Media Capital LLC 4.25% 15/01/2029	166.257	0,14
USD	391.000	Navient Corp. 6.75% 25/06/2025	385.311	0,32	USD	229.000	Outfront Media Capital LLC 4.63% 15/03/2030	193.219	0,17
USD	175.000	NCR Corp 5.75% 01/09/2027	171.978	0,14	USD	273.000	Park Intermediate Holdings LLC 4.88% 15/05/2029	235.033	0,20
USD	120.000	NCR Corp 6.13% 01/09/2029	118.501	0,10	USD	395.000	Park Intermediate Holdings LLC 5.88% 01/10/2028	363.943	0,30
USD	759.000	NCR Corp. 5.00% 01/10/2028	671.525	0,56	USD	77.000	Park Intermediate Holdings LLC 7.50% 01/06/2025	77.529	0,06
USD	729.000	Neptune Bidco USA Inc. 9.29% 15/04/2029	678.134	0,57	USD	744.000	Permian Resources Operating LLC 5.88% 01/07/2029	703.544	0,59
USD	343.000	NextEra Energy Operating Partners 4.50% 15/09/2027	327.511	0,27	USD	73.000	Permian Resources Operating LLC 6.88% 01/04/2027	71.947	0,06
USD	337.000	NFP Corp. 4.88% 15/08/2028	307.170	0,26	USD	348.000	PetSmart Inc. 4.75% 15/02/2028	328.738	0,27
USD	878.000	NFP Corp. 6.88% 15/08/2028	762.764	0,63	USD	408.000	PetSmart Inc. 7.75% 15/02/2029	401.491	0,34
USD	402.000	NFP Corp. 7.50% 01/10/2030	393.625	0,33	USD	640.000	Post Holdings Inc. 4.63% 15/04/2030	574.000	0,48
USD	287.000	Novelis Corp. 3.25% 15/11/2026	263.155	0,22	USD	340.000	Post Holdings Inc. 5.75% 01/03/2027	334.875	0,28
USD	758.000	Novelis Corp. 4.75% 30/01/2030	696.886	0,58	USD	475.000	Primo Water Holdings Inc. 4.38% 30/04/2029	418.891	0,35
USD	147.000	NRG Energy Inc. 3.38% 15/02/2029	122.656	0,10	USD	628.000	Provident Funding Associates LP 6.38% 15/06/2025	557.727	0,47
USD	460.000	NRG Energy Inc. 3.63% 15/02/2031	373.951	0,32	USD	183.000	Radian Group Inc. 4.88% 15/03/2027	173.885	0,15
USD	247.000	NRG Energy Inc. 5.25% 15/06/2029	229.499	0,19	USD	291.000	Radian Group Inc. 6.63% 15/03/2025	289.810	0,24
USD	156.000	NRG Energy Inc. 5.75% 15/01/2028	152.983	0,13	USD	407.000	Radiate Holco LLC 4.50% 15/09/2026	318.986	0,27
USD	222.000	Nustar Logistics LP 5.75% 01/10/2025	217.331	0,18	USD	463.000	Radiate Holco LLC 6.50% 15/09/2028	191.566	0,16
USD	266.000	NuStar Logistics LP 5.63% 28/04/2027	253.840	0,21	USD	358.000	Resideo Funding Inc. 4.00% 01/09/2029	299.496	0,25
USD	578.000	NuStar Logistics LP 6.00% 01/06/2026	567.662	0,47	USD	129.000	RLJ Lodging Trust LP 3.75% 01/07/2026	119.229	0,10
USD	451.000	Occidental Petroleum Corp. 6.13% 01/01/2031	467.983	0,39	USD	569.000	Roblox Corp. 3.88% 01/05/2030	488.629	0,41
USD	435.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	459.728	0,38	USD	330.000	Rocket Mortgage LLC 3.63% 01/03/2029	282.975	0,24
USD	62.000	Occidental Petroleum Corp. 7.50% 01/05/2031	68.930	0,06					
USD	513.000	Olympus Water USA Holding Corp. 4.25% 01/10/2028	421.301	0,35					
USD	272.000	Olympus Water USA Holding Corp. 6.25% 01/10/2029	204.387	0,17					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario 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	247.000 Rocket Mortgage LLC 3.88% 01/03/2031	204.952	0,17	USD	168.000 Taylor Morrison Communities Inc. 5.88% 15/06/2027	166.442	0,14
USD	906.000 Rocket Mortgage LLC 4.00% 15/10/2033	721.493	0,59	USD	215.000 Tempo Acquisition LLC 5.75% 01/06/2025	215.525	0,18
USD	180.000 Sabre GBLB Inc. 7.38% 01/09/2025	160.898	0,13	USD	107.000 Tempur Sealy International 3.88% 15/10/2031	89.675	0,07
USD	137.000 Sabre GBLB Inc. 9.25% 15/04/2025	128.667	0,11	USD	233.000 Tenet Healthcare Corp. 6.13% 15/06/2030	230.117	0,19
USD	582.000 Scientific Games Holdings LP 6.63% 01/03/2030	515.070	0,43	USD	192.000 Terraform Power Operating LLC 5.00% 31/01/2028	185.312	0,15
USD	164.000 Scientific Games International Inc. 7.00% 15/05/2028	162.868	0,14	USD	529.000 TK Elevator US Newco Inc. 5.25% 15/07/2027	498.107	0,42
USD	622.000 Select Medical Corp. 6.25% 15/08/2026	604.117	0,50	USD	333.000 TransDigm Inc. 5.50% 15/11/2027	314.269	0,26
USD	362.000 Shift4 Payments LLC 4.63% 01/11/2026	341.786	0,29	USD	981.000 TransDigm Inc. 6.25% 15/03/2026	984.065	0,82
USD	290.000 Simmons Food Inc. 4.63% 01/03/2029	235.844	0,20	USD	217.000 TransDigm Inc. 6.38% 15/06/2026	214.020	0,18
USD	259.000 Sirius XM Radio Inc. 4.00% 15/07/2028	222.578	0,19	USD	296.000 TransDigm Inc. 6.75% 15/08/2028	299.145	0,25
USD	174.000 Sirius XM Radio Inc. 5.50% 01/07/2029	158.449	0,13	USD	1.024.000 Uber Technologies Inc. 4.50% 15/08/2029	936.916	0,78
USD	755.000 Southwestern Energy Company 4.75% 01/02/2032	666.470	0,56	USD	145.000 Uber Technologies Inc. 7.50% 15/05/2025	146.722	0,12
USD	206.000 Southwestern Energy Company 5.38% 01/02/2029	194.541	0,16	USD	201.000 United Airlines Inc. 4.38% 15/04/2026	192.834	0,16
USD	68.000 Southwestern Energy Company 5.70% 23/01/2025	68.000	0,06	USD	555.000 United Airlines Inc. 4.63% 15/04/2029	504.703	0,42
USD	199.000 Spectrum Brands Inc. 5.00% 01/10/2029	175.618	0,14	USD	279.000 Univision Communications Inc. 4.50% 01/05/2029	236.212	0,20
USD	64.000 Spectrum Brands Inc. 5.50% 15/07/2030	57.320	0,05	USD	235.000 Univision Communications Inc. 7.38% 30/06/2030	222.007	0,19
USD	230.000 Spectrum Brands Inc. 5.75% 15/07/2025	228.611	0,19	USD	162.000 US Foods Inc. 4.63% 01/06/2030	147.109	0,12
USD	177.000 Spirit AeroSystems Inc. 9.38% 30/11/2029	193.373	0,16	USD	399.000 US Foods Inc. 4.75% 15/02/2029	368.826	0,30
USD	133.000 SRS Distribution Inc. 4.63% 01/07/2028	117.967	0,10	USD	150.000 US Foods Inc. 6.25% 15/04/2025	151.412	0,13
USD	340.000 SRS Distribution Inc. 6.00% 01/12/2029	283.305	0,24	USD	335.000 USI Inc. 6.88% 01/05/2025	331.409	0,28
USD	519.000 SRS Distribution Inc. 6.13% 01/07/2029	438.231	0,37	USD	376.000 Venture Global Calcasieu Pass LLC 3.88% 15/08/2029	338.849	0,28
USD	202.000 Standard Industries Inc. 5.00% 15/02/2027	192.784	0,16	USD	612.000 Venture Global Calcasieu Pass LLC 3.88% 01/11/2033	516.213	0,43
USD	151.000 Staples Inc. 7.50% 15/04/2026	132.347	0,11	USD	363.000 Venture Global Calcasieu Pass LLC 4.13% 15/08/2031	319.378	0,27
USD	210.000 Surgery Center Holdings Inc. 6.75% 01/07/2025	208.967	0,17	USD	436.000 Verscend Escrow Corp. 9.75% 15/08/2026	438.945	0,37
USD	200.000 Taylor Morrison Communities Inc. 5.75% 15/01/2028	197.484	0,16	USD	82.000 Vistra Operations Company LLC 4.38% 01/05/2029	73.050	0,06
				USD	222.000 Vistra Operations Company LLC 5.50% 01/09/2026	215.340	0,18
				USD	353.000 Vistra Operations Company LLC 5.63% 15/02/2027	343.443	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*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)			
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)			
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
USD	612.000 Waste Pro USA Inc. 5.50% 15/02/2026	563.078	0,47	USD	637.000 DISH DBS Corp. 5.13% 01/06/2029	337.610	0,28
USD	233.000 Wesco Distribution Inc. 7.13% 15/06/2025	237.112	0,20	USD	243.000 DISH DBS Corp. 7.75% 01/07/2026	160.836	0,13
USD	635.000 Wesco Distribution Inc. 7.25% 15/06/2028	651.669	0,54	USD	608.757 iHeartCommunications Inc. 8.38% 01/05/2027	445.063	0,37
USD	171.000 Western Midstream Operating LP 4.30% 01/02/2030	156.359	0,13	USD	418.000 Matador Resources Company 5.88% 15/09/2026	412.930	0,35
USD	331.000 Western Midstream Operating LP 4.65% 01/07/2026	321.009	0,27	USD	119.000 Newell Brands Inc. 6.38% 15/09/2027	120.226	0,10
USD	619.000 White Cap Buyer LLC 6.88% 15/10/2028	540.210	0,45	USD	167.000 Newell Brands Inc. 6.63% 15/09/2029	168.955	0,14
USD	206.000 Wolverine World Wide Inc. 4.00% 15/08/2029	167.612	0,14	USD	428.000 Occidental Petroleum Corp. 6.45% 15/09/2036	448.598	0,37
USD	489.000 WR Grace Holdings LLC 4.88% 15/06/2027	472.574	0,39	USD	137.000 Occidental Petroleum Corp. 6.60% 15/03/2046	144.364	0,12
USD	852.000 WR Grace Holdings LLC 5.63% 15/08/2029	722.851	0,61	USD	447.000 Pilgrim's Pride Corp. 3.50% 01/03/2032	364.607	0,30
USD	166.000 WR Grace Holdings LLC 7.38% 01/03/2031	166.841	0,14	USD	265.000 Pilgrim's Pride Corp. 4.25% 15/04/2031	233.908	0,20
USD	373.000 Yum! Brands Inc. 5.38% 01/04/2032	360.842	0,30	USD	200.000 Scotts Miracle-Gro Company 4.00% 01/04/2031	160.779	0,14
USD	99.000 Zayo Group Holdings Inc. 4.00% 01/03/2027	75.549	0,06	USD	185.000 Scotts Miracle-Gro CoThe 4.38% 01/02/2032	149.532	0,12
USD	690.000 ZoomInfo Technologies LLC 3.88% 01/02/2029	599.438	0,51	USD	244.000 Sunoco LP Sunoco Finance Corp. 5.88% 15/03/2028	238.998	0,20
Total de Estados Unidos		86.465.215	72,24	USD	415.000 Tenet Healthcare Corp. 4.88% 01/01/2026	407.628	0,34
Total de bonos		104.825.631	87,57	USD	275.000 Tenet Healthcare Corp. 5.13% 01/11/2027	265.729	0,22
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		104.825.631	87,57	USD	399.000 Tenet Healthcare Corp. 6.13% 01/10/2028	381.793	0,32
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				USD	736.000 Tenet Healthcare Corp. 6.25% 01/02/2027	727.121	0,62
Bonos				USD	619.000 TransMontaigne Partners LP 6.13% 15/02/2026	535.951	0,45
ESTADOS UNIDOS				USD	317.000 USA Compression Partners LP 6.88% 01/04/2026	312.994	0,26
USD	622.000 Callon Petroleum Company 6.38% 01/07/2026	595.732	0,50	Total de Estados Unidos		7.219.137	6,04
USD	188.000 CCO Holdings LLC 4.50% 01/05/2032	153.690	0,13	Total de bonos		7.219.137	6,04
USD	272.000 Cedar Fair LP/ Canada's Wonderland Company 6.50% 01/10/2028	265.200	0,22	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		7.219.137	6,04
USD	189.000 Delek Logistics Partners LP 6.75% 15/05/2025	186.893	0,16				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
Bonos			
LUXEMBURGO			
USD	142.000 Altice France Holding SA 10.50% 15/05/2027	108.808	0,09
	Total de Luxemburgo	108.808	0,09
ESTADOS UNIDOS			
USD	196.000 Illuminate Buyer LLC 9.00% 01/07/2028	177.380	0,15
USD	357.000 Innophos Holdings Inc. 9.38% 15/02/2028	365.416	0,31
USD	219.000 Iris Holdings Inc. 8.75% 15/02/2026	204.628	0,17
	Total de Estados Unidos	747.424	0,63
	Total de bonos	856.232	0,72
	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	856.232	0,72
	Valor total de las inversiones	112.901.000	94,33
(Coste total: 124.022.245 USD)			

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos					Bonos (continuación)				
BAHAMAS					ISLAS CAIMÁN (continuación)				
USD	200.000	Competition Team Technologies Limited 3.75% 12/03/2024	197.311	0,46	USD	400.000	Tencent Holdings Limited 2.88% 22/04/2031	344.947	0,80
		Total de Bahamas	197.311	0,46	USD	600.000	Times China Holdings Limited 0.00% 16/07/2023	92.750	0,22
ISLAS CAIMÁN					USD	467.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp. 1.63% 24/09/2025	428.559	1,00
USD	250.000	AAC Technologies Holdings Inc. 3.00% 27/11/2024	232.975	0,54			Total de Islas Caimán	6.871.467	15,97
USD	250.000	Alibaba Group Holding Limited 4.50% 28/11/2034	235.151	0,55	HONG KONG				
USD	500.000	China Mengniu Dairy Company Limited 1.88% 17/06/2025	466.169	1,08	USD	400.000	Bank of East Asia Limited FRN 29/05/2030	366.277	0,85
USD	600.000	CIFI Holdings Group Company Limited 0.00% 16/07/2025	128.306	0,30	USD	260.000	Lenovo Group Limited 3.42% 02/11/2030	218.010	0,51
USD	600.000	CK Hutchison International 17 II Limited 3.25% 29/09/2027	567.434	1,32	USD	485.000	Lenovo Group Limited 6.54% 27/07/2032	491.489	1,14
USD	200.000	Country Garden Holdings Company Limited 2.70% 12/07/2026	110.222	0,26	USD	500.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	379.944	0,88
USD	460.000	Country Garden Holdings Company Limited 3.13% 22/10/2025	270.040	0,63			Total de Hong Kong	1.455.720	3,38
USD	200.000	Country Garden Holdings Company Limited 5.40% 27/05/2025	132.289	0,31	INDIA				
USD	500.000	ENN Energy Holdings Limited 2.63% 17/09/2030	419.158	0,97	USD	400.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	287.500	0,67
USD	400.000	Goodman HK Finance 3.00% 22/07/2030	342.638	0,80	USD	280.000	Adani Green Energy Limited 4.38% 08/09/2024	242.550	0,56
USD	500.000	HPHT Finance 19 Limited 2.88% 05/11/2024	483.107	1,12	USD	300.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 3.10% 02/02/2031	195.961	0,46
USD	1.000.000	Logan Group Company Limited 0.00% 06/07/2026	232.745	0,54	USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	158.675	0,37
USD	200.000	Longfor Group Holdings Limited 3.95% 16/09/2029	150.533	0,35	USD	400.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	306.024	0,71
USD	400.000	Longfor Group Holdings Limited 4.50% 16/01/2028	332.116	0,77	USD	400.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	351.304	0,82
USD	800.000	Meituan 3.05% 28/10/2030	640.809	1,49	USD	226.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.75% 02/02/2026	211.796	0,49
USD	500.000	Melco Resorts Finance Limited 4.88% 06/06/2025	469.846	1,09	USD	500.000	Ongc Videsh Limited 4.63% 15/07/2024	495.399	1,15
USD	300.000	MGM China Holdings Limited 4.75% 01/02/2027	267.280	0,62	USD	500.000	Reliance Industries Limited 3.67% 30/11/2027	470.537	1,09
USD	250.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Limited 2.75% 13/05/2030	220.569	0,51	USD	490.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	410.133	0,95
USD	270.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Limited 3.75% 25/02/2029	255.463	0,59			Total de India	3.129.879	7,27
USD	200.000	Sunac China Holdings Limited 6.50% 09/07/2023	48.361	0,11					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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					FILIPINAS				
USD	400.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.80% 15/05/2050	359.265	0,84	USD	400.000	Globe Telecom Inc. 2.50% 23/07/2030	321.152	0,75
USD	400.000	Pertamina Persero PT 5.63% 20/05/2043	380.873	0,89	USD	520.000	Globe Telecom Inc. - Perp FRN	477.805	1,11
USD	200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT 5.25% 24/10/2042	176.125	0,41	USD	200.000	International Container Terminal Services Inc. 4.75% 17/06/2030	188.513	0,44
USD	200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT 6.25% 25/01/2049	194.963	0,45	USD	714.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	651.074	1,51
USD	400.000	Sri Rejeki Isman TBK PT 7.25% 16/01/2025	15.000	0,03	USD	470.000	SMC Global Power Holdings Corp. Perp FRN	385.769	0,90
Total de Indonesia			1.126.226	2,62	Total de Filipinas			2.024.313	4,71
ISLA DE MAN					REPÚBLICA DE COREA (SUR)				
USD	400.000	Gohl Capital Limited 4.25% 24/01/2027	368.502	0,86	USD	500.000	Shinhan Financial Group Company Limited Perp FRN	497.153	1,15
Total de Isla de Man			368.502	0,86	USD	400.000	SK Hynix Inc. 6.50% 17/01/2033	392.572	0,91
					Total de República de Corea (Sur)			889.725	2,06
MALASIA					SINGAPUR				
USD	200.000	Axiata SPV2 Bhd 4.36% 24/03/2026	197.267	0,46	USD	300.000	ABJA Investment Company 5.45% 24/01/2028	291.496	0,68
USD	500.000	Petronas Capital Limited 3.50% 21/04/2030	467.832	1,09	USD	400.000	BOC Aviation Limited 2.63% 17/09/2030	342.313	0,80
USD	720.000	Petronas Capital Limited 4.55% 21/04/2050	673.241	1,56	USD	550.000	DBS Group Holdings Limited FRN 11/12/2028	547.122	1,27
USD	400.000	TNB Global Ventures Capital Bhd 4.85% 01/11/2028	399.092	0,93	USD	700.000	SingTel Group Treasury Pte Limited 1.88% 10/06/2030	588.780	1,37
Total de Malasia			1.737.432	4,04	USD	550.000	United Overseas Bank Limited FRN 16/03/2031	492.780	1,15
					Total de Singapur			2.262.491	5,27
MAURICIO					TAILANDIA				
USD	400.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	385.588	0,90	USD	800.000	Bangkok Bank plc FRN 25/09/2034	681.857	1,58
USD	469.000	Network I2i Limited Perp FRN	443.965	1,03	USD	270.000	GC Treasury Center Company Limited 4.30% 18/03/2051	196.003	0,46
Total de Mauricio			829.553	1,93	USD	200.000	GCTreasury Centre Company 2.98% 18/03/2031	164.568	0,38
					USD	400.000	Kasikornbank plc FRN 02/10/2031	352.755	0,82
Total de Tailandia			1.395.183	3,24					
PAÍSES BAJOS					REINO UNIDO				
USD	526.400	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	473.760	1,10	USD	600.000	Standard Chartered plc FRN 26/01/2169	557.499	1,30
USD	250.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	214.250	0,50					
USD	500.000	Royal Capital BV FRN 05/05/2169	484.346	1,13					
Total de Países Bajos			1.172.356	2,73					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				
REINO UNIDO (continuación)					INDONESIA				
USD	400.000	Vedanta Resources plc 6.13% 09/08/2024	237.550	0,55	USD	500.000	Indonesia (Govt of) 3.05% 12/03/2051	370.472	0,86
		Total de Reino Unido	795.049	1,85	USD	500.000	Indonesia (Govt of) 3.20% 23/09/2061	349.110	0,81
ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)					USD	800.000	Indonesia (Govt of) 3.40% 18/09/2029	749.198	1,74
USD	500.000	CMHI Finance [BVI] Company - Perp FRN	495.105	1,14	USD	1.000.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 11/02/2029	1.011.528	2,36
USD	500.000	CNPC Global Capital Limited 1.35% 23/06/2025	462.733	1,08	USD	200.000	Indonesia (Govt of) 6.63% 17/02/2037	230.533	0,54
USD	450.000	Contemporary Ruiding Development Limited 2.63% 17/09/2030	382.475	0,89	USD	200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 2.30% 23/06/2025	190.963	0,44
USD	600.000	Elect Global Investments Limited Perp FRN	539.278	1,25			Total de Indonesia	2.901.804	6,75
USD	750.000	FPC Resources Limited 4.38% 11/09/2027	699.342	1,62	MONGOLIA				
USD	511.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	456.896	1,06	USD	200.000	Mongolia (Govt of) 8.65% 19/01/2028	197.219	0,46
USD	500.000	Hongkong Electric Finance Limited 1.88% 27/08/2030	411.321	0,96			Total de Mongolia	197.219	0,46
USD	1.000.000	JGSH Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	900.477	2,09	PAKISTÁN				
USD	300.000	Nan Fung Treasury Limited 5.00% 05/09/2028	289.045	0,67	USD	350.000	Pakistan (Govt of) 6.00% 08/04/2026	130.377	0,30
USD	340.000	State Grid Overseas Investment BVI Limited 1.63% 05/08/2030	280.767	0,65	USD	200.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 30/09/2025	78.750	0,18
USD	500.000	Studio City Finance Limited 5.00% 15/01/2029	385.000	0,89			Total de Pakistán	209.127	0,48
USD	400.000	Studio City Finance Limited 6.00% 15/07/2025	372.265	0,87	FILIPINAS				
USD	850.000	Tsmc Global Limited 0.75% 28/09/2025	770.224	1,79	USD	1.000.000	Philippine (Govt of) 3.00% 01/02/2028	942.746	2,19
USD	400.000	Yongda Investment Limited 2.25% 16/06/2025	374.209	0,87	USD	400.000	Philippine (Govt of) 3.75% 14/01/2029	385.203	0,90
		Total de Islas Vírgenes (Británicas)	6.819.137	15,83			Total de Filipinas	1.327.949	3,09
Total de bonos			31.074.344	72,22	SRI LANKA				
					USD	420.000	Sri Lanka (Govt of) 5.75% 18/04/2023	152.278	0,35
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda							Total de Sri Lanka	152.278	0,35
INDIA									
USD	400.000	Export-Import Bank of India 3.25% 15/01/2030	353.054	0,82					
		Total de India	353.054	0,82					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)			
ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)			
USD	500.000 Talent Yield International Limited 3.13% 06/05/2031	439.135	1,02
	Total de Islas Virgenes (Británicas)	439.135	1,02
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda		5.580.566	12,97
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		36.654.910	85,19

Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario

Bonos

ISLAS CAIMÁN

USD	450.000 Sunac China Holdings Limited 8.35% 19/04/2023	108.995	0,25
	Total de Islas Caimán	108.995	0,25
Total de bonos		108.995	0,25
Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario		108.995	0,25
Valor total de las inversiones		36.763.905	85,44
(Coste total: 43.946.784 USD)			

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

			Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*				Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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	60.000	Germany (Govt of) 0.00% 17/05/2023	59.808	14,66	36	iShares Core EURO STOXX 50 UCITS ETF		5.448	1,34
					82	iShares Core S&P 500 UCITS ETF		31.972	7,84
		Total de Alemania	59.808	14,66	671	iShares MSCI EM UCITS ETF USD Acc		21.324	5,23
					3.005	iShares plc - iShares Core FTSE 100 UCITS ETF		25.618	6,28
EUR	24.000	Italy (Govt of) 2.50% 01/12/2032	21.155	5,19	807	Vanguard FTSE Japan UCITS ETF		23.032	5,65
		Total de Italia	21.155	5,19		Total de Irlanda		107.394	26,34
REINO UNIDO					LUXEMBURGO				
GBP	18.000	United Kingdom Gilt 4.25% 07/06/2032	21.864	5,36	1.340	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities XU**		25.696	6,30
GBP	10.000	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.15% 22/03/2051	12.923	3,17	3.367	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond 4E**		32.524	7,97
		Total de Reino Unido	34.787	8,53	226	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond 4E**		2.395	0,59
ESTADOS UNIDOS					371	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond XE**		38.923	9,54
USD	14.000	United States Treasury N/B 3.00% 15/08/2052	11.319	2,77	490	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds XU**		4.730	1,16
USD	5.000	United States Treasury N/B 3.38% 15/08/2042	4.326	1,06	2.612	Threadneedle (Lux) - Global Focus XU**		55.027	13,48
		Total de Estados Unidos	15.645	3,83	3.219	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities XE**		32.503	7,97
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			131.395	32,21	790	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies 4E**		8.712	2,14
Instrumentos estructurados - Materias primas					Total de Luxemburgo				
IRLANDA					Total de fondos				
	11	Invesco Physical Gold ETC 0.00%	1.935	0,47	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				
		Total de Irlanda	1.935	0,47	307.90475,49				
Total de instrumentos estructurados - Materias primas			1.935	0,47					
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			133.330	32,68					

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			
Fondos			
REINO UNIDO			
	– CT European Fund***	0	0,00
	– CT European Select Fund***	0	0,00
	– CT Japan Fund***	0	0,00
	Total de Reino Unido	0	0,00
Total de fondos		0	0,00
Total de otros organismos de inversión colectiva		0	0,00
Valor total de las inversiones		441.234	108,17
(Coste total: 421.736 EUR)			

* Diferencias menores debido al redondeo.

** Consulte la Nota 18.

*** Fondo de parte vinculada, cantidad fraccionada redondeada a 0.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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)				
MÉXICO					FRANCIA				
USD	660.000	Mexico (Govt of) 5.75% 12/10/2110	593.802	1,66	5.662	AXA SA	173.256	0,48	
					907	EssilorLuxottica SA	163.578	0,46	
					516	L'Oreal SA	230.550	0,64	
					235	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	215.589	0,61	
					1.533	Schneider Electric SE	255.958	0,72	
					8.663	TotalEnergies SE	511.632	1,43	
		Total de México	593.802	1,66		Total de Francia	1.550.563	4,34	
REINO UNIDO					ALEMANIA				
GBP	87.000	United Kingdom Gilt 1.25% 31/07/2051	60.270	0,17	738	Adidas AG	130.517	0,36	
GBP	600.000	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.15% 22/03/2051	842.399	2,36		Total de Alemania	130.517	0,36	
		Total de Reino Unido	902.669	2,53					
ESTADOS UNIDOS					HONG KONG				
USD	2.350.000	United States Treasury Bill 0.00% 16/05/2023	2.337.179	6,53	23.200	AIA Group Limited	244.266	0,69	
USD	1.200.000	United States Treasury N/B 1.88% 15/02/2032	1.053.562	2,95		Total de Hong Kong	244.266	0,69	
USD	2.618.000	United States Treasury N/B 2.88% 15/05/2032	2.492.009	6,96					
USD	1.505.000	United States Treasury N/B 3.00% 15/08/2052	1.321.931	3,70		INDIA			
USD	1.775.200	United States Treasury N/B 3.38% 15/08/2042	1.668.827	4,67	5.500	HDFC Bank Limited - ADR	366.685	1,03	
USD	1.850.000	United States Treasury N/B 3.88% 30/11/2027	1.869.512	5,23	6.929	Kotak Mahindra Bank Limited	146.100	0,41	
		Total de Estados Unidos	10.743.020	30,04		Total de India	512.785	1,44	
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda						INDONESIA			
			12.239.491	34,23	829.150	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	261.550	0,73	
						Total de Indonesia	261.550	0,73	
Renta variable					IRLANDA				
					2.813	CRH plc	142.036	0,40	
					840	Linde plc	298.569	0,84	
						Total de Irlanda	440.605	1,24	
AUSTRALIA					JAPÓN				
	969	CSL Limited	187.103	0,52	600	Keyence Corp.	290.555	0,81	
		Total de Australia	187.103	0,52	3.600	Recruit Holdings Company Limited	98.730	0,28	
CANADÁ					2.000	Sony Group Corp.	180.104	0,50	
	2.068	Nutrien Limited	152.516	0,43		Total de Japón	569.389	1,59	
		Total de Canadá	152.516	0,43					
DINAMARCA					PAÍSES BAJOS				
	1.308	Novo Nordisk AS	207.134	0,58	1.135	Koninklijke DSM NV	134.040	0,37	
	2.406	Orsted A/S	204.718	0,57		Total de Países Bajos	134.040	0,37	
		Total de Dinamarca	411.852	1,15					

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)			
NORUEGA				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
6.643	Equinor ASA	189.463	0,53	470	Elevance Health Inc.	216.111	0,60
	Total de Noruega	189.463	0,53	1.026	Eli Lilly & Company	352.349	0,99
REPÚBLICA DE COREA (SUR)				238	Equinix Inc.	171.608	0,48
377	Samsung Sdi Company Limited	212.848	0,60	1.697	IntercontinentalExchange Inc.	176.980	0,49
	Total de República de Corea (Sur)	212.848	0,60	873	Intuit Inc.	389.210	1,09
SINGAPUR				2.906	JPMorgan Chase & Company	378.682	1,05
10.300	DBS Group Holdings Limited	255.650	0,71	508	Lam Research Corp.	269.301	0,75
	Total de Singapur	255.650	0,71	1.582	Mastercard Inc. - A	574.915	1,61
SUIZA				160	Mercadolibre Inc.	210.890	0,59
295	Lonza Group AG - Reg	176.764	0,49	3.249	Micron Technology Inc.	196.045	0,55
2.776	Nestle SA - Reg	338.693	0,95	3.484	Microsoft Corp.	1.004.437	2,80
	Total de Suiza	515.457	1,44	3.102	NextEra Energy Inc.	239.102	0,68
TAIWÁN				913	NVIDIA Corp.	253.604	0,71
23.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	402.622	1,12	2.220	ON Semiconductor Corp.	182.750	0,51
	Total de Taiwán	402.622	1,12	1.585	Paypal Holdings Inc.	120.365	0,34
REINO UNIDO				1.638	PepsiCo Inc.	298.607	0,83
4.557	Anglo American plc	150.892	0,42	2.270	QUALCOMM Inc.	289.607	0,81
5.402	Diageo plc	241.390	0,68	669	Stryker Corp.	190.979	0,54
8.461	Shell plc	241.506	0,68	488	Thermo Fisher Scientific Inc.	281.269	0,79
5.043	SSE plc	112.425	0,31	3.508	T-Mobile USA Inc.	508.099	1,42
	Total de Reino Unido	746.213	2,09	3.348	Trimble Inc.	175.502	0,49
ESTADOS UNIDOS				7.433	Uber Technologies Inc.	235.626	0,66
1.703	Abbott Laboratories	172.446	0,48	1.200	Union Pacific Corp.	241.512	0,68
623	Adobe Inc.	240.086	0,67	1.902	Walt Disney Company	190.447	0,53
1.761	Advanced Micro Devices Inc.	172.596	0,48		Total de Estados Unidos	10.287.107	28,76
7.152	Alphabet Inc. - A	741.877	2,07		Total de renta variable	17.204.546	48,11
6.203	Amazon.com Inc.	640.707	1,79		Instrumentos estructurados - Materias primas		
750	Autodesk Inc.	156.120	0,44		IRLANDA		
511	Cooper Companies Inc.	190.787	0,53	1.035	Invesco Physical Gold ETC 0.00%	197.789	0,55
869	CrowdStrike Holdings Inc. - A	119.279	0,33		Total de Irlanda	197.789	0,55
407	Deere & Company	168.042	0,47		Total de instrumentos estructurados - Materias primas	197.789	0,55
1.784	Ecolab Inc.	295.306	0,83		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	29.641.826	82,89
2.008	Electronic Arts Inc.	241.864	0,68				

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			
90.494	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio XU**	1.885.062	5,27
	Total de Luxemburgo	1.885.062	5,27
Total de fondos		1.885.062	5,27
Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		1.885.062	5,27
Otros organismos de inversión colectiva			
Fondos			
REINO UNIDO			
309.138	CT Emerging Market Local Fund***	884.474	2,48
	Total de Reino Unido	884.474	2,48
Total de fondos		884.474	2,48
Total de otros organismos de inversión colectiva		884.474	2,48
Valor total de las inversiones		32.411.362	90,64
(Coste total: 28.868.926 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 31 de marzo de 2023

			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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	100.000	APA Infrastructure Limited 0.75% 15/03/2029	88.981	0,08	EUR	100.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	92.125	0,08
USD	77.000	Ausgrid Finance Pty Limited 4.35% 01/08/2028	73.348	0,07	EUR	100.000	Teollisuuden Voima Oyj 1.38% 23/06/2028	93.134	0,09
EUR	100.000	NBN Company Limited 4.13% 15/03/2029	111.159	0,10	EUR	100.000	Teollisuuden Voima Oyj 2.63% 31/03/2027	101.958	0,09
USD	97.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	93.652	0,09	Total de Finlandia		287.217	0,26	
Total de Australia			367.140	0,34					
BÉLGICA					FRANCIA				
EUR	100.000	Azelis Finance NV 5.75% 15/03/2028	110.275	0,10	EUR	100.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	101.493	0,09
EUR	100.000	Solvay SA FRN 02/03/2169	97.454	0,09	EUR	100.000	Altice France SA 4.00% 15/07/2029	81.781	0,07
EUR	100.000	Solvay SA Perp FRN 04/03/2168	108.089	0,10	EUR	100.000	Altice France SA 4.13% 15/01/2029	84.053	0,08
Total de Bélgica			315.818	0,29	EUR	104.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	85.196	0,08
BERMUDAS					EUR	100.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	96.287	0,09
USD	100.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	93.753	0,09	USD	200.000	BNP Paribas SA FRN 13/01/2029	200.138	0,19
Total de Bermudas			93.753	0,09	EUR	100.000	BPCE SA 0.25% 14/01/2031	82.080	0,07
CANADÁ					EUR	192.000	CAB Selsas 3.38% 01/02/2028	171.782	0,16
USD	31.000	Enbridge Inc. 5.70% 08/03/2033	32.289	0,03	EUR	107.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	35.718	0,03
EUR	172.000	Primo Water Holdings Inc. 3.88% 31/10/2028	163.040	0,15	EUR	200.000	Electricite de France SA FRN 01/06/2170	172.973	0,16
Total de Canadá			195.329	0,18	EUR	200.000	Electricite de France SA FRN 15/03/2169	182.711	0,17
ISLAS CAIMÁN					EUR	200.000	Electricite de France SA 4.25% 25/01/2032	215.781	0,20
GBP	112.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	119.953	0,11	EUR	100.000	Electricite de France SA FRN 22/01/2049	100.586	0,09
Total de Islas Caimán			119.953	0,11	EUR	100.000	Electricite de France SA FRN 29/12/2049	104.151	0,10
REPÚBLICA CHECA					GBP	200.000	Electricite de France SA FRN 31/12/2049	205.790	0,19
EUR	100.000	Allwyn International AS 4.13% 20/11/2024	107.092	0,10	EUR	100.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	95.409	0,09
Total de República Checa			107.092	0,10	EUR	100.000	Emeria SASU 7.75% 31/03/2028	103.379	0,10
DINAMARCA					EUR	150.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2027	142.568	0,13
EUR	100.000	Danske Bank AS 0.63% 26/05/2025	101.540	0,09	EUR	187.000	Faurecia SE 2.75% 15/02/2027	181.144	0,17
Total de Dinamarca			101.540	0,09	EUR	100.000	Faurecia SE 3.75% 15/06/2028	97.594	0,09
					EUR	100.000	Faurecia SE 7.25% 15/06/2026	112.289	0,10
					EUR	105.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	110.920	0,10
					EUR	317.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	332.551	0,31
					EUR	100.000	Iliad Holding SASU 5.63% 15/10/2028	101.399	0,09
					EUR	100.000	iliad SA 5.38% 14/06/2027	107.983	0,10
					EUR	100.000	iliad SA 5.63% 15/02/2030	105.615	0,10

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)			
FRANCIA (continuación)				ALEMANIA (continuación)			
EUR	182.000 Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	192.741	0,18	EUR	129.000 Techem		
EUR	160.000 Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	172.189	0,16		Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 2.00% 15/07/2025	130.909	0,12
EUR	163.000 Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	178.666	0,16	EUR	100.000 Vier Gas Transport GmbH 0.13% 10/09/2029	86.091	0,08
EUR	100.000 Renault SA 2.38% 25/05/2026	99.613	0,09	EUR	100.000 Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	112.238	0,10
EUR	100.000 Renault SA 2.50% 02/06/2027	95.970	0,09	EUR	19.000 Volkswagen Financial Services AG 3.38% 06/04/2028	20.109	0,02
EUR	100.000 Rexel SA 2.13% 15/06/2028	95.855	0,09	EUR	100.000 Vonovia SE 5.00% 23/11/2030	101.896	0,09
EUR	100.000 Tereos Finance Groupe I SA 7.25% 15/04/2028	106.820	0,10	EUR	100.000 ZF Finance GmbH 3.75% 21/09/2028	97.252	0,09
EUR	100.000 Valeo 5.38% 28/05/2027	108.323	0,10		Total de Alemania	2.916.572	2,67
EUR	200.000 Verallia SA 1.63% 14/05/2028	190.690	0,17				
EUR	100.000 Verallia SA 1.88% 10/11/2031	88.225	0,08				
	Total de Francia	4.740.463	4,37				
ALEMANIA				GIBRALTAR			
EUR	100.000 Ampriom GmbH 3.97% 22/09/2032	110.752	0,10	EUR	130.000 888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027	120.240	0,11
EUR	200.000 Bayer AG FRN 25/03/2082	202.018	0,19		Total de Gibraltar	120.240	0,11
EUR	130.000 Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	130.715	0,13				
EUR	101.000 Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	102.447	0,09	GRECIA			
EUR	100.000 Commerzbank AG FRN 29/12/2031	89.486	0,08	EUR	119.000 Eurobank SA FRN 26/01/2029	126.036	0,12
EUR	46.000 Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	46.902	0,04		Total de Grecia	126.036	0,12
USD	150.000 Deutsche Bank AG FRN 28/05/2032	116.030	0,11				
EUR	200.000 Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	209.659	0,19	IRLANDA			
EUR	200.000 Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	196.444	0,18	EUR	100.000 AIB Group plc FRN 19/11/2029	101.455	0,09
EUR	111.000 Gruenenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	109.960	0,10	EUR	276.000 Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	284.889	0,27
EUR	100.000 Gruenenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	99.063	0,09	GBP	185.000 Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 4.88% 15/07/2028	195.420	0,18
EUR	110.000 HT Troplast GmbH 9.25% 15/07/2025	118.621	0,11		Total de Irlanda	581.764	0,54
EUR	155.000 IHO Verwaltungs GmbH 8.75% 15/05/2028	172.689	0,16				
EUR	200.000 Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	166.534	0,15	ITALIA			
EUR	115.000 Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	109.055	0,10	EUR	206.000 Autostrade per l'Italia SpA 1.63% 25/01/2028	195.206	0,18
EUR	126.000 PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	118.964	0,10	EUR	100.000 Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	94.230	0,09
EUR	191.000 Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	169.011	0,16	EUR	100.000 Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 15/01/2030	90.665	0,08
EUR	100.000 Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	99.727	0,09	EUR	170.000 Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	158.514	0,14
				EUR	149.000 FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	144.600	0,12
				EUR	100.000 Intesa Sanpaolo SpA FRN 12/07/2029	107.228	0,10
				EUR	100.000 Lottomatica SpA 6.25% 15/07/2025	108.579	0,10

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal		Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal		Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
ITALIA (continuación)					LUXEMBURGO (continuación)				
EUR	100.000	Lottomatica SpA 9.75% 30/09/2027	115.473	0,11	EUR	27.029	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	29.362	0,03
EUR	113.000	Mundys SpA 1.88% 13/07/2027	108.947	0,10	EUR	100.000	Eurofins Scientific SE FRN 13/11/2166	100.380	0,09
EUR	193.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	190.855	0,17	GBP	100.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.75% 01/11/2025	94.184	0,09
EUR	220.000	Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	228.598	0,21	EUR	100.000	Grand City Properties SA 0.13% 11/01/2028	76.816	0,07
EUR	150.000	Telecom Italia SpA 3.63% 25/05/2026	156.508	0,14	EUR	384.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	355.919	0,33
EUR	119.000	Telecom Italia SpA 6.88% 15/02/2028	132.289	0,12	EUR	98.240	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	106.228	0,10
Total de Italia			1.831.692	1,66	EUR	140.000	Loarre Investments Sarl 6.50% 15/05/2029	141.972	0,13
JAPÓN					EUR	100.000	Matterhorn Telecom SA 4.00% 15/11/2027	100.578	0,09
USD	200.000	Central Nippon Expressway Company Limited 0.89% 10/12/2025	180.128	0,16	EUR	100.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	81.710	0,07
EUR	100.000	Softbank Group Corp. 3.13% 19/09/2025	99.616	0,09	EUR	100.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	101.063	0,09
Total de Japón			279.744	0,25	EUR	100.000	SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	99.859	0,09
JERSEY - ISLAS DEL CANAL					EUR	44.000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/01/2033	51.292	0,05
EUR	159.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	168.809	0,15	EUR	100.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	99.553	0,09
EUR	100.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	87.896	0,08	Total de Luxemburgo			2.416.088	2,21
GBP	50.000	Heathrow Funding Limited 6.45% 10/12/2031	65.883	0,06	MÉXICO				
EUR	100.000	Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	100.678	0,09	EUR	100.000	Petroleos Mexicanos 2.75% 21/04/2027	86.636	0,08
Total de Jersey - Islas del Canal			423.266	0,38	EUR	149.000	Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	128.282	0,12
					Total de México			214.918	0,20
LUXEMBURGO					PAÍSES BAJOS				
EUR	200.000	Agps Bondco plc 3.25% 05/08/2025	88.383	0,08	EUR	137.000	Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	128.453	0,12
EUR	130.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	133.238	0,12	EUR	100.000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/01/2025	107.550	0,10
EUR	137.000	Altice Finco SA 4.75% 15/01/2028	112.307	0,10	EUR	200.000	Constellium SE 4.25% 15/02/2026	212.227	0,19
EUR	164.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	133.766	0,12	EUR	200.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	211.457	0,19
GBP	120.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	93.795	0,09	EUR	100.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	76.581	0,07
GBP	140.000	B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	163.010	0,15	EUR	146.000	Dufry One BV 2.00% 15/02/2027	137.372	0,13
EUR	141.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	125.252	0,11	GBP	68.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	88.672	0,08
EUR	121.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	127.421	0,12					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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)				
USD	15.000	E.ON International Finance BV 6.65% 30/04/2038	16.432	0,02	EUR	100.000	ZF Europe Finance BV 3.00% 23/10/2029	91.849	0,08
EUR	100.000	Naturgy Finance BV - Perp FRN	94.761	0,09	Total de Países Bajos			3.708.835	3,35
EUR	100.000	OI European Group BV 2.88% 15/02/2025	105.917	0,10					
EUR	167.000	PPF Telecom Group BV 3.25% 29/09/2027	166.900	0,15	NORUEGA				
EUR	100.000	Repsol International Finance BV FRN 22/03/2170	94.780	0,09	EUR	100.000	DNB Bank ASA FRN 21/09/2027	106.886	0,10
EUR	100.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	91.474	0,08	USD	244.000	Kommunalbanken AS 0.38% 11/09/2025	222.977	0,20
EUR	100.000	Stellantis NV 1.25% 20/06/2033	81.619	0,07	Total de Noruega			329.863	0,30
EUR	144.765	Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	123.407	0,11					
EUR	129.877	Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	110.716	0,10	PORTUGAL				
EUR	100.000	Telefonica Europe BV FRN 24/05/2170	90.537	0,08	EUR	100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 14/03/2082	91.432	0,08
EUR	100.000	Telefonica Europe BV FRN 23/11/2171	110.843	0,10	EUR	100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 23/04/2083	106.756	0,10
EUR	100.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	90.537	0,08	Total de Portugal			198.188	0,18
EUR	200.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	212.585	0,19					
EUR	287.000	Tennet Holding BV FRN 22/10/2168	291.296	0,26	RUMANÍA				
EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.75% 09/05/2027	98.520	0,09	EUR	100.000	RCS & RDS SA 2.50% 05/02/2025	102.757	0,09
EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.38% 09/05/2030	92.239	0,08	Total de Rumanía			102.757	0,09
EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7.38% 15/09/2029	110.316	0,10					
EUR	100.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	81.600	0,07	ESPAÑA				
EUR	100.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	89.869	0,08	EUR	200.000	Banco de SAbadell SA FRN 07/02/2029	206.192	0,20
EUR	100.000	Villa Dutch Bidco BV 9.00% 03/11/2029	103.004	0,09	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.00% 15/09/2027	92.918	0,08
EUR	100.000	Volkswagen International Finance NV 3.25% 18/11/2030	101.765	0,09	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.25% 15/01/2029	88.931	0,08
EUR	100.000	VZ Vendor Financing II BV 2.88% 15/01/2029	87.071	0,08	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.50% 08/06/2028	92.733	0,08
EUR	100.000	Wolters Kluwer NV 3.75% 03/04/2031	109.296	0,10	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 2.00% 15/02/2033	83.416	0,08
EUR	100.000	ZF Europe Finance BV 2.00% 23/02/2026	99.190	0,09	EUR	200.000	Cellnex Finance Company SA 2.25% 12/04/2026	204.447	0,20
					EUR	100.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	90.566	0,08
					EUR	144.000	Grifols Escrow Issuer SA 3.88% 15/10/2028	122.450	0,11
					EUR	100.000	Grifols SA 1.63% 15/02/2025	102.536	0,09
					EUR	100.000	Grifols SA 2.25% 15/11/2027	92.510	0,08
					EUR	100.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	99.131	0,09
					EUR	100.000	Kaixo Bondco Telecom SA 5.13% 30/09/2029	95.652	0,09

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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	272.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	272.088	0,26	GBP	100.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	116.070	0,11
		Total de España	1.643.570	1,52	GBP	137.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	141.475	0,13
SUECIA					EUR	155.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	151.461	0,14
EUR	162.000	Heimstaden Bostad AB FRN 01/05/2169	90.565	0,08	EUR	109.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	109.458	0,10
EUR	50.000	Heimstaden Bostad AB FRN 01/05/2170	27.952	0,03	EUR	19.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	20.123	0,02
EUR	52.111	Intrum AB 3.13% 15/07/2024	54.497	0,05	GBP	100.000	HSBC Holdings plc FRN 16/11/2034	130.040	0,12
EUR	135.000	Intrum AB 3.50% 15/07/2026	122.410	0,11	EUR	100.000	INEOS Finance plc 3.38% 31/03/2026	101.935	0,09
EUR	100.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	100.679	0,09	EUR	100.000	INEOS Finance plc 6.63% 15/05/2028	109.722	0,10
EUR	100.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	88.314	0,08	EUR	100.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	97.788	0,09
EUR	100.000	Sagax AB 2.25% 13/03/2025	102.343	0,09	EUR	119.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	116.368	0,11
EUR	110.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB - Perp FRN	44.302	0,04	EUR	190.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	199.716	0,18
EUR	100.000	Verisure Holding AB 3.88% 15/07/2026	101.103	0,09	GBP	187.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	219.655	0,20
EUR	100.000	Verisure Holding AB 7.13% 01/02/2028	108.979	0,10	EUR	136.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	145.445	0,13
EUR	155.000	Verisure Midholding A 5.25% 15/02/2029	140.316	0,13	EUR	100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	104.047	0,10
		Total de Suecia	981.460	0,89	GBP	200.000	Jerrold Finco plc 5.25% 15/01/2027	208.651	0,18
SUIZA					GBP	200.000	Ladbrokes Group Finance plc 5.13% 08/09/2023	246.092	0,21
EUR	100.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	85.732	0,08	GBP	201.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	225.118	0,20
EUR	100.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	71.338	0,07	EUR	100.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	83.304	0,08
		Total de Suiza	157.070	0,15	GBP	100.000	National Grid Electricity Transmission plc 1.13% 07/07/2028	101.820	0,09
REINO UNIDO					EUR	100.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	87.951	0,08
GBP	100.000	Barclays plc 3.25% 12/02/2027	112.541	0,10	EUR	200.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	201.527	0,18
EUR	103.000	BCP V Modular Services Finance II plc 4.75% 30/11/2028	95.358	0,09	GBP	100.000	Premier Foods Finance plc 3.50% 15/10/2026	112.335	0,10
GBP	167.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	134.929	0,12	GBP	100.000	Rolls-Royce plc 3.38% 18/06/2026	112.573	0,10
USD	94.000	BP Capital Markets plc FRN 22/09/2168	90.163	0,08	GBP	121.000	Rolls-Royce plc 5.75% 15/10/2027	143.213	0,13
EUR	142.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	143.039	0,12	GBP	15.000	Santander UK plc Perp 10.06%	26.901	0,02
EUR	100.000	British American Tobacco plc FRN 27/12/2169	88.685	0,08					
GBP	75.000	Broadgate Financing plc 5.00% 05/10/2031	90.043	0,08					
EUR	100.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	87.651	0,08					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
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	171.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	160.243	0,15	EUR	219.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	197.037	0,19
EUR	100.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	99.990	0,09					
GBP	100.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	110.722	0,10	USD	114.000	Astrazeneca Finance LLC 4.88% 03/03/2028	117.366	0,11
EUR	100.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	93.938	0,09	USD	119.000	AT&T Inc. 3.50% 15/09/2053	86.539	0,08
EUR	100.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	88.113	0,08	USD	44.000	AT&T Inc. 4.90% 15/08/2037	42.257	0,04
GBP	311.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	335.987	0,32	EUR	158.000	Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	165.625	0,15
EUR	100.000	Virgin Money UK plc FRN 29/10/2028	103.642	0,09	USD	30.000	Bank of America Corp. FRN 21/07/2032	24.221	0,02
EUR	100.000	Vodafone Group plc FRN 03/01/2079	107.189	0,10	USD	53.000	Bank of America Corp. FRN 13/02/2031	44.925	0,04
GBP	155.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	182.699	0,17	USD	91.000	Bank of America Corp. FRN 29/04/2031	77.001	0,07
USD	231.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	226.144	0,21	USD	66.000	Bank of America Corp. FRN 11/03/2032	55.141	0,05
GBP	100.000	Wessex Water Services Finance plc 5.13% 31/10/2032	122.116	0,11	USD	30.000	Bank of America Corp. FRN 04/02/2033	25.424	0,02
GBP	164.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	153.414	0,14	USD	42.000	Bank of America Corp. FRN 23/07/2030	37.445	0,03
		Total de Reino Unido	5.939.394	5,39	USD	91.000	Berkshire Hathaway Finance Corp. 3.85% 15/03/2052	76.680	0,07
ESTADOS UNIDOS					USD	25.000	Boeing Company 3.95% 01/08/2059	18.492	0,02
USD	63.000	AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	55.679	0,05	USD	30.000	Boeing Company 5.93% 01/05/2060	30.003	0,03
USD	10.000	AbbVie Inc. 4.88% 14/11/2048	9.659	0,01	USD	12.000	Broadcom Inc. 4.15% 15/11/2030	11.141	0,01
USD	22.000	AEP Texas Inc. 3.45% 15/05/2051	16.096	0,01	USD	25.000	Brown-Forman Corp. 4.75% 15/04/2033	25.242	0,02
USD	161.000	Amazon.com Inc. 4.70% 01/12/2032	165.357	0,14	EUR	100.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	98.008	0,09
USD	21.000	American Transmission Systems Inc. 2.65% 15/01/2032	17.752	0,02	USD	18.000	Charter Communications Operating LLC 3.90% 01/06/2052	11.915	0,01
USD	23.000	Amgen Inc. 2.20% 21/02/2027	21.191	0,02	USD	40.000	Charter Communications Operating LLC 3.95% 30/06/2062	25.435	0,02
USD	32.000	Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	29.433	0,03	USD	17.000	Commonwealth Edison Company 4.00% 01/03/2049	14.271	0,01
USD	35.000	Amgen Inc. 3.15% 21/02/2040	27.530	0,03	USD	13.000	Commonwealth Edison Company 5.30% 01/02/2053	13.629	0,01
USD	12.000	Amgen Inc. 4.20% 22/02/2052	10.195	0,01	USD	12.000	Connecticut Light and Power Company 5.25% 15/01/2053	12.427	0,01
USD	10.000	Amgen Inc. 4.88% 01/03/2053	9.386	0,01	USD	15.000	Consolidated Edison Company of New York Inc. 3.95% 01/04/2050	12.477	0,01
USD	33.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	33.759	0,03	USD	21.000	CSX Corp. 3.80% 15/04/2050	17.139	0,02
USD	122.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	125.409	0,11	USD	16.000	CSX Corp. 4.50% 15/11/2052	14.671	0,01
USD	19.000	Amgen Inc. 5.65% 02/03/2053	19.782	0,02	USD	150.000	Daimler Truck Finance North America LLC 5.13% 19/01/2028	150.340	0,14
USD	56.000	Amgen Inc. 5.75% 02/03/2063	58.306	0,05					
USD	113.000	Anheuser-Busch Companies LLC 4.70% 01/02/2036	112.602	0,10					
USD	50.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 4.35% 01/06/2040	47.032	0,04					
USD	40.000	Apple Inc. 2.65% 11/05/2050	28.398	0,03					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valor nominal	Inversión			Valor nominal	Inversión				
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	30.000	Emera US Finance LP 4.75% 15/06/2046	24.502	0,02	USD	199.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	167.343	0,16
USD	53.000	Enterprise Products Operating LLC 4.45% 15/02/2043	47.377	0,04	USD	33.000	JPMorgan Chase & Company FRN 25/01/2033	28.288	0,03
USD	169.000	Eversource Energy 2.55% 15/03/2031	144.327	0,13	USD	45.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2041	34.429	0,03
USD	31.000	Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	23.611	0,02	USD	78.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	68.726	0,06
USD	25.000	Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	19.041	0,02	USD	17.000	Kinder Morgan Inc. 5.20% 01/06/2033	16.882	0,02
USD	23.000	Eversource Energy 5.45% 01/03/2028	23.842	0,02	GBP	100.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	119.570	0,11
USD	20.000	Federal Home Loan Banks 5.50% 15/07/2036	22.990	0,02	USD	12.000	Lowe's Companies Inc. 5.75% 01/07/2053	12.238	0,01
EUR	100.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	101.370	0,09	USD	47.000	Lowe's Companies Inc. 5.80% 15/09/2062	47.503	0,04
GBP	100.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	117.866	0,11	USD	35.000	Metropolitan Edison Company 4.30% 15/01/2029	33.637	0,03
EUR	100.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	106.940	0,10	USD	156.000	Metropolitan Life Global Funding I 1.55% 07/01/2031	124.980	0,11
GBP	200.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	237.748	0,22	USD	25.000	Microsoft Corp. 4.10% 06/02/2037	24.938	0,02
EUR	139.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.87% 03/08/2027	146.584	0,13	EUR	100.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	104.880	0,10
GBP	108.000	Ford Motor Credit Company LLC 6.86% 05/06/2026	133.405	0,12	USD	37.000	New York Life Global Funding 4.55% 28/01/2033	36.647	0,03
USD	19.000	Georgia Power Company 3.70% 30/01/2050	14.779	0,01	USD	33.000	New York Life Global Funding 4.85% 09/01/2028	33.517	0,03
USD	15.000	Georgia Power Company 5.13% 15/05/2052	14.710	0,01	USD	17.000	New York Life Insurance Company 4.45% 04/04/2069	15.083	0,01
USD	19.000	Goodman USA Finance Five LLC 4.63% 04/05/2032	17.835	0,02	USD	25.000	NiSource Inc. 4.38% 15/05/2047	21.729	0,02
USD	26.000	Goodman USA Finance Three LLC 3.70% 15/03/2028	24.028	0,02	USD	125.000	NiSource Inc. 4.80% 15/02/2044	115.349	0,11
USD	25.000	Guardian Life Insurance Company of America 4.85% 24/01/2077	22.130	0,02	USD	14.000	NiSource Inc. 5.00% 15/06/2052	13.347	0,01
USD	20.000	HCA Inc. 5.88% 01/02/2029	20.444	0,02	USD	86.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.45% 30/03/2051	63.402	0,06
USD	14.000	Indiana Michigan Power Company 5.63% 01/04/2053	14.572	0,01	USD	8.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.63% 30/09/2059	5.961	0,01
USD	36.000	Intel Corp. 4.75% 25/03/2050	33.057	0,03	USD	28.000	Occidental Petroleum Corp. 6.38% 01/09/2028	29.143	0,03
USD	24.000	Intel Corp. 5.13% 10/02/2030	24.437	0,02	USD	56.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	59.183	0,05
EUR	200.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	193.307	0,18	USD	30.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	32.944	0,03
EUR	116.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/03/2029	107.667	0,10	USD	65.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	75.684	0,07
EUR	100.000	IQVIA Inc. 2.88% 15/06/2028	97.862	0,09	USD	44.000	Oracle Corp. 2.88% 25/03/2031	37.760	0,04
USD	47.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	39.380	0,04	USD	29.000	Oracle Corp. 3.60% 01/04/2040	22.514	0,02
USD	40.000	JPMorgan Chase & Company FRN 04/02/2032	32.180	0,03	USD	29.000	Oracle Corp. 3.65% 25/03/2041	22.462	0,02

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valor nominal	Inversión			Valor nominal	Inversión				
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	97.000	Pacific Gas and Electric Company 4.95% 01/07/2050	80.119	0,07	USD	82.000	UnitedHealth Group Inc. 4.50% 15/04/2033	81.578	0,07
USD	20.000	Piedmont Natural Gas Company Inc. 3.35% 01/06/2050	14.116	0,01	USD	34.000	UnitedHealth Group Inc. 4.95% 15/05/2062	33.125	0,03
USD	39.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	34.691	0,03	USD	60.000	UnitedHealth Group Inc. 5.30% 15/02/2030	63.319	0,06
USD	39.000	Plains All American Pipeline LP 4.70% 15/06/2044	30.695	0,03	USD	20.000	UnitedHealth Group Inc. 6.05% 15/02/2063	22.785	0,02
USD	33.000	PPL Electric Utilities Corp 4.15% 15/06/2048	29.511	0,03	USD	101.000	Verizon Communications Inc. 4.40% 01/11/2034	96.091	0,09
USD	30.000	PPL Electric Utilities Corp. 5.00% 15/05/2033	30.647	0,03	USD	119.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	96.623	0,09
USD	56.000	Public Service Electric and Gas Company 4.65% 15/03/2033	56.306	0,05	USD	50.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.39% 15/03/2062	40.489	0,04
USD	28.000	RELX Capital Inc. 4.75% 20/05/2032	27.837	0,03	USD	50.000	Williams Partners LP 4.85% 01/03/2048	44.421	0,04
USD	16.000	Republic Services Inc. 4.88% 01/04/2029	16.193	0,01	Total de Estados Unidos		6.717.202	6,10	
USD	30.000	San Diego Gas & Electric Company 3.32% 15/04/2050	22.199	0,02	Total de bonos		35.016.964	31,94	
USD	17.000	San Diego Gas & Electric Company 4.15% 15/05/2048	14.842	0,01	Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
EUR	100.000	Silgan Holdings Inc. 2.25% 01/06/2028	91.939	0,08	AUSTRALIA				
EUR	129.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	136.884	0,12	AUD	32.000	Australia (Govt of) 1.00% 21/12/2030	18.194	0,02
USD	22.000	Southern California Edison Company 4.13% 01/03/2048	18.283	0,02	Total de Australia		18.194	0,02	
USD	13.000	Southern California Gas Company 3.95% 15/02/2050	10.515	0,01	AUSTRIA				
USD	11.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.90% 15/09/2044	10.194	0,01	EUR	5.000	Austria (Govt of) 0.85% 30/06/2120	2.356	0,00
GBP	50.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	59.688	0,05	EUR	187.000	Austria (Govt of) 2.90% 20/02/2033	202.111	0,18
USD	23.000	T-Mobile USA Inc. 2.63% 15/02/2029	20.286	0,02	Total de Austria		204.467	0,18	
USD	42.000	T-Mobile USA Inc. 2.88% 15/02/2031	36.258	0,03	BÉLGICA				
USD	20.000	T-Mobile USA Inc. 3.40% 15/10/2052	14.426	0,01	EUR	18.000	Belgium (Govt of) 0.90% 22/06/2029	17.603	0,02
USD	26.000	T-Mobile USA Inc. 4.95% 15/03/2028	26.251	0,02	Total de Bélgica		17.603	0,02	
USD	26.000	T-Mobile USA Inc. 5.05% 15/07/2033	26.141	0,02	CANADÁ				
USD	17.000	T-Mobile USA Inc. 5.80% 15/09/2062	17.625	0,02	CAD	52.000	Canada (Govt of) 2.75% 01/12/2048	36.254	0,03
USD	46.000	Toyota Motor Credit Corp. 4.63% 12/01/2028	46.578	0,04	CAD	240.000	Canada Housing Trust No 1 1.10% 15/03/2031	150.518	0,14

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)				
CANADÁ (continuación)					MÉXICO				
USD	80.000	Province of Ontario Canada 1.13% 07/10/2030	65.423	0,06	USD	1.268.000	Mexico (Govt of) 5.75% 12/10/2110	1.140.820	1,04
Total de Canadá			252.195	0,23	Total de México			1.140.820	1,04
FRANCIA					ESPAÑA				
EUR	100.000	Bpifrance SACA 2.88% 25/11/2029	107.378	0,10	EUR	45.000	Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2027	43.213	0,04
EUR	100.000	Caisse d’Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/02/2028	94.084	0,09	EUR	9.000	Spain (Govt of) 0.10% 30/04/2031	7.696	0,01
USD	200.000	Caisse d’Amortissement de la Dette Sociale 1.00% 21/10/2030	164.458	0,15	EUR	18.000	Spain (Govt of) 2.90% 31/10/2046	17.128	0,02
USD	200.000	Caisse d’Amortissement de la Dette Sociale 1.38% 20/01/2031	166.858	0,14	Total de España			68.037	0,07
EUR	100.000	Unedic Asseo 0.25% 16/07/2035	76.292	0,07	SUPRANACIONAL				
Total de Francia			609.070	0,55	USD	80.000	Asian Development Bank 0.75% 08/10/2030	64.687	0,06
ALEMANIA					GBP	49.000	Asian Infrastructure Investment BankThe 4.38% 11/06/2026	60.588	0,06
EUR	482.000	Germany (Govt of) 0.00% 09/10/2026	481.341	0,44	USD	25.000	European Investment Bank 0.63% 21/10/2027	21.792	0,02
EUR	179.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/02/2032	159.658	0,15	USD	25.000	European Investment Bank 1.63% 13/05/2031	21.628	0,02
EUR	24.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2052	13.426	0,01	USD	40.000	Inter-American Development Bank 1.13% 13/01/2031	33.133	0,03
Total de Alemania			654.425	0,60	GBP	72.000	Inter-American Development Bank 2.13% 15/12/2028	80.849	0,07
ITALIA					EUR	18.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.20% 21/01/2061	7.116	0,01
USD	200.000	Italy (Govt of) 1.25% 17/02/2026	179.083	0,16	USD	135.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 11/03/2025	126.591	0,12
EUR	12.000	Italy (Govt of) 2.45% 01/09/2033	11.246	0,01	USD	80.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.88% 14/05/2030	65.822	0,06
EUR	3.000	Italy (Govt of) 4.00% 30/04/2035	3.188	0,00	AUD	70.000	International Finance Corp. 1.50% 15/04/2035	33.468	0,03
Total de Italia			193.517	0,17	USD	200.000	New Development Bank 0.63% 29/09/2025	181.841	0,16
JAPÓN					Total de supranacional			697.515	0,64
JPY	13.950.000	Japan (Govt of) Forty Year Bond 0.40% 20/03/2056	79.649	0,07	REINO UNIDO				
JPY	4.150.000	Japan (Govt of) Forty Year Bond 0.50% 20/03/2059	23.954	0,02	GBP	300.000	United Kingdom Gilt 0.63% 31/07/2035	260.478	0,24
JPY	800.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.40% 20/06/2049	4.891	0,00	GBP	161.000	United Kingdom Gilt 0.88% 31/07/2033	153.469	0,14
JPY	1.300.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.60% 20/09/2050	8.267	0,01					
JPY	2.200.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.70% 20/12/2051	14.277	0,01					
Total de Japón			131.038	0,11					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal		Inversión		Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal		Inversión		Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)						Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					
REINO UNIDO (continuación)						ESTADOS UNIDOS (continuación)					
GBP	3.000	United Kingdom Gilt 1.13% 31/01/2039		2.527	0,00	USD	2.600.000	United States Treasury N/B 3.88% 15/02/2043		2.625.594	2,41
GBP	40.000	United Kingdom Gilt 1.25% 22/10/2041		32.662	0,03	USD	16.000	United States Treasury N/B 4.00% 31/10/2029		16.388	0,01
GBP	770.000	United Kingdom Gilt 1.25% 31/07/2051		533.424	0,49	Total de Estados Unidos				9.076.713	8,31
GBP	4.000	United Kingdom Gilt 1.75% 07/09/2037		3.847	0,00	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					
GBP	55.000	United Kingdom Gilt 4.13% 29/01/2027		68.943	0,06	16.505.74215,08					
GBP	1.700.000	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.15% 22/03/2051		2.386.798	2,18	Renta variable					
Total de Reino Unido						3.442.1483,14					
ESTADOS UNIDOS						AUSTRALIA					
USD	421.000	United States Treasury N/B 0.13% 15/07/2023		415.672	0,38	14.482	ANZ Group Holdings Limited			222.405	0,20
USD	60.000	United States Treasury N/B 0.13% 31/07/2023		59.123	0,05	9.474	Coles Group Limited			114.341	0,10
USD	40.000	United States Treasury N/B 0.50% 31/10/2027		34.719	0,03	59.546	Deterra Royalties Limited			191.428	0,17
USD	618.000	United States Treasury N/B 0.63% 15/08/2030		503.718	0,46	19.638	Dexus			98.776	0,09
USD	19.000	United States Treasury N/B 0.75% 31/01/2028		16.604	0,02	1.662	Macquarie Group Limited			195.531	0,18
USD	145.000	United States Treasury N/B 1.00% 31/07/2028		126.750	0,12	3.430	Mineral Resources Limited			185.135	0,17
USD	540.100	United States Treasury N/B 1.13% 15/08/2040		357.605	0,33	37.205	Santos Limited			171.935	0,16
USD	17.000	United States Treasury N/B 1.25% 15/05/2050		9.893	0,01	11.870	Telstra Corp. Limited			33.549	0,03
USD	95.000	United States Treasury N/B 1.38% 15/11/2040		65.535	0,06	26.697	Transurban Group			254.079	0,23
USD	17.000	United States Treasury N/B 1.88% 15/02/2032		14.925	0,01	Total de Australia				1.467.179	1,33
USD	47.600	United States Treasury N/B 1.88% 15/02/2051		32.528	0,03	BÉLGICA					
USD	3.000	United States Treasury N/B 1.88% 15/11/2051		2.044	0,00	1.740	KBC Group NV			119.664	0,11
USD	24.000	United States Treasury N/B 2.38% 31/03/2029		22.416	0,02	565	Melexis NV			65.313	0,06
USD	1.913.200	United States Treasury N/B 3.00% 15/08/2052		1.680.477	1,53	Total de Bélgica				184.977	0,17
USD	43.000	United States Treasury N/B 3.25% 30/06/2029		42.170	0,04	CANADÁ					
USD	3.245.000	United States Treasury N/B 3.38% 15/08/2042		3.050.552	2,80	403	Canadian National Railway Company			47.487	0,04
						1.729	Suncor Energy Inc.			53.607	0,05
						Total de Canadá				101.094	0,09
						ISLAS CAIMÁN					
						36.000	China Mengniu Dairy Company Limited			147.670	0,14
						48.000	China Resources Land Limited			218.905	0,20
						5.050	JD.com Inc.			110.650	0,10
						416	NetEase Inc. - ADR			36.791	0,03
						9.755	NetEase Inc.			171.490	0,16
						5.000	Parade Technologies Limited			172.426	0,16
						Total de Islas Caimán				857.932	0,79

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)			
CHINA				ALEMANIA (continuación)			
126.800	Baoshan Iron & Steel Company Limited - A	115.218	0,11	1.550	Siemens Healthineers AG	89.286	0,08
395.000	China Construction Bank Corp.	256.122	0,23	Total de Alemania		1.023.009	0,93
20.000	China Merchants Bank Company Limited - H	102.166	0,09	GUERNSEY - ISLAS DEL CANAL			
28.500	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	120.851	0,12	28.524	Sherborne Investors Guernsey C Limited	18.516	0,02
39.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	253.874	0,23	Total de Guernsey - Islas del Canal		18.516	0,02
5.400	Wuliangye Yibin Company Limited - A	154.908	0,14	HONG KONG			
Total de China		1.003.139	0,92	36.600	AIA Group Limited	385.350	0,35
DINAMARCA				56.000	BOC Hong Kong Holdings Limited	174.421	0,16
4.519	Tryg A/S	98.796	0,09	29.000	Galaxy Entertainment Group Limited	193.765	0,18
Total de Dinamarca		98.796	0,09	136.000	Guangdong Investment Limited	139.119	0,12
FINLANDIA				5.100	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	226.220	0,21
666	Upm-Kymmene Oyj	22.395	0,02	68.000	Lenovo Group Limited	73.631	0,07
Total de Finlandia		22.395	0,02	14.000	Sun Hung Kai Properties Limited	196.179	0,18
FRANCIA				62.000	Xinyi Glass Holdings Limited	111.048	0,10
790	Air Liquide SA	132.349	0,12	Total de Hong Kong		1.499.733	1,37
7.059	AXA SA	216.004	0,20	INDIA			
2.863	BNP Paribas SA	171.731	0,16	43.751	Embassy Office Parks REIT	166.188	0,15
1.494	Compagnie de Saint-Gobain	84.924	0,08	9.856	HDFC Bank Limited	193.030	0,18
184	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	168.801	0,15	18.774	Hindalco Industries Limited	92.599	0,08
578	Pernod-Ricard SA	131.057	0,12	15.206	Infosys Limited	264.209	0,24
1.045	Sanofi	113.807	0,10	58.688	Power Grid Corp. of India Limited	161.176	0,15
1.070	Schneider Electric SE	178.653	0,17	Total de India		877.202	0,80
3.719	TotalEnergies SE	219.642	0,20	INDONESIA			
1.350	Vinci SA	155.060	0,14	247.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	154.017	0,14
Total de Francia		1.572.028	1,44	669.221	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	211.102	0,19
ALEMANIA				Total de Indonesia		365.119	0,33
1.679	Brenntag SE	126.231	0,12	IRLANDA			
2.236	Daimler Truck Holding AG	75.576	0,07	10.032	Bank of Ireland Group plc	101.625	0,09
6.530	Deutsche Telekom AG - Reg	158.562	0,14	3.601	CRH plc	181.824	0,16
3.779	E.ON SE	47.215	0,04	5.356	Eaton Corp. plc	917.697	0,83
1.575	Evonik Industries AG	33.128	0,03				
902	Mercedes-Benz Group AG - Reg	69.363	0,06				
1.450	SAP SE	182.835	0,17				
1.485	Siemens AG - Reg	240.813	0,22				

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)				FILIPINAS			
1.985	Experian plc	65.286	0,06	74.150	BDO Unibank Inc.	175.263	0,16
4.926	Johnson Controls International plc	296.644	0,27	Total de Filipinas		175.263	0,16
149	Linde plc	52.961	0,05	REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
7.743	Medtronic plc	624.241	0,56	3.048	Kia Corp.	189.644	0,18
3.031	Trinseo plc	63.196	0,06	701	LG Chem Limited	167.194	0,14
Total de Irlanda		2.303.474	2,08	1.634	Samsung Electronics Company Limited	80.329	0,07
ITALIA				9.971	Samsung Electronics Company Limited Pfd	412.827	0,38
28.347	Enel SpA	173.298	0,16	4.517	SK Telecom Company Limited	167.586	0,15
14.133	Nexi SpA	114.946	0,10	Total de República de Corea (Sur)		1.017.580	0,92
Total de Italia		288.244	0,26	SINGAPUR			
JAPÓN				136.800	CapitaLand Integrated Commercial Trust	203.726	0,19
400	Rohm Company Limited	32.970	0,03	2.600	Jardine Cycle & Carriage Limited	61.170	0,06
100	SMC Corp.	52.468	0,05	26.800	Keppel Corp. Limited	113.485	0,10
300	Tokyo Electron Limited	36.156	0,03	8.000	United Overseas Bank Limited	179.068	0,16
15.200	Z Holdings Corp.	42.577	0,04	Total de Singapur		557.449	0,51
Total de Japón		164.171	0,15	ESPAÑA			
JERSEY - ISLAS DEL CANAL				9.245	Iberdrola SA	115.358	0,11
12.533	WPP plc	148.549	0,14	5.765	Inditex SA	193.539	0,18
Total de Jersey - Islas del Canal		148.549	0,14	Total de España		308.897	0,29
MALASIA				SUECIA			
99.100	CIMB Group Holdings Bhd	119.257	0,11	6.226	Sandvik AB	131.970	0,12
Total de Malasia		119.257	0,11	Total de Suecia		131.970	0,12
PAÍSES BAJOS				SUIZA			
533	Akzo Nobel NV	41.682	0,04	946	Nestle SA - Reg	115.419	0,11
366	ASM International NV	147.883	0,14	621	Novartis AG - Reg	56.937	0,05
1.754	BE Semiconductor Industries NV	152.641	0,14	92	Partners Group Holding AG - Reg	86.285	0,08
26.723	Royal KPN NV	94.532	0,09	391	Roche Holding AG	111.687	0,10
Total de Países Bajos		436.738	0,41	3.484	TE Connectivity Limited	456.926	0,42
NORUEGA				Total de Suiza		827.254	0,76
1.368	Equinor ASA	39.016	0,04	TAIWÁN			
Total de Noruega		39.016	0,04	21.850	Chailease Holding Company Limited	160.388	0,15
				23.000	Chroma ATE Inc.	134.082	0,12

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)			
TAIWÁN (continuación)				REINO UNIDO (continuación)			
17.000	Delta Electronics Inc.	168.058	0,15	2.545	Oxford Instruments plc	78.826	0,07
1.000	MediaTek Inc.	25.847	0,02	8.978	Pearson plc	93.736	0,09
46.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	805.245	0,74	1.540	Pennon Group plc	16.642	0,02
22.000	Unimicron Technology Corp.	106.576	0,10	2.571	Persimmon plc	39.927	0,04
10.000	Yageo Corp.	173.739	0,16	11.151	Phoenix Group Holdings plc	75.336	0,07
	Total de Taiwán	1.573.935	1,44	1.886	Reckitt Benckiser Group plc	143.601	0,13
TAILANDIA				1.116	RELX plc	36.120	0,03
188.400	Thai Beverage plc	89.272	0,08	2.534	RELX plc	82.026	0,07
59.205	Thai Oil plc	90.898	0,08	18.203	Rentokil Initial plc	133.152	0,12
	Total de Tailandia	180.170	0,16	13.421	RS Group plc	151.673	0,14
REINO UNIDO				3.621	Smith & Nephew plc	50.234	0,05
14.466	3i Group plc	301.387	0,27	2.942	Smiths Group plc	62.440	0,06
14.805	Allfunds Group plc	97.796	0,09	6.407	SSE plc	142.832	0,13
4.090	Anglo American plc	135.428	0,13	9.072	St James's Place plc	135.839	0,12
1.961	Astrazeneca plc	272.340	0,25	6.080	Tate & Lyle plc	58.983	0,05
6.162	BAE Systems plc	74.864	0,07	17.392	Tesco plc	57.137	0,05
68.768	BT Group plc	123.971	0,11	3.302	Travis Perkins plc	39.048	0,04
48.102	Centrica plc	63.074	0,06	1.496	Unilever plc	77.504	0,07
6.381	Chesnara plc	23.669	0,02	70.929	Vodafone Group plc	78.316	0,07
2.681	Compass Group plc	67.392	0,06	967	Whitbread plc	35.714	0,03
791	Diageo plc	35.346	0,03	8.742	Wincanton plc	23.348	0,02
20.768	Direct Line Insurance Group plc	35.308	0,03		Total de Reino Unido	3.831.967	3,48
11.448	DS Smith plc	44.517	0,04	ESTADOS UNIDOS			
10.202	Elementis plc	15.024	0,01	418	AbbVie Inc.	66.617	0,06
543	Ferguson plc	71.502	0,06	5.431	Ameren Corp.	469.184	0,43
8.000	GSK plc	141.351	0,13	6.313	American Electric Power Company Inc.	574.421	0,52
12.382	Haleon plc	49.297	0,05	174	American Express Company	28.701	0,03
34.143	Hays plc	47.071	0,04	217	Analog Devices Inc.	42.797	0,04
1.896	Hikma Pharmaceuticals plc	39.267	0,04	2.664	Apple Inc.	439.293	0,40
2.348	IMI plc	44.535	0,04	11.410	AT&T Inc.	219.643	0,21
7.319	Imperial Brands plc	168.684	0,15	2.363	Automatic Data Processing Inc.	526.075	0,49
43.840	ITV plc	44.883	0,04	1.173	Becton Dickinson & Company	290.364	0,27
1.659	Johnson Matthey plc	40.687	0,04	555	BlackRock Inc.	371.362	0,34
20.784	Legal & General Group plc	61.393	0,06	9.015	Bristol-Myers Squibb Company	624.830	0,57
826	London Stock Exchange Group plc	80.356	0,07	1.684	Broadcom Inc.	1.080.353	0,98
28.649	Marks & Spencer Group plc	59.157	0,05	1.319	Caterpillar Inc.	301.840	0,27
14.509	Melrose Industries plc	29.869	0,02	12.402	Cisco Systems Inc.	648.315	0,59
5.644	Morgan Advanced Materials plc	19.749	0,02	2.151	CME Group Inc.	411.960	0,37
1.513	Morgan Sindall plc	31.616	0,03	789	Coca Cola Company	48.942	0,04
				12.665	Comcast Corp.	480.129	0,43
				2.933	Conocophillips	290.983	0,27
				4.423	DuPont de Nemours Inc.	317.439	0,29
				8.054	Ebay Inc.	357.356	0,33
				4.074	Edison International	287.584	0,26
				124	Elevance Health Inc.	57.016	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)			
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
2.264	Eli Lilly & Company	777.502	0,71	2.678	Warner Bros Discovery Inc.	40.438	0,04
5.077	Equity Lifestyle Properties Inc.	340.819	0,31	6.526	Xcel Energy Inc.	440.113	0,40
8.843	Exxon Mobil Corp.	969.723	0,88				
20.376	Gen Digital Inc.	349.652	0,32		Total de Estados Unidos	28.055.054	25,64
1.615	General Motors Company	59.238	0,05		Total de renta variable	49.250.107	44,97
878	Goldman Sachs Group Inc.	287.203	0,26		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	100.772.813	91,99
2.296	Hess Corp.	303.853	0,28				
703	IntercontinentalExchange Inc.	73.316	0,07		Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		
2.421	JPMorgan Chase & Company	315.481	0,29				
2.347	KLA Corp.	936.852	0,85		Bonos		
7.455	Kontoor Brands Inc.	360.748	0,33		ESTADOS UNIDOS		
2.258	Lamb Weston Holding Inc.	236.006	0,22		USD 23.000	Atlantic City Electric 2.30% 15/03/2031	19.442 0,02
1.518	Lowe's Companies Inc.	303.554	0,28		USD 67.000	Broadcom Inc. 4.93% 15/05/2037	61.045 0,06
243	Marsh & McLennan Companies Inc.	40.472	0,04		USD 119.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	104.343 0,10
867	Mastercard Inc. - A	315.076	0,29		USD 100.000	GE HealthCare Technologies Inc. 5.86% 15/03/2030	104.742 0,10
163	McDonald's Corp.	45.576	0,04		USD 34.000	HCA Inc. 3.63% 15/03/2032	29.992 0,03
7.458	Merck & Company Inc.	793.456	0,73		USD 25.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	28.068 0,03
8.724	Metlife Inc.	505.469	0,46		USD 30.000	Verizon Communications Inc. 2.36% 15/03/2032	24.661 0,02
7.303	Microsoft Corp.	2.105.455	1,92			Total de Estados Unidos	372.293 0,36
5.151	Moelis & Company - A	198.004	0,18		Total de bonos	372.293 0,36	
6.619	Morgan Stanley	581.149	0,54			Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda	
3.403	Northern Trust Corp.	299.906	0,27			CHINA	
2.907	PepsiCo Inc.	529.947	0,49		CNY 470.000	China (Govt of) 2.85% 04/06/2027	69.147 0,06
8.160	Philip Morris International Inc.	793.560	0,73		CNY 2.550.000	China (Govt of) 3.02% 27/05/2031	375.880 0,34
352	PNC Financial Services Group Inc.	44.739	0,04			Total de China	445.027 0,40
6.260	Procter & Gamble Company	930.800	0,84				
5.319	Prologis Inc.	663.651	0,61				
222	QUALCOMM Inc.	28.323	0,03				
318	Quest Diagnostics Inc.	44.991	0,04				
6.485	Raytheon Technologies Corp.	635.076	0,58				
4.711	Republic Services Inc.	637.021	0,58				
5.257	Starbucks Corp.	547.411	0,50				
825	State Street Corp.	62.444	0,06				
1.950	Target Corp.	322.979	0,29				
3.372	Texas Instruments Inc.	627.226	0,57				
7.029	TJX Companies Inc.	550.792	0,51				
3.216	Union Pacific Corp.	647.252	0,59				
4.129	United Parcel Service Inc.	800.985	0,74				
3.100	Valero Energy Corp.	432.760	0,39				
5.009	Verizon Communications Inc.	194.800	0,18				
18.332	Vici Properties Inc.	597.990	0,55				
3.000	Virtu Financial Inc.	56.700	0,05				
4.077	Voya Financial Inc.	291.342	0,27				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)							
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Bonos (continuación)							
ESTADOS UNIDOS				REINO UNIDO							
USD	139.000	Federal National Mortgage Association 5.63% 15/07/2037	162.227	0,15	GBP	235.000	Bellis Acquisition Company plc 3.25% 16/02/2026	238.974	0,23		
Total de Estados Unidos			162.227	0,15	GBP	205.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	237.845	0,22		
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			607.254	0,55	Total de Reino Unido			476.819	0,45		
Bonos - convertibles				ESTADOS UNIDOS							
CANADÁ				USD				75.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.27% 15/05/2047	63.345	0,06
USD	121.000	Air Canada 4.00% 01/07/2025	143.012	0,13	Total de Estados Unidos			63.345	0,06		
Total de Canadá			143.012	0,13	Total de bonos			721.026	0,67		
Total de bonos - convertibles			143.012	0,13	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			721.026	0,67		
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				1.122.559	1,04	Otros organismos de inversión colectiva					
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				Fondos							
Bonos				REINO UNIDO							
AUSTRALIA				66.280				CT Emerging Market Local Fund***	189.634	0,17	
USD	35.000	APA Infrastructure Limited 4.25% 15/07/2027	33.891	0,03	Total de Reino Unido			189.634	0,17		
Total de Australia			33.891	0,03	Total de fondos			189.634	0,17		
BERMUDAS			Total de otros organismos de inversión colectiva				189.634	0,17			
USD	100.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	99.392	0,09	Valor total de las inversiones			102.806.032	93,87		
Total de Bermudas			99.392	0,09	(Coste total: 101.827.337 USD)						
				* Diferencias menores debido al redondeo.							
				** Título a su valor razonable.							
				*** Fondo de parte vinculada.							
CANADÁ											
CAD	50.000	Rogers Communications Inc. 3.65% 31/03/2027	35.628	0,03							
Total de Canadá			35.628	0,03							
PORTUGAL											
EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	11.951	0,01							
Total de Portugal			11.951	0,01							

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

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				GRECIA (continuación)			
22.644	B3 SA Brasil Bolsa Balcao	46.224	0,90	1.314	Jumbo SA	27.838	0,54
16.145	Itau Unibanco Holding SA - ADR	78.626	1,53	Total de Grecia		64.159	1,25
11.218	Localiza Rent a Car SA	118.148	2,30	HONG KONG			
12.019	Sendas Distribuidora SA	36.838	0,72	2.400	AIA Group Limited	25.269	0,49
7.406	Weg SA	59.230	1,15	700	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	31.050	0,60
Total de Brasil		339.066	6,60	976	Techtronic Industries Company	10.550	0,21
ISLAS CAIMÁN				Total de Hong Kong		66.869	1,30
535	Afy Limited	5.971	0,12	INDIA			
2.216	JD.com Inc. - ADR	97.260	1,89	2.063	Apollo Hospitals Enterprise Limited	108.215	2,11
4.286	JD.com Inc.	93.910	1,83	2.270	Astral Limited	36.930	0,72
10.088	Kingdee International Software Group Company Limited	16.346	0,32	7.749	AU Small Finance Bank Limited	54.613	1,06
10.110	Meituan	184.814	3,60	7.594	Cholamandalam Investment and Finance Company Limited	70.347	1,37
915	PDD Holdings Inc.	69.449	1,35	2.637	HDFC Bank Limited - ADR	175.809	3,42
2.400	Shenzhou International Group Holdings Limited	25.192	0,49	7.647	ICICI Bank Limited - ADR	165.022	3,21
7.100	Tencent Holdings Limited	348.941	6,80	2.813	Infosys Limited - ADR	49.059	0,95
3.000	Wuxi Biologics Cayman Inc.	18.573	0,36	17.328	Max Healthcare Institute Limited	93.005	1,81
Total de Islas Caimán		860.456	16,76	2.697	Reliance Industries Limited	76.498	1,49
CHINA				Total de India		829.498	16,14
1.138	Bafang Electric Suzhou Company Limited	17.546	0,34	INDONESIA			
34.200	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	145.022	2,82	109.700	Bank BTPN Syariah Tbk PT	16.022	0,31
11.300	Midea Group Company Limited - A	88.543	1,72	267.200	Bank Central Asia Tbk PT	155.921	3,04
2.400	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited	108.937	2,12	649.036	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	204.735	3,99
35.800	Songcheng Performance Development Company Limited	84.818	1,65	Total de Indonesia		376.678	7,34
20.900	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	78.368	1,53	JERSEY - ISLAS DEL CANAL			
Total de China		523.234	10,18	414	WNS Holdings Limited - ADR	38.572	0,75
CHIPRE				Total de Jersey - Islas del Canal		38.572	0,75
1.129	Ozon Holdings plc**	0	0,00	KAZAJISTÁN			
545	TCS Group Holding plc - Reg**	0	0,00	625	Kaspi.KZ JSC	47.188	0,92
Total de Chipre		0	0,00	Total de Kazajistán		47.188	0,92
GRECIA				LUXEMBURGO			
27.470	Eurobank Ergasias Services and Holdings SA	36.321	0,71	196	Globant SA	32.146	0,63
				Total de Luxemburgo		32.146	0,63

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)				Renta variable (continuación)			
MÉXICO				ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)			
10.905	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	91.740	1,79	12.165	Fix Price Group Limited**	0	0,00
21.245	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	84.751	1,65	Total de Islas Vírgenes (Británicas)		0	0,00
Total de México		176.491	3,44	Total de renta variable		4.832.155	94,08
REPÚBLICA DE COREA (SUR)				Derechos			
742	Hana Financial Group Inc.	23.197	0,45	BRASIL			
64	Samsung Biologics Company Limited	38.739	0,75	50	Localiza Rent a Car SA Right	129	0,00
602	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	70.612	1,37	Total de Brasil		129	0,00
5.697	Samsung Electronics Company Limited	280.070	5,45	Total de derechos		129	0,00
189	Samsung Sdi Company Limited	106.706	2,08	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		4.832.284	94,08
979	SK Hynix Inc.	66.628	1,30	Valor total de las inversiones		4.832.284	94,08
Total de República de Corea (Sur)		585.952	11,40	(Coste total: 5.440.926 USD)			
SUDÁFRICA				<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>			
4.303	Absa Group Limited	44.086	0,86	<i>** Título a su valor razonable.</i>			
807	Capitec Bank Holdings Limited	76.763	1,50				
6.081	Shoprite Holdings Limited	76.177	1,48				
Total de Sudáfrica		197.026	3,84				
TAIWÁN							
6.475	Advantech Company Limited	78.896	1,54				
11.000	Delta Electronics Inc.	108.743	2,12				
4.094	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited - ADR	380.824	7,41				
Total de Taiwán		568.463	11,07				
TAILANDIA							
12.200	Kasikornbank plc	47.273	0,92				
Total de Tailandia		47.273	0,92				
ESTADOS UNIDOS							
60	Mercadolibre Inc.	79.084	1,54				
Total de Estados Unidos		79.084	1,54				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

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)			
268.384	Waste Connections Inc.	37.324.163	2,00	213.600	Sony Group Corp.	19.235.068	1,03
	Total de Canadá	37.324.163	2,00		Total de Japón	152.061.151	8,17
DINAMARCA				SINGAPUR			
118.512	Novo Nordisk AS	18.767.511	1,01	682.200	DBS Group Holdings Limited	16.932.492	0,91
	Total de Dinamarca	18.767.511	1,01		Total de Singapur	16.932.492	0,91
FRANCIA				SUIZA			
306.535	Legrand SA	28.001.579	1,50	127.417	Lonza Group AG - Reg	76.348.395	4,10
65.362	L'Oreal SA	29.203.909	1,57	302.050	Nestle SA - Reg	36.852.386	1,98
42.113	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	38.634.398	2,08		Total de Suiza	113.200.781	6,08
350.276	Schneider Electric SE	58.484.055	3,15				
	Total de Francia	154.323.941	8,30	TAIWÁN			
HONG KONG				2.432.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	42.572.936	2,29
2.430.800	AIA Group Limited	25.593.166	1,37		Total de Taiwán	42.572.936	2,29
	Total de Hong Kong	25.593.166	1,37	REINO UNIDO			
INDIA				741.930	Compass Group plc	18.649.916	1,00
4.490.784	HDFC Bank Limited	87.952.024	4,73	975.319	Diageo plc	43.582.425	2,34
1.711.474	Kotak Mahindra Bank Limited	36.086.975	1,94		Total de Reino Unido	62.232.341	3,34
	Total de India	124.038.999	6,67	ESTADOS UNIDOS			
INDONESIA				405.255	Alphabet Inc. - A	42.037.101	2,26
33.630.700	Bank Central Asia Tbk PT	19.624.775	1,05	233.762	Amphenol Corp.	19.103.031	1,03
60.469.600	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	19.074.754	1,02	687.569	Coca Cola Company	42.649.905	2,29
	Total de Indonesia	38.699.529	2,07	37.214	Costco Wholesale Corp.	18.490.520	0,99
IRLANDA				136.062	Danaher Corp.	34.293.066	1,84
266.775	Linde plc	94.822.506	5,09	80.078	Elevance Health Inc.	36.820.665	1,98
	Total de Irlanda	94.822.506	5,09	81.037	Eli Lilly & Company	27.829.727	1,49
JAPÓN				66.411	Hess Corp.	8.788.832	0,47
215.400	Hoya Corp.	23.564.677	1,27	169.066	Hilton Worldwide Holdings Inc.	23.816.327	1,28
115.612	Keyence Corp.	55.986.106	3,01	309.475	IntercontinentalExchange Inc.	32.275.148	1,73
1.160.100	Recruit Holdings Company Limited	31.815.791	1,71	111.604	Intuit Inc.	49.756.411	2,67
40.900	SMC Corp.	21.459.509	1,15	93.759	Lam Research Corp.	49.703.521	2,67
				222.910	Marsh & McLennan Companies Inc.	37.125.661	2,00
				439.719	Marvell Technology Inc.	19.039.833	1,02
				274.086	Mastercard Inc. - A	99.605.593	5,36
				12.708	Mettler-Toledo International Inc.	19.445.909	1,04
				539.239	Microsoft Corp.	155.462.603	8,36

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)

89.886	NVIDIA Corp.	24.967.634	1,34
244.156	ON Semiconductor Corp.	20.098.922	1,08
144.850	QUALCOMM Inc.	18.479.963	0,99
129.149	Thermo Fisher Scientific Inc.	74.437.609	4,00
223.821	T-Mobile USA Inc.	32.418.234	1,74
88.015	Union Pacific Corp.	17.713.899	0,95
212.107	Zoetis Inc.	35.303.089	1,90

Total de Estados Unidos	939.663.203	50,48
--------------------------------	--------------------	--------------

Total de renta variable	1.820.232.719	97,78
--------------------------------	----------------------	--------------

Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	1.820.232.719	97,78
---	----------------------	--------------

Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios

Fondos

IRLANDA

33.597.075	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	33.597.075	1,80
------------	---	------------	------

Total de Irlanda	33.597.075	1,80
-------------------------	-------------------	-------------

Total de fondos	33.597.075	1,80
------------------------	-------------------	-------------

Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	33.597.075	1,80
--	-------------------	-------------

Valor total de las inversiones	1.853.829.794	99,58
---------------------------------------	----------------------	--------------

(Coste total: 1.698.866.084 USD)

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
Renta variable			
BRASIL			
1.562.294	B3 SA Brasil Bolsa Balcao	3.189.142	0,90
542.341	Banco BTG Pactual SA	2.101.870	0,59
149.691	Banco do Brasil SA	1.154.660	0,33
1.112.908	Itau Unibanco Holding SA - ADR	5.419.862	1,53
541.534	Localiza Rent a Car SA	5.703.452	1,61
747.199	Petro Rio SA	4.596.449	1,30
1.122.219	Sendas Distribuidora SA	3.439.532	0,97
244.783	Weg SA	1.957.685	0,55
Total de Brasil		27.562.652	7,78
CANADÁ			
177.889	Parex Resources Inc.	3.304.488	0,93
Total de Canadá		3.304.488	0,93
ISLAS CAIMÁN			
19.390	Afya Limited	216.392	0,06
305.030	Full Truck Alliance Company Limited	2.321.278	0,66
120.857	JD.com Inc.	2.648.087	0,75
156.512	JD.com Inc. - ADR	6.869.312	1,94
857.000	Kingdee International Software Group Company Limited	1.388.673	0,39
239.800	Kuaishou Technology	1.846.619	0,52
751.000	Li Ning Company Limited	5.921.921	1,67
539.720	Meituan	9.866.255	2,79
445.470	NetEase Inc.	7.831.221	2,21
64.285	PDD Holdings Inc.	4.879.232	1,38
171.600	Shenzhou International Group Holdings Limited	1.801.260	0,51
499.700	Tencent Holdings Limited	24.558.593	6,94
224.000	Wuxi Biologics Cayman Inc.	1.386.808	0,39
Total de Islas Caimán		71.535.651	20,21
CHINA			
264.400	Alibaba Group Holding Limited	3.381.638	0,96
51.454	Bafang Electric Suzhou Company Limited	793.320	0,22
332.200	Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Company Limited - A	1.619.572	0,46
188.800	China Tourism Group Duty Free Corp. Limited	5.037.758	1,42
74.700	Eastroc Beverage Group Company Limited	2.092.971	0,59
1.018.400	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	4.318.419	1,22
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)			
CHINA (continuación)			
490.000	Midea Group Company Limited - A	3.839.495	1,09
113.500	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited	5.151.832	1,46
1.853.200	Songcheng Performance Development Company Limited	4.390.610	1,24
959.400	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	3.597.427	1,02
Total de China		34.223.042	9,68
CHIPRE			
31.029	Ozon Holdings plc**	0	0,00
12.232	TCS Group Holding plc - Reg**	0	0,00
Total de Chipre		0	0,00
GRECIA			
1.570.968	Eurobank Ergasias Services and Holdings SA	2.077.149	0,59
467.973	National Bank of Greece SA	2.272.679	0,64
Total de Grecia		4.349.828	1,23
HONG KONG			
174.400	AIA Group Limited	1.836.205	0,52
34.500	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	1.530.311	0,43
77.500	Techtronic Industries Company	837.694	0,24
Total de Hong Kong		4.204.210	1,19
INDIA			
96.264	Apollo Hospitals Enterprise Limited	5.049.531	1,43
326.704	AU Small Finance Bank Limited	2.302.514	0,65
492.572	Cholamandalam Investment and Finance Company Limited	4.562.940	1,30
92.540	Eicher Motors Limited	3.320.484	0,94
193.900	HDFC Bank Limited - ADR	12.927.312	3,65
569.062	ICICI Bank Limited - ADR	12.280.357	3,47
242.183	Larsen & Toubro Limited	6.377.644	1,80
230.626	Mahindra & Mahindra Limited	3.251.610	0,92
185.522	Reliance Industries Limited	5.262.186	1,49
Total de India		55.334.578	15,65
INDONESIA			
9.280.100	Astra International Tbk PT	3.713.339	1,05
15.389.200	Bank BTPN Syariah Tbk PT	2.247.610	0,64

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)			
INDONESIA (continuación)				POLONIA			
16.867.300	Bank Central Asia Tbk PT	9.842.702	2,78	37.219	Dino Polska SA	3.378.878	0,96
32.437.166	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	10.232.100	2,89	Total de Polonia		3.378.878	0,96
Total de Indonesia		26.035.751	7,36	REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
JERSEY - ISLAS DEL CANAL				52.283	Hana Financial Group Inc.	1.634.539	0,46
19.385	WNS Holdings Limited - ADR	1.806.100	0,51	2.938	Samsung Biologics Company Limited	1.778.355	0,50
Total de Jersey - Islas del Canal		1.806.100	0,51	41.984	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	4.924.512	1,39
KAZAJISTÁN				414.441	Samsung Electronics Company Limited	20.374.317	5,76
21.388	Kaspi.KZ JSC	1.614.794	0,46	8.394	Samsung Sdi Company Limited	4.739.109	1,34
Total de Kazajistán		1.614.794	0,46	69.138	SK Hynix Inc.	4.705.339	1,33
LUXEMBURGO				Total de República de Corea (Sur)		38.156.171	10,78
13.715	Globant SA	2.249.398	0,64	SUDÁFRICA			
Total de Luxemburgo		2.249.398	0,64	303.032	Absa Group Limited	3.104.710	0,88
MALASIA				32.605	Capitec Bank Holdings Limited	3.101.439	0,88
1.228.000	Public Bank Bhd	1.113.202	0,31	188.911	Shoprite Holdings Limited	2.366.492	0,67
Total de Malasia		1.113.202	0,31	Total de Sudáfrica		8.572.641	2,43
MÉXICO				TAIWÁN			
119.381	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV - B	2.318.120	0,66	443.000	Delta Electronics Inc.	4.379.384	1,24
778.964	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	6.553.173	1,85	287.770	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited - ADR	26.768.366	7,57
1.093.027	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	4.360.344	1,23	Total de Taiwán		31.147.750	8,81
Total de México		13.231.637	3,74	TAILANDIA			
PAÍSES BAJOS				845.900	Kasikornbank plc	3.277.719	0,93
33.179	Yandex NV - A**	0	0,00	Total de Tailandia		3.277.719	0,93
Total de Países Bajos		0	0,00	ESTADOS UNIDOS			
FILIPINAS				163.012	Coupang Inc.	2.608.192	0,74
2.364.500	Ayala Land Inc.	1.152.554	0,33	4.259	Mercadolibre Inc.	5.613.618	1,59
695.860	BDO Unibank Inc.	1.644.755	0,47	Total de Estados Unidos		8.221.810	2,33
Total de Filipinas		2.797.309	0,80	ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)			
				223.974	Fix Price Group Limited**	0	0,00
				Total de Islas Vírgenes (Británicas)		0	0,00
				Total de renta variable		342.117.609	96,73

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			
2.423	Localiza Rent a Car SA Right	6.275	0,00
	Total de Brasil	6.275	0,00
	Total de derechos	6.275	0,00
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	342.123.884	96,73
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
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 otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	0	0,00
	Valor total de las inversiones	342.123.884	96,73
(Coste total: 349.263.838 USD)			

* Diferencias menores debido al redondeo.

** Título a su valor razonable.

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

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)			
597.016	Telstra Corp. Limited	1.687.373	1,00	39.900	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	1.769.838	1,05
	Total de Australia	1.687.373	1,00		Total de Hong Kong	4.374.638	2,59
CANADÁ				IRLANDA			
19.709	Canadian National Railway Company	2.322.380	1,38	29.585	CRH plc	1.493.828	0,89
87.953	Suncor Energy Inc.	2.726.942	1,62	100.895	Experian plc	3.318.393	1,97
	Total de Canadá	5.049.322	3,00	7.593	Linde plc	2.698.856	1,60
				30.886	Medtronic plc	2.490.029	1,48
ISLAS CAIMÁN					Total de Irlanda	10.001.106	5,94
20.487	NetEase Inc. - ADR	1.811.870	1,08	JAPÓN			
	Total de Islas Caimán	1.811.870	1,08	20.200	Rohm Company Limited	1.664.993	0,99
CHINA				4.400	SMC Corp.	2.308.602	1,37
278.292	Ping An Insurance Group Company of China Limited	1.811.563	1,08	8.100	Tokyo Electron Limited	976.211	0,58
	Total de China	1.811.563	1,08	755.600	Z Holdings Corp.	2.116.520	1,26
DINAMARCA					Total de Japón	7.066.326	4,20
54.473	Tryg A/S	1.190.906	0,71	JERSEY - ISLAS DEL CANAL			
	Total de Dinamarca	1.190.906	0,71	86.397	WPP plc	1.024.030	0,61
FRANCIA					Total de Jersey - Islas del Canal	1.024.030	0,61
41.692	AXA SA	1.275.770	0,76	PAÍSES BAJOS			
47.507	BNP Paribas SA	2.849.608	1,69	26.662	Akzo Nobel NV	2.085.040	1,24
2.469	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	2.265.057	1,35		Total de Países Bajos	2.085.040	1,24
13.968	Schneider Electric SE	2.332.176	1,38	NORUEGA			
65.533	TotalEnergies SE	3.870.341	2,30	56.796	Equinor ASA	1.619.866	0,96
	Total de Francia	12.592.952	7,48		Total de Noruega	1.619.866	0,96
ALEMANIA				REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
157.154	Deutsche Telekom AG - Reg	3.816.039	2,27	86.399	Samsung Electronics Company Limited	4.247.458	2,51
197.536	E.ON SE	2.468.049	1,47		Total de República de Corea (Sur)	4.247.458	2,51
80.910	Evonik Industries AG	1.701.834	1,01	ESPAÑA			
25.452	SAP SE	3.209.329	1,91	62.297	Inditex SA	2.091.392	1,24
25.715	Siemens AG - Reg	4.170.035	2,48		Total de España	2.091.392	1,24
	Total de Alemania	15.365.286	9,14	SUECIA			
HONG KONG				77.692	Sandvik AB	1.646.809	0,98
247.400	AIA Group Limited	2.604.800	1,54		Total de Suecia	1.646.809	0,98

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)			
SUIZA				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
31.223	Novartis AG - Reg	2.862.721	1,70	42.171	State Street Corp.	3.191.923	1,89
9.144	TE Connectivity Limited	1.199.236	0,71	9.772	Target Corp.	1.618.536	0,96
	Total de Suiza	4.061.957	2,41	9.532	United Parcel Service Inc.	1.849.113	1,10
				42.343	Xcel Energy Inc.	2.855.612	1,69
TAIWÁN				Total de Estados Unidos		64.436.308	38,27
62.000	MediaTek Inc.	1.602.541	0,95	Total de renta variable		165.565.286	98,32
215.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	3.763.644	2,23	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		165.565.286	98,32
	Total de Taiwán	5.366.185	3,18	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
REINO UNIDO				Fondos			
111.793	3i Group plc	2.329.116	1,38	IRLANDA			
92.606	Anglo American plc	3.066.382	1,82	2.037.234	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.037.234	1,21
1.624.999	BT Group plc	2.929.457	1,74	Total de Irlanda		2.037.234	1,21
38.991	Diageo plc	1.742.325	1,03	Total de fondos		2.037.234	1,21
111.543	GSK plc	1.970.839	1,17	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		2.037.234	1,21
227.550	Haleon plc	905.961	0,54	Valor total de las inversiones		167.602.520	99,53
43.415	Reckitt Benckiser Group plc	3.305.644	1,96	(Coste total: 159.617.831 USD)			
55.157	RELX plc	1.785.175	1,06	<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>			
	Total de Reino Unido	18.034.899	10,70				
ESTADOS UNIDOS							
20.813	AbbVie Inc.	3.316.968	1,97				
29.481	American Electric Power Company Inc.	2.682.476	1,59				
8.416	American Express Company	1.388.219	0,82				
11.064	Analog Devices Inc.	2.182.042	1,30				
49.338	Bristol-Myers Squibb Company	3.419.616	2,03				
39.764	Coca Cola Company	2.466.561	1,47				
57.093	Ebay Inc.	2.533.216	1,50				
6.301	Elevance Health Inc.	2.897.262	1,72				
7.942	Eli Lilly & Company	2.727.442	1,62				
81.635	General Motors Company	2.994.372	1,78				
35.525	IntercontinentalExchange Inc.	3.704.903	2,21				
12.434	Marsh & McLennan Companies Inc.	2.070.883	1,23				
8.326	McDonald's Corp.	2.328.033	1,39				
29.709	Microsoft Corp.	8.565.105	5,08				
13.481	PepsiCo Inc.	2.457.586	1,46				
15.581	PNC Financial Services Group Inc.	1.980.345	1,18				
23.003	Procter & Gamble Company	3.420.316	2,03				
11.294	QUALCOMM Inc.	1.440.889	0,86				
16.574	Quest Diagnostics Inc.	2.344.890	1,39				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Select

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

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 (continuación)			
27.541	CSL Limited	5.317.862	0,93	27.388	Linde plc	9.734.791	1,70
	Total de Australia	5.317.862	0,93		Total de Irlanda	14.663.440	2,56
CANADÁ				JAPÓN			
64.965	Nutrien Limited	4.791.189	0,84	16.900	Keyence Corp.	8.183.971	1,43
	Total de Canadá	4.791.189	0,84	122.400	Recruit Holdings Company Limited	3.356.825	0,59
DINAMARCA				63.900	Sony Group Corp.	5.754.311	1,00
43.410	Novo Nordisk AS	6.874.390	1,20		Total de Japón	17.295.107	3,02
77.273	Orsted A/S	6.574.893	1,15	PAÍSES BAJOS			
	Total de Dinamarca	13.449.283	2,35	54.912	Akzo Nobel NV	4.294.265	0,75
FRANCIA				37.663	Koninklijke DSM NV	4.447.892	0,78
192.403	AXA SA	5.887.506	1,03		Total de Países Bajos	8.742.157	1,53
32.403	EssilorLuxottica SA	5.843.904	1,02	NORUEGA			
17.196	L'Oreal SA	7.683.217	1,34	238.971	Equinor ASA	6.815.637	1,19
6.914	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	6.342.893	1,11		Total de Noruega	6.815.637	1,19
50.484	Schneider Electric SE	8.429.093	1,47	REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
290.809	TotalEnergies SE	17.175.012	2,99	12.736	Samsung Sdi Company Limited	7.190.528	1,26
	Total de Francia	51.361.625	8,96		Total de República de Corea (Sur)	7.190.528	1,26
ALEMANIA				SINGAPUR			
24.025	Adidas AG	4.248.877	0,74	328.900	DBS Group Holdings Limited	8.163.437	1,43
	Total de Alemania	4.248.877	0,74		Total de Singapur	8.163.437	1,43
HONG KONG				SUIZA			
760.600	AIA Group Limited	8.008.130	1,40	9.648	Lonza Group AG - Reg	5.781.091	1,01
	Total de Hong Kong	8.008.130	1,40	89.945	Nestle SA - Reg	10.973.971	1,92
INDIA					Total de Suiza	16.755.062	2,93
599.482	HDFC Bank Limited	11.740.857	2,05	TAIWÁN			
226.120	Kotak Mahindra Bank Limited	4.767.812	0,83	770.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	13.479.095	2,35
	Total de India	16.508.669	2,88		Total de Taiwán	13.479.095	2,35
INDONESIA				REINO UNIDO			
27.351.774	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	8.627.945	1,51	139.798	Anglo American plc	4.629.010	0,81
	Total de Indonesia	8.627.945	1,51	159.926	Diageo plc	7.146.342	1,25
IRLANDA				278.081	Shell plc	7.937.391	1,39
97.611	CRH plc	4.928.649	0,86				

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			
REINO UNIDO (continuación)				IRLANDA			
168.684	SSE plc	3.760.505	0,66	14.622.250	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	14.622.250	2,55
Total de Reino Unido		23.473.248	4,11	Total de Irlanda		14.622.250	2,55
ESTADOS UNIDOS				Total de fondos		14.622.250	2,55
53.562	Abbott Laboratories	5.423.688	0,95	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		14.622.250	2,55
19.908	Adobe Inc.	7.671.946	1,34	Valor total de las inversiones		581.342.531	101,50
57.522	Advanced Micro Devices Inc.	5.637.731	0,98	(Coste total: 533.797.154 USD)			
233.759	Alphabet Inc. - A	24.247.821	4,23	<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>			
202.645	Amazon.com Inc.	20.931.201	3,65				
24.815	Autodesk Inc.	5.165.490	0,90				
17.172	Cooper Companies Inc.	6.411.338	1,12				
30.150	CrowdStrike Holdings Inc. - A	4.138.389	0,72				
12.933	Deere & Company	5.339.777	0,93				
59.380	Ecolab Inc.	9.829.171	1,71				
67.079	Electronic Arts Inc.	8.079.666	1,41				
15.907	Elevance Health Inc.	7.314.198	1,28				
33.490	Eli Lilly & Company	11.501.136	2,01				
7.924	Equinix Inc.	5.713.521	1,00				
56.676	IntercontinentalExchange Inc.	5.910.740	1,03				
28.507	Intuit Inc.	12.709.276	2,22				
95.399	JPMorgan Chase & Company	12.431.443	2,16				
17.180	Lam Research Corp.	9.107.462	1,59				
51.335	Mastercard Inc. - A	18.655.652	3,26				
5.404	Mercadolibre Inc.	7.122.796	1,24				
102.048	Micron Technology Inc.	6.157.576	1,08				
113.826	Microsoft Corp.	32.816.035	5,72				
96.013	NextEra Energy Inc.	7.400.683	1,29				
29.806	NVIDIA Corp.	8.279.213	1,45				
72.536	ON Semiconductor Corp.	5.971.164	1,04				
56.991	Paypal Holdings Inc.	4.327.897	0,76				
53.940	PepsiCo Inc.	9.833.262	1,71				
75.828	QUALCOMM Inc.	9.674.135	1,69				
21.792	Stryker Corp.	6.220.962	1,09				
15.950	Thermo Fisher Scientific Inc.	9.193.101	1,61				
115.502	T-Mobile USA Inc.	16.729.310	2,92				
111.687	Trimble Inc.	5.854.633	1,02				
246.713	Uber Technologies Inc.	7.820.802	1,37				
39.781	Union Pacific Corp.	8.006.324	1,40				
61.934	Walt Disney Company	6.201.451	1,08				
Total de Estados Unidos		337.828.990	58,96				
Total de renta variable		566.720.281	98,95				
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		566.720.281	98,95				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

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)			
173.340	Azelis Group NV	4.049.222	0,24	332.500	Mani Inc.	4.152.925	0,25
1.562	Lotus Bakeries NV	10.074.900	0,60	750.440	Shoei Company Limited	14.396.838	0,85
	Total de Bélgica	14.124.122	0,84	1.177.000	SMS Company Limited	26.007.105	1,54
CANADÁ				446.710	Square Enix Holdings Company Limited	19.648.413	1,16
262.597	Cargojet Inc.	19.661.546	1,17		Total de Japón	128.087.411	7,60
	Total de Canadá	19.661.546	1,17	PAÍSES BAJOS			
DINAMARCA				339.511	BE Semiconductor Industries NV	27.194.831	1,61
1.530.665	ALK-Abello AS	21.801.196	1,29	173.267	IMCD NV	26.059.357	1,55
	Total de Dinamarca	21.801.196	1,29		Total de Países Bajos	53.254.188	3,16
FINLANDIA				ESPAÑA			
283.948	Revenio Group Oyj	10.971.751	0,65	847.223	Fluidra SA	13.716.540	0,81
	Total de Finlandia	10.971.751	0,65		Total de España	13.716.540	0,81
FRANCIA				SUECIA			
325.266	Lectra	11.823.419	0,70	2.892.838	Fortnox AB	18.210.517	1,08
169.043	Remy Cointreau SA	28.399.224	1,68	576.923	Hemnet Group AB	8.941.112	0,53
	Total de Francia	40.222.643	2,38	367.751	MIPS AB	17.091.609	1,01
ALEMANIA				771.711	Nordnet AB publ	11.696.202	0,69
499.674	CTS Eventim AG & Company KGaA	28.706.271	1,71	722.214	Thule Group AB	16.327.673	0,97
521.346	Nemetschek SE	32.990.775	1,96		Total de Suecia	72.267.113	4,28
26.022	Rational AG	16.055.574	0,95	SUIZA			
76.043	STRATEC SE	4.760.292	0,28	44.702	Belimo Holding AG	19.862.026	1,18
	Total de Alemania	82.512.912	4,90	22.462	Inficon Holding AG	22.336.935	1,32
ITALIA				4.362	LEM Holding SA	8.640.267	0,51
199.463	Diasorin SpA	19.359.879	1,15	1.141.414	SIG Group AG	27.048.209	1,60
753.168	Stevanato Group SpA	17.954.854	1,06	159.849	SKAN Group AG	13.480.108	0,80
1.941.852	Technoprobe SpA	12.948.269	0,77	59.108	Tecan Group AG - Reg	23.773.592	1,41
	Total de Italia	50.263.002	2,98	80.485	VAT Group AG	26.614.084	1,58
JAPÓN					Total de Suiza	141.755.221	8,40
459.200	Asahi Intecc Company Limited	7.380.447	0,44	REINO UNIDO			
531.900	Capcom Company Limited	17.417.855	1,03	1.604.445	Abcam plc	19.877.426	1,17
514.600	Daiseki Company Limited	14.929.541	0,89	1.414.269	Auction Technology Group plc	9.882.509	0,59
90.585	Disco Corp.	9.585.006	0,57	689.486	Future plc	9.094.435	0,54
498.200	Japan Elevator Service Holdings Company Limited	7.400.868	0,44	272.823	Games Workshop Group plc	29.931.248	1,77
211.535	Jtower Inc.	7.168.413	0,43	509.334	Genus plc	16.659.281	0,99
				485.619	Keywords Studios plc	15.242.519	0,90
				250.520	Renishaw plc	11.672.317	0,69

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)			
2.139.607	Watches of Switzerland Group plc	19.857.509	1,18	83.914	Visteon Corp.	12.113.059	0,72
				96.723	WD-40 Company	15.851.194	0,94
	Total de Reino Unido	132.217.244	7,83	496.455	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	21.421.888	1,27
				364.434	Workiva Inc.	34.351.959	2,04
ESTADOS UNIDOS				119.969	XPEL Inc.	7.503.239	0,44
330.513	AAON Inc.	29.414.424	1,74	224.776	YETI Holdings Inc.	8.275.613	0,49
438.499	Acushnet Holdings Corp.	20.559.749	1,22		Total de Estados Unidos	879.730.318	52,17
352.395	Advanced Drainage Systems Inc.	27.313.896	1,62		Total de renta variable	1.660.585.207	98,46
548.238	Altair Engineering Inc.	36.387.722	2,16		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	1.660.585.207	98,46
407.417	Armstrong World Industries Inc.	26.714.885	1,58	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
641.689	Avient Corp.	24.310.294	1,44	Fondos			
470.874	Blackline Inc.	29.103.216	1,73	IRLANDA			
264.881	Bruker Corp.	19.221.518	1,14	26.602.496	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	24.485.707	1,45
756.733	Certara Inc.	16.793.072	1,00		Total de Irlanda	24.485.707	1,45
308.066	Conmed Corp.	29.449.799	1,74		Total de fondos	24.485.707	1,45
322.355	Doximity Inc.	9.607.304	0,57		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	24.485.707	1,45
778.176	Flywire Corp.	21.029.267	1,25		Valor total de las inversiones	1.685.070.914	99,91
257.656	Forward Air Corp.	25.555.719	1,52		(Coste total: 1.703.395.198 EUR)		
324.650	Freshpet Inc.	19.778.714	1,17	<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>			
242.317	Hamilton Lane Inc.	16.500.171	0,98				
1.090.963	Hillman Solutions Corp.	8.454.976	0,50				
459.247	Intapp Inc.	18.954.057	1,12				
155.882	Kadant Inc.	29.918.095	1,78				
159.023	Lattice Semiconductor Corp.	13.978.275	0,83				
1.655.922	Leslie's Inc.	16.780.985	0,99				
1.415.172	Levi Strauss & Company	23.745.764	1,41				
89.661	Lincoln Electric Holdings Inc.	13.955.245	0,83				
602.797	Live Oak Bancshares Inc.	13.521.251	0,80				
172.838	MSA Safety Inc.	21.237.860	1,26				
1.253.399	Neogen Corp.	21.365.870	1,27				
95.506	Novanta Inc.	13.985.043	0,83				
238.662	Power Integrations Inc.	18.592.988	1,10				
282.431	Ryman Hospitality Properties Inc.	23.326.001	1,38				
263.300	Shift4 Payments Inc.	18.370.049	1,09				
234.044	Simpson Manufacturing Company Inc.	23.618.744	1,40				
150.533	SiteOne Landscape Supply Inc.	18.964.013	1,12				
210.186	SiTime Corp.	27.515.997	1,63				
134.326	Sps Commerce Inc.	18.829.997	1,12				
327.025	SPX Technologies Inc.	21.244.811	1,26				
226.279	TechTarget Inc.	7.522.847	0,45				
58.639	TopBuild Corp.	11.233.947	0,67				
289.022	Triumph Financial Inc	15.445.365	0,92				
1.792.221	Verra Mobility Corp.	27.911.436	1,65				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

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)			
252.441	Globalfoundries Inc.	18.221.191	1,72	225.942	QUALCOMM Inc.	28.825.681	2,72
	Total de Islas Caimán	18.221.191	1,72	83.473	Republic Services Inc.	11.287.219	1,07
CURAZAO				15.291	S&P Global Inc.	5.271.878	0,50
154.738	Schlumberger Limited	7.597.636	0,72	98.400	Salesforce Inc.	19.658.352	1,86
	Total de Curazao	7.597.636	0,72	65.688	Sherwin-Williams Company	14.764.692	1,40
SUIZA				167.556	Stanley Black & Decker Inc.	13.501.662	1,28
236.623	TE Connectivity Limited	31.033.106	2,93	442.203	State Street Corp.	33.470.345	3,17
	Total de Suiza	31.033.106	2,93	299.508	Take-Two Interactive Software Inc.	35.731.304	3,38
ESTADOS UNIDOS				77.779	Teradyne Inc.	8.362.020	0,79
161.246	Advanced Micro Devices Inc.	15.803.720	1,49	71.503	TransUnion	4.443.196	0,42
721.542	AES Corp.	17.374.731	1,64	177.902	Trimble Inc.	9.325.623	0,88
145.921	Alphabet Inc. - A	15.136.385	1,43	538.410	Uber Technologies Inc.	17.067.597	1,61
315.537	Amazon.com Inc.	32.591.817	3,08	46.243	Union Pacific Corp.	9.306.866	0,88
94.949	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	9.232.841	0,87	95.802	United Parcel Service Inc.	18.584.630	1,76
338.334	Bristol-Myers Squibb Company	23.449.929	2,21	63.571	Vertex Pharmaceuticals Inc.	20.029.314	1,89
36.356	Broadcom Inc.	23.323.829	2,20	398.029	Virtu Financial Inc.	7.522.748	0,71
113.542	Catalent Inc.	7.460.845	0,71	441.703	Voya Financial Inc.	31.564.096	2,98
16.834	Cigna Group	4.301.592	0,41	57.050	Walt Disney Company	5.712.417	0,54
31.184	Cintas Corp.	14.428.214	1,36	403.055	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	18.895.218	1,79
409.101	Coca Cola Company	25.376.535	2,40	39.971	Zebra Technologies Corp.	12.710.778	1,20
97.189	CrowdStrike Holdings Inc. - A	13.340.162	1,26		Total de Estados Unidos	954.610.311	90,23
232.751	Darling International Inc.	13.592.658	1,28	Total de renta variable		1.011.462.244	95,60
94.134	Doximity Inc.	3.048.059	0,29	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		1.011.462.244	95,60
151.739	Electronic Arts Inc.	18.276.963	1,73		Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		
56.166	Eli Lilly & Company	19.288.528	1,82		Fondos		
479.771	Endeavor Group Holdings Inc.	11.480.920	1,09		IRLANDA		
77.476	Exact Sciences Corp.	5.253.648	0,50	43.005.955	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	43.005.955	4,06
86.157	FMC Corp.	10.522.354	0,99		Total de Irlanda	43.005.955	4,06
29.895	Goldman Sachs Group Inc.	9.778.953	0,92	Total de fondos		43.005.955	4,06
78.255	Hess Corp.	10.356.267	0,98	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		43.005.955	4,06
294.316	Hilton Worldwide Holdings Inc.	41.460.295	3,92	Valor total de las inversiones		1.054.468.199	99,66
127.259	Howmet Aerospace Inc.	5.391.964	0,51	(Coste total: 1.001.157.212 USD)			
126.464	IntercontinentalExchange Inc.	13.188.931	1,25				
113.014	Intuitive Surgical Inc.	28.871.687	2,73				
239.150	Kellogg Company	16.013.484	1,52				
47.303	Lam Research Corp.	25.076.267	2,37				
100.697	Lamb Weston Holding Inc.	10.524.850	0,99				
440.188	Marvell Technology Inc.	19.060.141	1,80				
178.794	Microchip Technology Inc.	14.979.361	1,42				
152.548	Microsoft Corp.	43.979.588	4,15				
291.561	Northern Trust Corp.	25.695.271	2,43				
1.851.825	NOV Inc.	34.277.281	3,24				
167.608	Procter & Gamble Company	24.921.634	2,36				
174.040	Prologis Inc.	21.714.971	2,05				

* Diferencias menores debido al redondeo.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Select

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

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)			
42.257	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	2.378.647	0,71	285.521	Uber Technologies Inc.	9.051.016	2,69
	Total de Canadá	2.378.647	0,71	31.353	United Parcel Service Inc.	6.082.168	1,81
ISLAS CAIMÁN				60.171	Vertex Pharmaceuticals Inc.	18.958.076	5,63
85.942	Globalfoundries Inc.	6.203.294	1,84	18.381	Walt Disney Company	1.840.490	0,55
	Total de Islas Caimán	6.203.294	1,84	131.178	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	6.149.625	1,83
CURAZAO				11.807	Zebra Technologies Corp.	3.754.626	1,11
50.229	Schlumberger Limited	2.466.244	0,73		Total de Estados Unidos	319.657.085	94,92
	Total de Curazao	2.466.244	0,73		Total de renta variable	330.705.270	98,20
ESTADOS UNIDOS					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	330.705.270	98,20
89.835	Advanced Micro Devices Inc.	8.804.728	2,61		Valor total de las inversiones	330.705.270	98,20
248.820	AES Corp.	5.991.586	1,78		(Coste total: 323.485.629 USD)		
48.079	Alphabet Inc. - A	4.987.235	1,48				
96.755	Amazon.com Inc.	9.993.824	2,97				
38.337	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	3.727.890	1,11				
48.581	Catalent Inc.	3.192.258	0,95				
240.608	Coca Cola Company	14.924.914	4,43				
50.222	Crowdstrike Holdings Inc. - A	6.893.472	2,05				
65.917	Darling International Inc.	3.849.553	1,14				
77.493	Electronic Arts Inc.	9.334.032	2,77				
67.013	Exact Sciences Corp.	4.544.152	1,35				
9.612	Goldman Sachs Group Inc.	3.144.181	0,93				
24.957	Hess Corp.	3.302.809	0,98				
120.283	Hilton Worldwide Holdings Inc.	16.944.266	5,03				
54.662	Intuitive Surgical Inc.	13.964.501	4,15				
86.967	Kellogg Company	5.823.310	1,73				
187.062	Kontoor Brands Inc.	9.051.930	2,69				
35.994	Lam Research Corp.	19.081.138	5,67				
35.603	Lamb Weston Holding Inc.	3.721.226	1,11				
79.890	Marvell Technology Inc.	3.459.237	1,03				
54.315	Microsoft Corp.	15.659.014	4,64				
158.721	Northern Trust Corp.	13.988.082	4,15				
757.479	NOV Inc.	14.020.936	4,17				
75.167	Procter & Gamble Company	11.176.581	3,32				
56.120	Prologis Inc.	7.002.092	2,08				
110.141	QUALCOMM Inc.	14.051.789	4,17				
4.910	S&P Global Inc.	1.692.821	0,50				
99.067	Schnitzer Steel Industries Inc.	3.080.984	0,91				
21.150	Sherwin-Williams Company	4.753.886	1,41				
53.769	Stanley Black & Decker Inc.	4.332.706	1,29				
240.020	State Street Corp.	18.167.114	5,39				
35.226	Teradyne Inc.	3.787.147	1,12				
61.790	TransUnion	3.839.630	1,14				
67.380	Trimble Inc.	3.532.060	1,05				

* Diferencias menores debido al redondeo.

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*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
ESTADOS UNIDOS (continuación)			
206.834	Voya Financial Inc.	14.780.358	3,21
107.897	Westrock Company	3.287.622	0,71
285.598	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	13.388.834	2,91
42.136	Wingstop Inc.	7.735.327	1,68
407.409	Xponential Fitness Inc.	12.381.160	2,68
Total de Estados Unidos		422.602.137	91,62
Total de renta variable		454.967.310	98,65
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		457.443.463	99,19

Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios

Fondos

IRLANDA

2.289.664	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.289.664	0,50
Total de Irlanda		2.289.664	0,50
Total de fondos		2.289.664	0,50
Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		2.289.664	0,50
Valor total de las inversiones		459.733.127	99,69
(Coste total: 456.072.251 USD)			

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

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)			
21.473	Ancor plc	240.028	0,54	174.500	BOC Hong Kong Holdings Limited	543.508	1,23
65.459	ANZ Group Holdings Limited	1.005.278	2,27	126.400	Galaxy Entertainment Group Limited	844.548	1,90
4.159	CSL Limited	803.057	1,81	522.000	Guangdong Investment Limited	533.971	1,20
32.529	Goodman Group	409.365	0,92	24.221	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	1.074.368	2,42
3.809	Macquarie Group Limited	448.122	1,01	Total de Hong Kong		5.243.219	11,81
52.172	Newcrest Mining Limited	938.198	2,11				
11.726	Rio Tinto Limited	943.518	2,13				
143.371	Santos Limited	662.557	1,49				
149.344	Telstra Corp. Limited	422.098	0,95				
78.850	Transurban Group	750.427	1,69				
Total de Australia		6.622.648	14,92				
ISLAS CAIMÁN				INDIA			
182.000	China Mengniu Dairy Company Limited	746.551	1,68	39.414	HDFC Bank Limited	771.923	1,74
14.839	Hesai Group	229.559	0,52	32.252	Infosys Limited	560.388	1,26
78.638	JD.com Inc.	1.723.030	3,88	59.341	Reliance Industries Limited	1.683.161	3,80
52.870	Meituan	966.481	2,18	7.954	Tata Consultancy Services Limited	310.281	0,70
40.800	NetEase Inc.	717.251	1,62	37.370	UPL Limited	326.328	0,74
10.000	Parade Technologies Limited	344.852	0,78	Total de India		3.652.081	8,24
25.300	Shenzhou International Group Holdings Limited	265.570	0,60				
65.300	Sunny Optical Technology Group Company Limited	789.842	1,78				
32.900	Tencent Holdings Limited	1.616.926	3,64				
Total de Islas Caimán		7.400.062	16,68				
CHINA				INDONESIA			
184.516	Alibaba Group Holding Limited	2.359.933	5,33	499.600	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	332.350	0,75
18.000	BYD Company Limited	526.932	1,19	Total de Indonesia		332.350	0,75
3.486.600	China Construction Bank Corp.	2.260.747	5,09				
18.600	China Tourism Group Duty Free Corp. Limited	496.305	1,12				
102.100	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	432.944	0,98				
65.100	Midea Group Company Limited - A	510.104	1,15				
171.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	1.116.393	2,52				
17.100	Wuliangye Yibin Company Limited - A	490.543	1,11				
Total de China		8.193.901	18,49				
HONG KONG				REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
213.400	AIA Group Limited	2.246.824	5,06	3.005	Kia Corp.	186.969	0,42
				964	LG Chem Limited P.P. 144A	527.227	1,18
				5.067	Naver Corp.	786.217	1,77
				45.056	Samsung Electronics Company Limited	2.214.996	4,99
				704	Samsung Sdi Company Limited	397.466	0,90
				20.349	SK Hynix Inc.	1.384.896	3,12
				12.450	SK Telecom Company Limited	461.909	1,04
				Total de República de Corea (Sur)		5.959.680	13,42
				SINGAPUR			
				186.900	Singapore Telecommunications Limited	345.812	0,78
				23.200	United Overseas Bank Limited	519.297	1,17
				Total de Singapur		865.109	1,95
				TAIWÁN			
				219.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	3.833.665	8,65

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)			
36.000	Yageo Corp.	625.462	1,41
	Total de Taiwán	4.459.127	10,06
TAILANDIA			
52.500	Kasikornbank plc	203.429	0,46
	Total de Tailandia	203.429	0,46
	Total de renta variable	42.931.606	96,78
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	42.931.606	96,78
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
18.558	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	18.558	0,04
	Total de Irlanda	18.558	0,04
	Total de fondos	18.558	0,04
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	18.558	0,04
	Valor total de las inversiones	42.950.164	96,82
(Coste total: 41.862.008 USD)			

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Asia Equities

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

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			
165.677	ANZ Group Holdings Limited	2.544.363	2,17	406.400	AIA Group Limited	4.278.864	3,65
228.651	Chalice Mining Limited	1.147.011	0,98	432.000	BOC Hong Kong Holdings Limited	1.345.534	1,15
13.947	CSL Limited	2.693.012	2,30	384.000	Galaxy Entertainment Group Limited	2.565.717	2,19
733.851	Deterra Royalties Limited	2.359.184	2,01	39.337	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	1.744.865	1,49
121.316	IGO Limited	1.037.580	0,89	826.000	Lenovo Group Limited	894.398	0,76
20.118	Macquarie Group Limited	2.366.848	2,02	128.500	Sun Hung Kai Properties Limited	1.800.644	1,54
30.471	Mineral Resources Limited	1.644.677	1,40	41.661	Techtronic Industries Company	450.312	0,38
304.829	Santos Limited	1.408.699	1,20				
157.974	Transurban Group	1.503.462	1,28				
	Total de Australia	16.704.836	14,25		Total de Hong Kong	13.080.334	11,16
ISLAS CAIMÁN				INDIA			
385.000	China Mengniu Dairy Company Limited	1.579.242	1,35	157.652	Bharti Airtel Limited	1.436.814	1,22
546.816	China Resources Land Limited	2.493.768	2,13	136.622	HDFC Bank Limited	2.675.742	2,28
35.792	Hesai Group	553.702	0,47	286.116	ICICI Bank Limited	3.054.109	2,62
71.785	JD.com Inc.	1.572.875	1,34	106.853	Infosys Limited	1.856.602	1,59
17.500	Li Ning Company Limited	137.994	0,12	107.198	Reliance Industries Limited	3.040.587	2,60
86.693	Meituan	1.584.776	1,35	200.460	UPL Limited	1.750.490	1,50
44.000	Parade Technologies Limited	1.517.347	1,30				
113.600	Sunny Optical Technology Group Company Limited	1.374.059	1,17		Total de India	13.814.344	11,81
98.500	Tencent Holdings Limited	4.840.947	4,14				
21.300	Trip.com Group Limited	797.193	0,68		INDONESIA		
37.000	Wuxi Biologics Cayman Inc.	229.071	0,20	8.969.956	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	2.829.516	2,42
	Total de Islas Caimán	16.680.974	14,25		Total de Indonesia	2.829.516	2,42
CHINA				MALASIA			
223.628	Alibaba Group Holding Limited	2.860.170	2,45	1.034.300	CIMB Group Holdings Bhd	1.244.677	1,06
25.000	BYD Company Limited	731.850	0,62		Total de Malasia	1.244.677	1,06
3.316.000	China Construction Bank Corp.	2.150.128	1,84				
214.500	China Merchants Bank Company Limited - H	1.095.730	0,94		FILIPINAS		
44.100	China Tourism Group Duty Free Corp. Limited	1.176.722	1,00	1.162.525	Metropolitan Bank & Trust Company	1.250.934	1,07
256.000	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	1.085.541	0,93		Total de Filipinas	1.250.934	1,07
245.500	NARI Technology Company Limited	969.161	0,83				
302.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	1.965.893	1,68		REPÚBLICA DE COREA (SUR)		
466.100	Songcheng Performance Development Company Limited	1.104.286	0,94	29.219	Kia Corp.	1.817.987	1,56
59.177	Wuliangye Yibin Company Limited - A	1.697.595	1,45	36.094	KT Corp.	816.508	0,70
	Total de China	14.837.076	12,68	2.469	LG Chem Limited P.P. 144A	1.350.335	1,15
				4.639	Lotte Chilsung Beverage Company Limited	587.605	0,50
				2.016	Samsung Biologics Company Limited	1.220.273	1,04

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			
108.436	Samsung Electronics Company Limited	5.330.818	4,55	14.119	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	14.119	0,01
2.875	Samsung Sdi Company Limited	1.623.176	1,39	Total de Irlanda			
18.234	SK Hynix Inc.	1.240.955	1,06	14.119 0,01			
Total de República de Corea (Sur)		13.987.657	11,95	Total de fondos			
				14.119 0,01			
				Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
				14.119 0,01			
				Valor total de las inversiones			
				115.440.088 98,58			
				(Coste total: 109.237.239 USD)			
				<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>			
SINGAPUR							
219.700	Keppel Corp. Limited	930.323	0,79				
108.500	United Overseas Bank Limited	2.428.611	2,07				
Total de Singapur		3.358.934	2,86				
TAIWÁN							
256.550	Chailease Holding Company Limited	1.883.183	1,61				
188.000	Chroma ATE Inc.	1.095.971	0,94				
132.000	Delta Electronics Inc.	1.304.918	1,11				
548.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	9.592.914	8,20				
70.000	Yageo Corp.	1.216.176	1,03				
Total de Taiwán		15.093.162	12,89				
TAILANDIA							
712.663	Thai Oil plc	1.094.159	0,93				
Total de Tailandia		1.094.159	0,93				
ESTADOS UNIDOS							
23.050	Yum China Holdings Inc.	1.449.366	1,24				
Total de Estados Unidos		1.449.366	1,24				
Total de renta variable		115.425.969	98,57				
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		115.425.969	98,57				

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

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)			
52.183	Canadian Natural Resources Limited	2.888.329	1,08	7.979	IBM Corp.	1.045.967	0,39
	Total de Canadá	2.888.329	1,08	29.820	International Flavors & Fragrances Inc.	2.742.247	1,03
IRLANDA				10.576	Intuit Inc.	4.715.099	1,76
5.061	Accenture plc	1.446.485	0,54	7.062	IQVIA Holdings Inc.	1.404.561	0,52
7.143	Aon plc	2.252.116	0,84	38.981	Johnson & Johnson	6.042.055	2,26
37.085	Medtronic plc	2.989.793	1,11	16.544	JPMorgan Chase & Company	2.155.849	0,80
	Total de Irlanda	6.688.394	2,49	5.809	Lam Research Corp.	3.079.467	1,15
SUIZA				5.879	Lowe's Companies Inc.	1.175.624	0,44
21.435	TE Connectivity Limited	2.811.200	1,04	32.814	Marvell Technology Inc.	1.420.846	0,53
	Total de Suiza	2.811.200	1,04	11.896	Mastercard Inc. - A	4.323.125	1,61
ESTADOS UNIDOS				29.936	Match Group Inc.	1.149.243	0,43
21.206	Abbott Laboratories	2.147.320	0,80	7.657	McDonald's Corp.	2.140.974	0,80
20.017	AbbVie Inc.	3.190.109	1,19	23.846	Meta Platforms Inc.	5.053.921	1,89
11.203	Adobe Inc.	4.317.300	1,61	6.692	Microchip Technology Inc.	560.656	0,21
16.111	Advanced Micro Devices Inc.	1.579.039	0,59	66.681	Microsoft Corp.	19.224.133	7,18
52.034	Alphabet Inc. - A	5.397.486	2,02	64.229	Mondelez International Inc.	4.478.045	1,67
49.161	Alphabet Inc. - C	5.112.744	1,91	16.724	Monster Beverage Corp.	903.263	0,34
85.007	Amazon.com Inc.	8.780.374	3,27	2.616	MSCI Inc. - A	1.464.149	0,55
39.401	American Electric Power Company Inc.	3.585.097	1,34	26.720	Newmont Corp.	1.309.814	0,49
1.808	American Express Company	298.230	0,11	24.482	NVIDIA Corp.	6.800.366	2,54
18.446	American Tower Corp.	3.769.256	1,41	8.003	Palo Alto Networks Inc.	1.598.519	0,60
100.287	Apple Inc.	16.537.326	6,17	10.871	Parker Hannifin Corp.	3.653.851	1,36
51.859	Avantor Inc.	1.096.299	0,41	29.357	Pinterest Inc.	800.565	0,30
56.805	Bank of America Corp.	1.624.623	0,61	43.313	Procter & Gamble Company	6.440.210	2,40
22.532	Berkshire Hathaway Inc.	6.957.206	2,60	32.023	Public Service Enterprise Group Inc.	1.999.836	0,75
14.747	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	1.433.998	0,54	11.536	QUALCOMM Inc.	1.471.763	0,55
2.480	BlackRock Inc.	1.659.417	0,62	53.171	Raytheon Technologies Corp.	5.207.036	1,94
58.699	Boston Scientific Corp.	2.936.711	1,10	3.636	S&P Global Inc.	1.253.584	0,47
32.876	Chevron Corp.	5.364.048	2,00	10.028	Sherwin-Williams Company	2.253.994	0,84
64.893	Comcast Corp.	2.460.094	0,92	42.214	State Street Corp.	3.195.178	1,19
21.325	Corteva Inc.	1.286.111	0,48	35.937	Sysco Corp.	2.775.415	1,04
123.881	Coty Inc. - A	1.494.005	0,56	35.908	Take-Two Interactive Software Inc.	4.283.824	1,60
8.039	Elevance Health Inc.	3.696.413	1,38	49.645	Tapestry Inc.	2.140.196	0,80
15.734	Eli Lilly & Company	5.403.370	2,02	15.912	Tesla Inc.	3.301.104	1,23
66.319	Endeavor Group Holdings Inc.	1.587.014	0,59	4.538	Thermo Fisher Scientific Inc.	2.615.567	0,98
12.644	Entegris Inc.	1.036.934	0,39	6.931	TJX Companies Inc.	543.113	0,20
16.616	EOG Resources Inc.	1.904.692	0,71	24.452	T-Mobile USA Inc.	3.541.628	1,32
21.036	GE HealthCare Technologies Inc.	1.725.583	0,64	98.452	Uber Technologies Inc.	3.120.928	1,17
35.461	General Electric Company	3.390.072	1,27	19.737	Union Pacific Corp.	3.972.269	1,48
7.925	Honeywell International Inc.	1.514.626	0,57	12.396	Vertex Pharmaceuticals Inc.	3.905.608	1,45
				20.273	Visa Inc. - A	4.570.750	1,71
				23.223	Walmart Inc.	3.424.231	1,28
				33.561	Walt Disney Company	3.360.463	1,25
				112.381	Wells Fargo & Company	4.200.801	1,57
				2.913	Zebra Technologies Corp.	926.334	0,35

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)			
53.862	ZoomInfo Technologies Inc.	1.330.930	0,50
	Total de Estados Unidos	248.362.598	92,75
	Total de renta variable	260.750.521	97,36
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	260.750.521	97,36
	Valor total de las inversiones	260.750.521	97,36

(Coste total: 209.689.959 USD)

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

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)			
608	Aon plc	191.696	0,15	20.809	Hologic Inc.	1.679.286	1,32
	Total de Irlanda	191.696	0,15	63.118	Host Hotels & Resorts Inc.	1.040.816	0,82
ESTADOS UNIDOS				1.129	Humana Inc.	548.084	0,43
14.383	Abbott Laboratories	1.456.423	1,15	9.657	IQVIA Holdings Inc.	1.920.681	1,51
8.226	AbbVie Inc.	1.310.978	1,03	42.045	Kroger Company	2.075.762	1,63
4.199	Adobe Inc.	1.618.169	1,27	3.175	Lam Research Corp.	1.683.131	1,32
21.628	Advanced Micro Devices Inc.	2.119.760	1,67	12.909	Lennar Corp.	1.356.865	1,06
59.411	Alphabet Inc. - A	6.162.703	4,85	6.489	Lincoln National Corp.	145.808	0,11
38.481	Altria Group Inc.	1.717.022	1,35	4.912	Lockheed Martin Corp.	2.322.050	1,83
17.163	Amazon.com Inc.	1.772.766	1,39	12.518	Marathon Petroleum Corp.	1.687.802	1,33
22.279	American Electric Power Company Inc.	2.027.166	1,60	13.635	Marsh & McLennan Companies Inc.	2.270.910	1,79
446	Amgen Inc.	107.821	0,08	6.944	Masco Corp.	345.256	0,27
58.304	Apple Inc.	9.614.329	7,56	8.490	Mastercard Inc. - A	3.085.351	2,43
23.244	Archer-Daniels-Midland Company	1.851.617	1,46	2.792	McKesson Corp.	994.092	0,78
3.444	Autodesk Inc.	716.903	0,56	14.277	Meta Platforms Inc.	3.025.867	2,39
3.625	Automatic Data Processing Inc.	807.034	0,63	24.748	Metlife Inc.	1.433.899	1,13
656	Autozone Inc.	1.612.546	1,27	30.774	Microsoft Corp.	8.872.144	6,99
7.536	Bath & Body Works Inc.	275.667	0,22	26.901	Morgan Stanley	2.361.907	1,85
4.204	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	408.797	0,32	18.004	Mosaic Company	826.023	0,65
36.853	Bristol-Myers Squibb Company	2.554.280	2,01	10.556	Nucor Corp.	1.630.585	1,28
13.341	Cardinal Health Inc.	1.007.246	0,79	2.739	NVIDIA Corp.	760.812	0,60
2.375	Caterpillar Inc.	543.495	0,43	2.308	O'Reilly Automotive Inc.	1.959.447	1,53
5.061	Centene Corp.	319.906	0,25	5.305	Parker Hannifin Corp.	1.783.063	1,40
5.206	CF Industries Holdings Inc.	377.383	0,30	62.316	Pfizer Inc.	2.542.493	2,00
3.068	Cintas Corp.	1.419.502	1,12	10.176	Philip Morris International Inc.	989.616	0,78
54.623	Cisco Systems Inc.	2.855.417	2,25	3.710	Procter & Gamble Company	551.640	0,43
26.255	Citigroup Inc.	1.231.097	0,97	21.286	PulteGroup Inc.	1.240.548	0,98
2.210	CME Group Inc.	423.259	0,33	20.341	QUALCOMM Inc.	2.595.105	2,04
11.166	CSX Corp.	334.310	0,26	754	Regeneron Pharmaceuticals Inc.	619.539	0,49
13.968	CVS Health Corp.	1.037.962	0,82	15.620	Regions Financial Corp.	289.907	0,23
3.045	Delta Air Lines Inc.	106.331	0,09	3.028	SBA Communications Corp.	790.520	0,62
6.117	Electronic Arts Inc.	736.793	0,58	2.853	Southwest Airlines Company	92.837	0,07
4.222	EQT Corp.	134.724	0,11	27.024	State Street Corp.	2.045.447	1,61
8.193	Etsy Inc.	912.127	0,72	13.084	Synchrony Financial	380.483	0,30
17.108	Evergy Inc.	1.045.641	0,82	4.864	Tesla Inc.	1.009.085	0,79
16.917	Expedia Group Inc.	1.641.457	1,29	16.184	Textron Inc.	1.143.076	0,90
25.243	Exxon Mobil Corp.	2.768.148	2,17	2.905	Ulta Beauty Inc.	1.585.171	1,25
38.039	Fortinet Inc.	2.528.072	1,99	5.091	United Parcel Service Inc.	987.603	0,78
7.361	Fortive Corp.	501.799	0,39	13.832	Valero Energy Corp.	1.930.947	1,52
20.110	Fox Corp.	684.746	0,54	2.672	Vertex Pharmaceuticals Inc.	841.867	0,67
14.287	General Mills Inc.	1.220.967	0,96	20.483	Viatis Inc.	197.046	0,16
				55.955	Wells Fargo & Company	2.091.598	1,65

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)			
54.711	Weyerhaeuser Company	1.648.442	1,30
	Total de Estados Unidos	125.346.974	98,62
	Total de renta variable	125.538.670	98,77
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	125.538.670	98,77
	Valor total de las inversiones	125.538.670	98,77
	(Coste total: 121.462.832 USD)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

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			
65.217	KBC Group NV	4.128.236	0,95	95.844	Moncler SpA	6.089.928	1,40
	Total de Bélgica	4.128.236	0,95		Total de Italia	6.089.928	1,40
DINAMARCA				PAÍSES BAJOS			
25.662	DSV A/S	4.569.646	1,05	3.064	Adyen NV	4.470.989	1,03
144.741	Novo Nordisk AS	21.097.267	4,84	13.710	ASM International NV	5.098.749	1,17
	Total de Dinamarca	25.666.913	5,89	25.882	ASML Holding NV	16.181.426	3,72
FRANCIA				586.548	ING Groep NV	6.410.970	1,47
53.739	Air Liquide SA	8.286.554	1,89	40.697	Koninklijke DSM NV	4.423.764	1,02
343.575	AXA SA	9.676.790	2,22	96.326	STMicroelectronics NV	4.715.158	1,08
128.351	BNP Paribas SA	7.086.259	1,62		Total de Países Bajos	41.301.056	9,49
111.793	Compagnie de Saint-Gobain	5.849.010	1,34	NORUEGA			
38.023	EssilorLuxottica SA	6.311.818	1,45	319.976	DNB Bank ASA	5.268.505	1,21
4.194	Hermes International	7.817.616	1,80		Total de Noruega	5.268.505	1,21
36.148	L'Oreal SA	14.865.865	3,41	SUECIA			
22.515	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	19.011.666	4,36	352.766	Atlas Copco AB	4.118.831	0,95
51.710	Pernod-Ricard SA	10.791.877	2,48	417.493	Sandvik AB	8.145.286	1,87
99.521	Publicis Groupe SA	7.143.617	1,64		Total de Suecia	12.264.117	2,82
46.147	Schneider Electric SE	7.091.871	1,63	SUIZA			
18.924	Teleperformance	4.195.451	0,96	73.743	Compagnie Financiere Richemont SA - Reg	10.840.120	2,49
275.943	TotalEnergies SE	15.000.261	3,44	11.822	Lonza Group AG - Reg	6.520.092	1,50
40.784	Vinci SA	4.311.684	0,99	128.590	Nestle SA - Reg	14.440.566	3,32
	Total de Francia	127.440.339	29,23	55.593	Roche Holding AG	14.616.231	3,36
ALEMANIA				28.315	Sika AG	7.288.958	1,67
62.806	Brenntag SE	4.346.175	1,00	359.341	UBS Group AG	6.983.884	1,60
138.052	Daimler Truck Holding AG	4.294.798	0,99		Total de Suiza	60.689.851	13,94
66.654	Dr Ing hc F Porsche AG	7.865.172	1,80	REINO UNIDO			
66.221	Mercedes-Benz Group AG - Reg	4.687.122	1,08	667.317	3i Group plc	12.796.727	2,95
19.869	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG - Reg	6.407.753	1,47	190.368	Ashtead Group plc	10.741.559	2,47
	Total de Alemania	27.601.020	6,34	116.049	Astrazeneca plc	14.834.241	3,41
IRLANDA				363.364	Compass Group plc	8.407.098	1,93
670.756	Bank of Ireland Group plc	6.254.129	1,44	530.676	Howden Joinery Group plc	4.215.525	0,97
198.328	CRH plc	9.217.294	2,12	37.154	London Stock Exchange Group plc	3.326.877	0,76
124.165	Experian plc	3.758.786	0,86	125.317	Reckitt Benckiser Group plc	8.782.466	2,02
70.337	Kingspan Group plc	4.434.044	1,02	1.060.943	Rentokil Initial plc	7.143.105	1,64
	Total de Irlanda	23.664.253	5,44	90.799	Rio Tinto plc	5.660.697	1,30
				483.603	SSE plc	9.923.195	2,28

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)			
451.841	St James's Place plc	6.227.254	1,43
	Total de Reino Unido	92.058.744	21,16
	Total de renta variable	426.172.962	97,87
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	426.172.962	97,87

Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios

Fondos

IRLANDA

71.065	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	7.024.720	1,61
	Total de Irlanda	7.024.720	1,61
	Total de fondos	7.024.720	1,61
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	7.024.720	1,61
	Valor total de las inversiones	433.197.682	99,48
(Coste total: 365.924.793 EUR)			

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BÉLGICA				ITALIA (continuación)			
27.229	KBC Group NV	1.723.596	2,48	206.146	Nexi SpA	1.543.209	2,22
6.477	Melexis NV	689.153	0,99		Total de Italia	3.828.367	5,50
	Total de Bélgica	2.412.749	3,47				
DINAMARCA				JERSEY - ISLAS DEL CANAL			
51.629	Tryg A/S	1.038.915	1,50	162.913	WPP plc	1.777.297	2,56
	Total de Dinamarca	1.038.915	1,50		Total de Jersey - Islas del Canal	1.777.297	2,56
FINLANDIA				PAÍSES BAJOS			
19.383	Upm-Kymmene Oyj	599.904	0,86	5.190	ASM International NV	1.930.161	2,78
	Total de Finlandia	599.904	0,86	24.841	BE Semiconductor Industries NV	1.989.764	2,86
FRANCIA				390.793	Royal KPN NV	1.272.422	1,83
11.196	Air Liquide SA	1.726.423	2,49		Total de Países Bajos	5.192.347	7,47
86.603	AXA SA	2.439.175	3,52	ESPAÑA			
30.801	BNP Paribas SA	1.700.523	2,45	129.173	Iberdrola SA	1.483.552	2,14
21.995	Compagnie de Saint-Gobain	1.150.778	1,66	65.410	Inditex SA	2.021.169	2,91
1.905	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	1.608.582	2,31		Total de España	3.504.721	5,05
8.483	Pernod-Ricard SA	1.770.402	2,55	SUECIA			
6.863	Sanofi	687.947	0,99	66.546	Sandvik AB	1.298.312	1,87
11.113	Schneider Electric SE	1.707.846	2,46		Total de Suecia	1.298.312	1,87
41.680	TotalEnergies SE	2.265.725	3,26	SUIZA			
19.706	Vinci SA	2.083.318	3,00	14.069	Nestle SA - Reg	1.579.939	2,27
	Total de Francia	17.140.719	24,69	1.306	Partners Group Holding AG - Reg	1.127.407	1,62
ALEMANIA				7.080	Roche Holding AG	1.861.438	2,68
24.633	Brenntag SE	1.704.604	2,45		Total de Suiza	4.568.784	6,57
38.275	Daimler Truck Holding AG	1.190.735	1,71	REINO UNIDO			
59.735	Deutsche Telekom AG - Reg	1.335.077	1,92	99.464	3i Group plc	1.907.359	2,75
12.737	Mercedes-Benz Group AG - Reg	901.525	1,30	224.011	Allfunds Group plc	1.361.987	1,96
14.024	SAP SE	1.627.625	2,34	32.499	Anglo American plc	990.484	1,43
14.606	Siemens AG - Reg	2.180.092	3,14	15.573	Astrazeneca plc	1.990.656	2,86
23.161	Siemens Healthineers AG	1.227.996	1,77	12.199	London Stock Exchange Group plc	1.092.334	1,57
	Total de Alemania	10.167.654	14,63	56.140	Persimmon plc	802.470	1,15
IRLANDA				19.099	Reckitt Benckiser Group plc	1.338.496	1,93
152.998	Bank of Ireland Group plc	1.426.553	2,05	69.397	SSE plc	1.423.978	2,05
44.787	CRH plc	2.081.476	2,99	131.777	St James's Place plc	1.816.145	2,61
	Total de Irlanda	3.508.029	5,04				
ITALIA							
406.106	Enel SpA	2.285.158	3,28				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
REINO UNIDO (continuación)			
1.100.499	Vodafone Group plc	1.118.428	1,61
	Total de Reino Unido	13.842.337	19,92
	Total de renta variable	68.880.135	99,13
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	68.880.135	99,13
	Valor total de las inversiones	68.880.135	99,13
	(Coste total: 63.774.985 EUR)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

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 (continuación)			
131.576	Azelis Group NV	3.073.615	0,78	680.437	Dalata Hotel Group Limited	2.851.031	0,73
310	Lotus Bakeries NV	1.999.500	0,51	816.790	Irish Continental Group plc	3.565.288	0,91
94.065	Melexis NV	10.008.516	2,55				
	Total de Bélgica	15.081.631	3,84		Total de Irlanda	10.602.798	2,71
DINAMARCA				ISLA DE MAN			
130.763	ALK-Abello AS	1.862.452	0,48	2.333.609	Strix Group plc	2.650.486	0,68
77.665	Simcorp A/S	5.408.914	1,38		Total de Isla de Man	2.650.486	0,68
	Total de Dinamarca	7.271.366	1,86				
FINLANDIA				ITALIA			
166.527	Huhtamaki Oyj	5.695.223	1,45	379.682	Carel Industries SpA	9.567.986	2,44
114.086	Musti Group Oyj	1.837.925	0,47	20.815	Diasorin SpA	2.020.304	0,52
67.452	Revenio Group Oyj	2.606.345	0,67	243.561	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	2.951.959	0,75
112.485	Vaisala Oyj	4.471.279	1,14	112.226	Interpump Group SpA	5.796.473	1,48
	Total de Finlandia	14.610.772	3,73	170.544	MARR SpA	2.258.003	0,58
				405.117	Technoprobe SpA	2.701.320	0,69
					Total de Italia	25.296.045	6,46
FRANCIA				JERSEY - ISLAS DEL CANAL			
214.777	Elis SA	3.788.666	0,97	1.010.259	JTC plc	8.082.670	2,05
20.196	Gaztransport et Technigaz SA	1.902.463	0,49				
235.576	Lectra	8.563.187	2,18		Total de Jersey - Islas del Canal	8.082.670	2,05
11.914	Remy Cointreau SA	2.001.552	0,51				
242.485	Verallia SA	9.529.661	2,44				
6.135	Virbac SA	1.815.960	0,46				
	Total de Francia	27.601.489	7,05				
ALEMANIA				PAÍSES BAJOS			
169.969	CANCOM SE	5.354.024	1,37	65.510	BE Semiconductor Industries NV	5.247.351	1,34
170.028	CompuGroup Medical SE & Company KGaA	8.055.926	2,06	27.874	IMCD NV	4.192.249	1,07
156.562	CTS Eventim AG & Company KGaA	8.994.486	2,29		Total de Países Bajos	9.439.600	2,41
38.200	Gerresheimer AG	3.481.930	0,89				
75.257	Nemetschek SE	4.762.263	1,22				
109.253	Stabilus SE	7.035.893	1,80				
51.064	STRATEC SE	3.196.606	0,82				
	Total de Alemania	40.881.128	10,45				
ISLANDIA				ESPAÑA			
1.338.292	Marel HF	5.031.978	1,28	406.822	Fluidra SA	6.586.448	1,68
	Total de Islandia	5.031.978	1,28	37.494	Viscofan SA	2.474.604	0,63
IRLANDA					Total de España	9.061.052	2,31
1.118.781	AIB Group plc	4.186.479	1,07				
				SUECIA			
				370.024	Avanza Bank Holding AB	7.981.153	2,04
				527.436	Elektro AB - B	3.702.251	0,95
				376.391	Engcon AB	2.629.320	0,67
				851.083	Fortnox AB	5.357.598	1,37
				290.419	Hexpol AB	3.312.513	0,85
				1.582.406	Karnov Group AB	7.598.794	1,94
				134.909	MIPS AB	6.270.036	1,60
				1.031.556	Munters Group AB	8.748.890	2,23
				229.814	Nordnet AB publ	3.483.106	0,89

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

Estado de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado	% de valor liquidativo*			Valor de mercado	% de valor liquidativo*
Cantidad	Inversión	EUR		Cantidad	Inversión	EUR	
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)			
190.972	Thule Group AB	4.317.458	1,10	864.703	Watches of Switzerland Group plc	8.025.235	2,05
Total de Suecia		53.401.119	13,64	Total de Reino Unido		114.480.060	29,22
SUIZA				Total de renta variable			
17.655	Belimo Holding AG	7.844.483	2,00	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
4.034	Inficon Holding AG	4.011.539	1,02			389.105.544	99,33
2.842	LEM Holding SA	5.629.445	1,45	Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
426.345	SIG Group AG	10.103.143	2,58	Renta variable			
11.375	Tecan Group AG - Reg	4.575.093	1,16	DINAMARCA			
18.945	VAT Group AG	6.264.569	1,60	49.761	Ow Bunker A/S**	0	0,00
95.212	VZ Holding AG	7.185.078	1,83	Total de Dinamarca		0	0,00
Total de Suiza		45.613.350	11,64	Total de renta variable		0	0,00
REINO UNIDO				Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
211.317	Abcam plc	2.618.001	0,67	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
651.180	Allfunds Group plc	3.959.174	1,01	Fondos			
1.793.953	Ascential plc	4.920.338	1,26	IRLANDA			
440.323	Auction Technology Group plc	3.076.852	0,79	2.621	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	259.128	0,07
484.480	Big Yellow Group plc	6.445.508	1,65	Total de Irlanda		259.128	0,07
430.504	Cvs Group plc	9.088.410	2,32	Total de fondos		259.128	0,07
1.741.785	Dr. Martens plc	2.820.761	0,72	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
173.004	FD Technologies plc	3.366.814	0,86	Valor total de las inversiones		389.364.672	99,40
309.944	Future plc	4.088.213	1,04	(Coste total: 349.754.549 EUR)			
31.644	Games Workshop Group plc	3.471.644	0,89	* Diferencias menores debido al redondeo.			
237.472	Genus plc	7.767.227	1,98	** Título a su valor razonable.			
480.124	GlobalData plc	6.666.226	1,70				
1.035.438	Howden Joinery Group plc	8.225.198	2,10				
1.401.145	Ibstock plc	2.750.673	0,70				
125.231	Intermediate Capital Group plc	1.734.480	0,44				
4.800.426	Johnson Service Group plc	6.686.949	1,71				
108.817	Keywords Studios plc	3.415.528	0,87				
906.770	Moonpig Group plc	1.273.442	0,33				
61.660	Renishaw plc	2.872.885	0,73				
605.064	Rightmove plc	3.876.827	0,98				
512.177	RWS Holdings plc	1.742.842	0,44				
310.263	St James's Place plc	4.276.032	1,09				
1.145.425	Synthomer plc	1.521.263	0,39				
603.957	Victoria plc	3.367.975	0,86				
99.498	Victrex plc	1.803.836	0,46				
942.515	Volution Group plc	4.617.727	1,18				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

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				ISLANDIA			
261.718	Azelis Group NV	6.113.733	0,82	2.567.671	Marel HF	9.654.443	1,29
571	Lotus Bakeries NV	3.682.950	0,49		Total de Islandia	9.654.443	1,29
96.570	Melexis NV	10.275.048	1,38				
	Total de Bélgica	20.071.731	2,69				
DINAMARCA				IRLANDA			
303.203	ALK-Abello AS	4.318.507	0,58	2.069.705	AIB Group plc	7.744.836	1,04
152.604	Simcorp A/S	10.627.978	1,42	1.941.851	Dalata Hotel Group Limited	8.136.356	1,09
382.153	Tryg A/S	7.689.953	1,03	1.424.908	Irish Continental Group plc	6.219.723	0,84
	Total de Dinamarca	22.636.438	3,03		Total de Irlanda	22.100.915	2,97
FINLANDIA				ITALIA			
82.000	Cargotec Oyj	3.671.960	0,49	72.998	Diasorin SpA	7.085.186	0,95
333.698	Huhtamaki Oyj	11.412.472	1,53	1.019.423	Finecobank Banca Fineco SpA	14.414.641	1,93
241.944	Musti Group Oyj	3.897.718	0,52	1.273.881	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	15.439.438	2,07
131.285	Revenio Group Oyj	5.072.852	0,68	209.136	Interpump Group SpA	10.801.874	1,45
	Total de Finlandia	24.055.002	3,22	324.056	MARR SpA	4.290.501	0,57
FRANCIA				917.307	Nexi SpA	6.866.960	0,92
334.492	Bureau Veritas SA	8.854.003	1,19	793.294	Technoprobe SpA	5.289.684	0,71
121.406	Edenred	6.621.483	0,89		Total de Italia	64.188.284	8,60
786.894	Elis SA	13.880.811	1,85				
37.534	Gaztransport et Technigaz SA	3.535.703	0,47		JERSEY - ISLAS DEL CANAL		
44.124	Remy Cointreau SA	7.412.832	0,99	627.754	JTC plc	5.022.404	0,67
45.171	SEB SA	4.733.921	0,63		Total de Jersey - Islas del Canal	5.022.404	0,67
109.073	Ubisoft Entertainment SA	2.667.926	0,36				
477.570	Verallia SA	18.768.501	2,51		LUXEMBURGO		
13.215	Virbac SA	3.911.640	0,52	219.115	Eurofins Scientific SE	13.506.249	1,81
	Total de Francia	70.386.820	9,41		Total de Luxemburgo	13.506.249	1,81
ALEMANIA							
380.757	CANCOM SE	11.993.846	1,61		PAÍSES BAJOS		
56.164	Carl Zeiss Meditec AG	7.188.992	0,96	47.954	ASM International NV	17.834.093	2,38
319.897	CompuGroup Medical SE & Company KGaA	15.156.720	2,04	125.623	BE Semiconductor Industries NV	10.062.402	1,35
296.380	CTS Eventim AG & Company KGaA	17.027.031	2,28	575.806	Davide Campari-Milano NV	6.477.818	0,87
88.163	Gerresheimer AG	8.036.057	1,08	45.945	IMCD NV	6.910.128	0,93
107.649	Nemetschek SE	6.812.029	0,91		Total de Países Bajos	41.284.441	5,53
126.203	Puma SE	7.175.903	0,96				
166.956	Stabilus SE	10.751.966	1,44		ESPAÑA		
100.000	STRATEC SE	6.260.000	0,84	807.190	Fluidra SA	13.068.406	1,75
285.092	TeamViewer AG	4.463.115	0,60	69.937	Viscofan SA	4.615.842	0,62
	Total de Alemania	94.865.659	12,72		Total de España	17.684.248	2,37
					SUECIA		
				707.996	Avanza Bank Holding AB	15.270.966	2,06

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)			
SUECIA (continuación)				REINO UNIDO (continuación)			
1.098.143	Elekt AB - B	7.708.236	1,03	1.609.897	Watches of Switzerland Group plc	14.941.316	2,00
1.931.229	Fortnox AB	12.157.155	1,63				
592.500	Hexpol AB	6.758.043	0,91		Total de Reino Unido	209.684.411	28,08
101.132	MIPS AB	4.700.215	0,63				
435.249	Nordnet AB publ	6.596.718	0,88		Total de renta variable	740.586.909	99,21
366.590	Thule Group AB	8.287.795	1,11				
	Total de Suecia	61.479.128	8,25		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	740.586.909	99,21
SUIZA				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
33.323	Belimo Holding AG	14.806.100	1,98	Fondos			
8.039	Inficon Holding AG	7.994.240	1,07	IRLANDA			
812.894	SIG Group AG	19.263.236	2,58	25.474	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	2.518.125	0,34
23.651	Tecan Group AG - Reg	9.512.574	1,28				
37.471	VAT Group AG	12.390.586	1,66		Total de Irlanda	2.518.125	0,34
	Total de Suiza	63.966.736	8,57		Total de fondos	2.518.125	0,34
REINO UNIDO					Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	2.518.125	0,34
457.833	Abcam plc	5.672.081	0,76		Valor total de las inversiones	743.105.034	99,55
1.226.449	Allfunds Group plc	7.456.810	1,00		(Coste total: 735.954.012 EUR)		
3.719.060	Ascential plc	10.200.396	1,37	<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>			
854.007	Auction Technology Group plc	5.967.557	0,81				
1.009.163	Big Yellow Group plc	13.425.876	1,80				
827.092	Cvs Group plc	17.460.817	2,34				
3.338.856	Dr. Martens plc	5.407.162	0,72				
2.944.960	Elementis plc	3.991.701	0,53				
300.975	FD Technologies plc	5.857.244	0,78				
650.639	Future plc	8.582.036	1,15				
59.642	Games Workshop Group plc	6.543.288	0,88				
441.534	Genus plc	14.441.680	1,93				
611.764	GlobalData plc	8.493.967	1,14				
1.973.607	Howden Joinery Group plc	15.677.720	2,10				
2.694.398	Ibstock plc	5.289.537	0,71				
233.588	Intermediate Capital Group plc	3.235.251	0,43				
113.834	Keywords Studios plc	3.573.000	0,48				
1.774.903	Moonpig Group plc	2.492.623	0,33				
210.486	Renishaw plc	9.807.038	1,31				
842.977	Rentokil Initial plc	5.675.586	0,76				
622.736	Rightmove plc	3.990.058	0,53				
990.445	RWS Holdings plc	3.370.299	0,45				
1.087.708	St James's Place plc	14.990.747	2,01				
1.573.955	Synthomer plc	2.090.403	0,28				
913.925	Victoria plc	5.096.517	0,68				
328.401	Victrex plc	5.953.701	0,80				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Select

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

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				NORUEGA			
178.285	DSV A/S	31.747.303	2,07	1.697.015	DNB Bank ASA	27.941.884	1,82
356.109	Novo Nordisk AS	51.906.001	3,39		Total de Noruega	27.941.884	1,82
2.044.278	Tryg A/S	41.136.408	2,68				
	Total de Dinamarca	124.789.712	8,14				
FRANCIA				ESPAÑA			
180.756	Air Liquide SA	27.872.575	1,82	808.940	Amadeus IT Holding SA - A	49.879.241	3,26
204.189	Dassault Systemes SE	7.733.658	0,50	2.201.075	Inditex SA	68.013.217	4,44
26.472	Hermes International	49.343.808	3,22		Total de España	117.892.458	7,70
363.057	Legrand SA	30.525.833	1,99				
99.821	L'Oreal SA	41.051.386	2,68	SUECIA			
86.686	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	73.197.658	4,78	3.530.396	Atlas Copco AB	41.220.258	2,69
238.386	Pernod-Ricard SA	49.751.158	3,24	2.090.329	Sandvik AB	40.782.306	2,66
486.897	Schneider Electric SE	74.826.331	4,89		Total de Suecia	82.002.564	5,35
	Total de Francia	354.302.407	23,12				
ALEMANIA				SUIZA			
681.022	Brenntag SE	47.126.722	3,08	111.363	Lonza Group AG - Reg	61.419.138	4,01
228.494	Hannover Rueck SE - Reg	41.208.892	2,69	884.567	Nestle SA - Reg	99.336.252	6,48
87.305	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG - Reg	28.155.863	1,84	17.091	Partners Group Holding AG - Reg	14.753.835	0,96
457.154	SAP SE	53.057.293	3,47	105.370	Roche Holding AG	27.703.349	1,81
339.077	Siemens Healthineers AG	17.977.863	1,17	113.054	Sika AG	29.102.804	1,90
540.866	Zalando SE	20.844.976	1,36	83.978	VAT Group AG	27.769.119	1,81
	Total de Alemania	208.371.609	13,61		Total de Suiza	260.084.497	16,97
ITALIA				REINO UNIDO			
2.516.341	Finecobank Banca Fineco SpA	35.581.062	2,33	2.596.632	Allfunds Group plc	15.787.522	1,04
1.746.641	Nexi SpA	13.075.355	0,85		Total de Reino Unido	15.787.522	1,04
	Total de Italia	48.656.417	3,18		Total de renta variable	1.505.974.526	98,30
PAÍSES BAJOS				Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
6.342	Adyen NV	9.254.246	0,60			1.505.974.526	98,30
71.576	ASM International NV	26.619.114	1,74				
137.341	ASML Holding NV	85.865.594	5,60				
4.135.926	Davide Campari-Milano NV	46.529.168	3,04				
270.157	IMCD NV	40.631.613	2,65				
188.305	Koninklijke DSM NV	20.468.754	1,34				
751.317	STMicroelectronics NV	36.776.967	2,40				
	Total de Países Bajos	266.145.456	17,37				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Select

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
268.997	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	26.590.262	1,74
10.204	ILF EUR Liquidity Fund	991.817	0,06
	Total de Irlanda	27.582.079	1,80
	Total de fondos	27.582.079	1,80
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	27.582.079	1,80
	Valor total de las inversiones	1.533.556.605	100,10

(Coste total: 1.238.142.720 EUR)

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BÉLGICA				ALEMANIA (continuación)			
898.717	Azelis Group NV	20.994.029	1,45	324.573	Stabilus SE	20.902.501	1,45
2.449	Lotus Bakeries NV	15.796.050	1,09	226.925	STRATEC SE	14.205.505	0,98
345.221	Melexis NV	36.731.514	2,54		Total de Alemania	243.115.535	16,82
365.673	Umicore SA	11.412.654	0,79				
	Total de Bélgica	84.934.247	5,87				
DINAMARCA				ISLANDIA			
988.925	ALK-Abello AS	14.085.216	0,97	4.986.949	Marel HF	18.750.928	1,30
286.655	Simcorp A/S	19.963.849	1,38		Total de Islandia	18.750.928	1,30
1.458.911	Tryg A/S	29.357.239	2,03				
	Total de Dinamarca	63.406.304	4,38				
FINLANDIA				IRLANDA			
227.331	Cargotec Oyj	10.179.882	0,70	3.948.632	AIB Group plc	14.775.781	1,02
706.564	Huhtamaki Oyj	24.164.489	1,67	2.948.273	Dalata Hotel Group Limited	12.353.264	0,86
578.834	Konecranes Oyj	17.851.241	1,24	2.725.080	Irish Continental Group plc	11.894.974	0,83
448.364	Musti Group Oyj	7.223.144	0,50	234.563	Kingspan Group plc	14.786.852	1,02
218.963	Revenio Group Oyj	8.460.730	0,59		Total de Irlanda	53.810.871	3,73
460.475	Vaisala Oyj	18.303.881	1,27				
	Total de Finlandia	86.183.367	5,97				
FRANCIA				ITALIA			
1.291.970	Bureau Veritas SA	34.198.447	2,37	140.219	Diasorin SpA	13.609.656	0,94
323.447	Edenred	17.640.799	1,22	2.301.428	Finecobank Banca Fineco SpA	32.542.192	2,25
1.475.565	Elis SA	26.028.967	1,80	2.629.360	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	31.867.843	2,21
71.507	Gaztransport et Technigaz SA	6.735.959	0,47	547.678	Intercos SpA	7.289.594	0,50
144.080	Remy Cointreau SA	24.205.440	1,68	403.022	Interpump Group SpA	20.816.086	1,44
109.910	SEB SA	11.518.568	0,80	617.980	MARR SpA	8.182.055	0,57
934.608	Verallia SA	36.730.094	2,55	1.444.177	Nexi SpA	10.811.109	0,75
	Total de Francia	157.058.274	10,89	1.457.144	Technoprobe SpA	9.716.236	0,67
					Total de Italia	134.834.771	9,33
ALEMANIA				LUXEMBURGO			
52.201	Atoss Software AG	8.696.687	0,60	372.636	Eurofins Scientific SE	22.969.283	1,59
327.720	Brenntag SE	22.678.224	1,57		Total de Luxemburgo	22.969.283	1,59
536.325	CANCOM SE	16.894.238	1,17				
124.273	Carl Zeiss Meditec AG	15.906.944	1,10				
571.164	CompuGroup Medical SE & Company KgaA	27.061.750	1,87				
612.086	CTS Eventim AG & Company KGaA	35.164.341	2,43				
165.174	Gerresheimer AG	15.055.610	1,04				
352.369	Nemetschek SE	22.297.910	1,55				
257.530	Puma SE	14.643.156	1,01				
16.643	Rational AG	10.268.731	0,71				
49.974	Sartorius AG	19.339.938	1,34				
				PAÍSES BAJOS			
				113.692	ASM International NV	42.282.055	2,93
				221.688	BE Semiconductor Industries NV	17.757.209	1,23
				2.558.881	Davide Campari-Milano NV	28.787.411	1,99
				247.997	IMCD NV	37.298.749	2,58
					Total de Países Bajos	126.125.424	8,73
				ESPAÑA			
				1.445.765	Fluidra SA	23.406.935	1,62
				134.147	Viscofan SA	8.853.702	0,61
					Total de España	32.260.637	2,23

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Renta variable (continuación)				Fondos			
SUECIA				IRLANDA			
1.339.050	Avanza Bank Holding AB	28.882.349	2,00	177.747	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	17.570.241	1,22
2.189.646	Elekta AB - B	15.369.864	1,06	Total de Irlanda		17.570.241	1,22
3.208.660	Fortnox AB	20.198.628	1,40	Total de fondos		17.570.241	1,22
776.668	Hemnet Group AB	12.036.746	0,83	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		17.570.241	1,22
989.485	Hexpol AB	11.286.045	0,78	Valor total de las inversiones		1.435.047.467	99,34
228.687	MIPS AB	10.628.465	0,74	(Coste total: 1.097.203.125 EUR)			
1.332.347	Nordnet AB publ	20.193.310	1,40	* Diferencias menores debido al redondeo.			
603.290	Thule Group AB	13.639.062	0,94	** Título a su valor razonable.			
145.906	Vitrolife AB	2.787.051	0,19				
Total de Suecia		135.021.520	9,34				
SUIZA							
79.420	Belimo Holding AG	35.287.953	2,45				
54.690	Burckhardt Compression Holding AG	31.297.833	2,17				
18.744	Inficon Holding AG	18.639.636	1,29				
11.394	LEM Holding SA	22.569.282	1,55				
1.601.929	SIG Group AG	37.961.082	2,63				
112.193	Sika AG	28.881.162	2,00				
173.749	SKAN Group AG	14.652.299	1,02				
62.911	Tecan Group AG - Reg	25.303.181	1,76				
98.482	VAT Group AG	32.565.176	2,25				
Total de Suiza		247.157.604	17,12				
REINO UNIDO							
1.948.760	Allfunds Group plc	11.848.461	0,82				
Total de Reino Unido		11.848.461	0,82				
Total de renta variable		1.417.477.226	98,12				
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		1.417.477.226	98,12				
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

(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			
121.625	Chailease Holding Company Limited	892.777	1,71
146.000	Chroma ATE Inc.	851.126	1,63
94.000	Delta Electronics Inc.	929.260	1,78
233.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	4.078.740	7,81
120.000	Unimicron Technology Corp.	581.321	1,11
52.000	Yageo Corp.	903.446	1,73
Total de Taiwán		8.236.670	15,77
TAILANDIA			
1.144.600	Thai Beverage plc	542.362	1,04
322.063	Thai Oil plc	494.467	0,95
Total de Tailandia		1.036.829	1,99
Total de renta variable		51.275.240	98,14
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		51.275.240	98,14
Valor total de las inversiones		51.275.240	98,14
(Coste total: 49.295.163 USD)			

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Global Technology

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

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)			
48.989	Globalfoundries Inc.	3.536.026	0,55	617.914	Dropbox Inc. - A	13.359.301	2,08
240.374	SMART Global Holdings Inc.	4.144.048	0,64	126.457	DXC Technology Company	3.232.241	0,50
	Total de Islas Caimán	7.680.074	1,19	260.103	Ebay Inc.	11.540.770	1,79
ALEMANIA				379.313	Eiger Biopharmaceuticals Inc.	340.206	0,05
317.128	TeamViewer AG	5.393.832	0,84	52.679	F5 Inc.	7.674.804	1,19
	Total de Alemania	5.393.832	0,84	62.395	Fidelity National Information Services Inc.	3.389.920	0,53
ISRAEL				61.991	Fiserv Inc.	7.006.843	1,09
43.748	Check Point Software Technologies	5.687.239	0,88	195.669	Fortinet Inc.	13.004.162	2,02
20.002	Cyberark Software Limited	2.959.896	0,46	481.748	Gen Digital Inc.	8.266.796	1,29
45.819	Tower Semiconductor Limited	1.945.933	0,30	188.603	GoDaddy Inc.	14.658.225	2,28
	Total de Israel	10.593.068	1,64	101.902	HireRight Holdings Corp.	1.081.180	0,17
JAPÓN				75.891	Lam Research Corp.	40.231.336	6,26
1.448.500	Renesas Electronics Corp.	20.825.786	3,24	115.587	Lumentum Holdings Lite US	6.242.854	0,97
163.400	SUMCO Corp.	2.432.153	0,38	311.087	Marvell Technology Inc.	13.470.067	2,09
	Total de Japón	23.257.939	3,62	59.023	Match Group Inc.	2.265.893	0,35
PAÍSES BAJOS				128.981	Microchip Technology Inc.	10.806.028	1,68
56.071	NXP Semiconductor NV	10.455.840	1,63	81.223	Microsoft Corp.	23.416.592	3,64
	Total de Países Bajos	10.455.840	1,63	32.108	National Instruments Corp.	1.682.780	0,26
SUECIA				179.984	NetApp Inc.	11.491.978	1,79
572.585	Telefonaktiebolaget LM Ericsson - ADR	3.349.622	0,52	58.688	ON Semiconductor Corp.	4.831.196	0,75
	Total de Suecia	3.349.622	0,52	168.007	Oracle Corp.	15.611.210	2,43
ESTADOS UNIDOS				70.761	Palo Alto Networks Inc.	14.133.803	2,20
119.680	Activision Blizzard Inc.	10.243.411	1,59	93.042	Qorvo Inc.	9.450.276	1,47
451.459	Adeia Inc.	3.999.927	0,62	4.260	QUALCOMM Inc.	543.491	0,08
111.675	Advanced Energy Industries Inc.	10.944.150	1,70	128.953	Rambus Inc.	6.610.131	1,03
233.631	Alphabet Inc. - A	24.234.544	3,76	21.890	Salesforce Inc.	4.373.184	0,68
93.781	Alphabet Inc. - C	9.753.224	1,52	10.987	Skyworks Solutions Inc.	1.296.246	0,20
103.995	Analog Devices Inc.	20.509.894	3,19	32.613	Splunk Inc.	3.126.934	0,49
227.800	Apple Inc.	37.564.220	5,83	156.604	Synaptics Inc.	17.406.535	2,71
179.453	Applied Materials Inc.	22.042.212	3,43	59.711	Synopsys Inc.	23.063.374	3,59
55.713	Arista Networks Inc.	9.351.984	1,45	42.022	Tenable Holdings Inc.	1.996.465	0,31
759.191	Bloom Energy Corp.	15.130.677	2,35	219.287	Teradyne Inc.	23.575.545	3,67
47.663	Broadcom Inc.	30.577.721	4,75	136.507	Thoughtworks Holding Inc.	1.004.692	0,16
83.178	Cerence Inc.	2.336.470	0,36	17.629	T-Mobile USA Inc.	2.553.384	0,40
83.223	Comcast Corp.	3.154.984	0,49	76.490	Visa Inc. - A	17.245.435	2,68
167.344	Dell Technologies Inc. - C	6.728.902	1,05	42.733	VMware Inc. - A	5.335.215	0,83
				191.894	Western Digital Corp.	7.228.647	1,12
					Total de Estados Unidos	559.120.059	86,92
					Total de renta variable	619.850.434	96,36
					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	619.850.434	96,36
					Valor total de las inversiones	619.850.434	96,36
					(Coste total: 505.613.589 USD)		

* 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 31 de marzo de 2023

		Valor de mercado	% de valor liquidativo*			Valor de mercado	% de valor liquidativo*
Cantidad	Inversión	GBP		Cantidad	Inversión	GBP	
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)			
3.451.163	Sherborne Investors Guernsey C Limited	1.811.861	0,75	187.189	Unilever plc	7.843.219	3,26
				111.180	Whitbread plc	3.320.947	1,38
				1.063.628	Wincanton plc	2.297.436	0,95
	Total de Guernsey - Islas del Canal	1.811.861	0,75		Total de Reino Unido	237.032.176	98,44
REINO UNIDO				Total de renta variable			
632.650	3i Group plc	10.660.153	4,43	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
110.603	Astrazeneca plc	12.422.929	5,15	238.844.037			
722.523	BAE Systems plc	7.099.511	2,95	99,19			
4.558.314	BT Group plc	6.646.022	2,76	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
5.336.559	Centrica plc	5.659.421	2,35	Fondos			
828.289	Chesnara plc	2.484.867	1,03	IRLANDA			
302.267	Compass Group plc	6.145.088	2,55	1.055.454	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	1.055.454	0,44
2.475.424	Direct Line Insurance Group plc	3.403.708	1,41	Total de Irlanda			
1.168.669	DS Smith plc	3.675.464	1,53	Total de fondos			
955.044	Elementis plc	1.137.457	0,47	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
66.514	Ferguson plc	7.083.741	2,94	1.055.454			
714.647	GSK plc	10.212.306	4,24	0,44			
969.400	Haleon plc	3.121.468	1,30	Total de fondos			
3.887.726	Hays plc	4.334.814	1,80	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
223.780	Hikma Pharmaceuticals plc	3.748.315	1,56	1.055.454			
121.686	Hostmore plc	15.381	0,01	0,44			
271.010	IMI plc	4.157.293	1,73	Valor total de las inversiones			
707.450	Imperial Brands plc	13.186.868	5,48	239.899.491			
4.964.720	ITV plc	4.110.788	1,71	99,63			
194.613	Johnson Matthey plc	3.860.149	1,61	(Coste total: 229.385.981 GBP)			
2.460.165	Legal & General Group plc	5.877.334	2,44	* Diferencias menores debido al redondeo.			
3.207.600	Marks & Spencer Group plc	5.356.692	2,22				
1.832.170	Melrose Industries plc	3.050.563	1,27				
552.429	Morgan Advanced Materials plc						
		1.563.374	0,65				
163.996	Morgan Sindall plc	2.771.532	1,15				
213.140	Oxford Instruments plc	5.339.157	2,22				
1.099.007	Pearson plc	9.280.015	3,85				
188.811	Pennon Group plc	1.650.208	0,69				
1.399.397	Phoenix Group Holdings plc	7.646.305	3,18				
1.333.040	Rank Group plc	974.452	0,40				
302.450	RELX plc	7.918.141	3,29				
2.299.439	Rentokil Initial plc	13.603.481	5,64				
1.691.034	RS Group plc	15.456.051	6,41				
417.653	Smith & Nephew plc	4.686.067	1,95				
377.113	Smiths Group plc	6.473.145	2,68				
182.555	SSE plc	3.291.467	1,37				
749.745	Tate & Lyle plc	5.882.499	2,45				
2.195.313	Tesco plc	5.832.947	2,42				
391.881	Travis Perkins plc	3.747.950	1,56				
40.597	Unbound Group plc	3.451	0,00				

* Diferencias menores debido al redondeo.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

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)			
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				Renta variable (continuación)			
ESTADOS UNIDOS				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
22.850	Liveperson Inc. 0.00%	100.769	0,51	1.408	Hess Corp.	186.335	0,95
	Total de Estados Unidos	100.769	0,51	3.703	Hilton Worldwide Holdings Inc.	521.642	2,66
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				1.863	Hostess Brands Inc.	46.351	0,24
		100.769	0,51	580	Installed Building Products Inc.	66.137	0,34
Renta variable				1.440	Intuitive Surgical Inc.	367.877	1,87
CANADÁ				6.247	Kellogg Company	418.299	2,13
3.682	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	207.260	1,06	7.006	Kontoor Brands Inc.	339.020	1,73
	Total de Canadá	207.260	1,06	1.576	Lam Research Corp.	835.469	4,25
ISLAS CAIMÁN				59.433	Latham Group Inc.	169.978	0,87
6.247	Globalfoundries Inc.	450.908	2,30	10.425	Marvell Technology Inc.	451.403	2,30
	Total de Islas Caimán	450.908	2,30	6.010	Northern Trust Corp.	529.661	2,70
CURAZAO				41.091	NOV Inc.	760.594	3,87
5.020	Schlumberger Limited	246.482	1,26	8.492	Nutanix Inc. - A	220.707	1,12
	Total de Curazao	246.482	1,26	2.484	Planet Fitness Inc.	192.932	0,98
JERSEY - ISLAS DEL CANAL				3.957	Procter & Gamble Company	588.366	3,00
11.453	Clarivate plc	107.544	0,55	5.300	Prologis Inc.	661.281	3,37
	Total de Jersey - Islas del Canal	107.544	0,55	3.253	QUALCOMM Inc.	415.018	2,11
ESTADOS UNIDOS				8.719	REVOLUTION Medicines Inc.	188.854	0,96
11.147	Advanced Micro Devices Inc.	1.092.517	5,56	296	S&P Global Inc.	102.052	0,52
27.087	AES Corp.	652.255	3,32	3.318	Salesforce Inc.	662.871	3,37
4.742	Alphabet Inc. - A	491.888	2,51	3.564	Schnitzer Steel Industries Inc.	110.840	0,56
1.920	Applied Industrial Technologies Inc.	272.889	1,39	75.149	Sharecare Inc.	106.712	0,54
11.700	Aris Water Solutions Inc.	91.143	0,46	1.428	Sherwin-Williams Company	320.972	1,64
3.400	Beacon Roofing Supply Inc.	200.090	1,02	1.045	Shift4 Payments Inc.	79.211	0,40
1.783	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	173.379	0,88	3.248	Stanley Black & Decker Inc.	261.724	1,33
2.048	Catalent Inc.	134.574	0,69	7.590	State Street Corp.	574.488	2,93
492	Cintas Corp.	227.638	1,15	5.240	Teradata Corp.	211.067	1,08
2.037	Cirrus Logic Inc.	222.807	1,14	2.449	Teradyne Inc.	263.292	1,34
3.082	Coca Cola Company	191.176	0,97	3.340	TransUnion	207.548	1,06
869	Comed Corp.	90.254	0,46	2.419	Trimble Inc.	126.804	0,65
2.955	CrowdStrike Holdings Inc. - A	405.603	2,07	20.385	Uber Technologies Inc.	646.205	3,29
6.753	Darling International Inc.	394.375	2,01	1.080	United Parcel Service Inc.	209.509	1,07
7.175	Domo Inc.	101.813	0,52	1.229	Vertex Pharmaceuticals Inc.	387.221	1,98
3.925	Electronic Arts Inc.	472.766	2,41	2.462	Voya Financial Inc.	175.935	0,90
2.078	Exact Sciences Corp.	140.909	0,72	1.609	Walt Disney Company	161.109	0,82
567	Goldman Sachs Group Inc.	185.471	0,94	4.502	Westrock Company	137.176	0,70
913	Herc Holdings Inc.	103.991	0,53	6.220	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	291.594	1,48
				2.954	Xponential Fitness Inc.	89.772	0,46
					Total de Estados Unidos	17.731.564	90,32
					Total de renta variable	18.743.758	95,49
					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	18.844.527	96,00

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
3.647	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	3.647	0,02
	Total de Irlanda	3.647	0,02
	Total de fondos	3.647	0,02
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	3.647	0,02
	Valor total de las inversiones	18.848.174	96,02
	(Coste total: 18.253.926 USD)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

		Valor de mercado	% de valor			Valor de mercado	% de valor		
Valor nominal	Inversión	EUR	liquidativo*	Valor nominal	Inversión	EUR	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	1.215.101	0,28	EUR	3.793.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	3.662.454	0,84
EUR	1.098.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	837.712	0,20	EUR	3.318.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	3.286.648	0,77
EUR	1.100.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	839.238	0,20	Total de Francia		18.624.644	4,33	
EUR	2.120.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd 0.63% 25/08/2030	1.686.214	0,39	ALEMANIA				
EUR	1.307.000	NBN Company Limited 4.38% 15/03/2033	1.354.640	0,32	EUR	4.200.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	3.471.838	0,81
USD	1.950.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	1.732.879	0,40	EUR	1.500.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	1.108.698	0,26
Total de Australia		7.665.784	1,79	EUR	2.844.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	2.632.096	0,62	
BÉLGICA				EUR	2.700.000	Commerzbank AG FRN 29/12/2031	2.223.863	0,52	
EUR	6.700.000	Belfius Bank SA Perp FRN**	6.499.001	1,53	EUR	2.200.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	2.070.411	0,48
EUR	2.100.000	Elia Transmission Belgium SA 0.88% 28/04/2030	1.762.570	0,41	EUR	2.200.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	1.736.641	0,41
EUR	2.800.000	Kbc Group NV Perp FRN	2.366.969	0,55	USD	1.752.000	Deutsche Bank AG FRN 10/02/2034	1.502.139	0,35
Total de Bélgica		10.628.540	2,49	EUR	2.400.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	2.169.749	0,51	
ISLAS CAIMÁN				EUR	700.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	653.783	0,15	
GBP	4.970.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	4.899.383	1,14	EUR	1.100.000	Deutsche Lufthansa AG 3.75% 11/02/2028	1.005.646	0,23
GBP	5.506.000	Thames Water Kemble Finance plc 2.88% 03/05/2027	5.432.914	1,27	EUR	1.081.000	Gruenenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	1.023.273	0,24
Total de Islas Caimán		10.332.297	2,41	EUR	942.000	HT Troplast GmbH 9.25% 15/07/2025	934.994	0,22	
DINAMARCA				EUR	1.128.838	IHO Verwaltungs GmbH 8.75% 15/05/2028	1.157.591	0,27	
EUR	575.000	Danske Bank AS FRN 15/05/2031	507.030	0,12	EUR	558.000	Ineos Styrolution Group GmbH 2.25% 16/01/2027	485.535	0,11
USD	2.205.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	1.777.354	0,41	EUR	3.000.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	2.299.247	0,54
Total de Dinamarca		2.284.384	0,53	EUR	2.378.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	2.066.552	0,48	
FRANCIA				EUR	3.240.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	2.638.855	0,61	
EUR	1.209.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	1.129.417	0,26	EUR	1.300.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	1.193.293	0,28
USD	3.500.000	BNP Paribas SA FRN 12/07/2171	2.521.211	0,59	EUR	2.288.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 2.00% 15/07/2025	2.137.114	0,50
EUR	2.600.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	1.872.351	0,44	EUR	2.050.000	Thyssenkrupp AG 2.88% 22/02/2024	2.025.588	0,47
EUR	800.000	Electricite de France SA FRN 06/12/2171	784.634	0,18	EUR	900.000	Vier Gas Transport GmbH 4.00% 26/09/2027	904.739	0,21
EUR	1.165.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	1.023.075	0,24	EUR	3.000.000	Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	3.099.191	0,72
EUR	882.000	Faurecia SE 7.25% 15/06/2026	911.583	0,21					
EUR	3.531.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	3.433.271	0,80					

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)				ITALIA (continuación)					
EUR	2.700.000	Volkswagen Financial Services AG 0.88% 31/01/2028	2.320.015	0,54	EUR	100.000	Lottomatica SpA 5.13% 15/07/2025	98.832	0,02
EUR	500.000	Vonovia SE 5.00% 23/11/2030	468.940	0,11	EUR	362.000	Lottomatica SpA 6.25% 15/07/2025	361.779	0,09
Total de Alemania		41.329.791	9,64	EUR	1.096.000	Lottomatica SpA 9.75% 30/09/2027	1.164.879	0,27	
GIBRALTAR				EUR	1.500.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	1.489.954	0,35	
EUR	525.000	888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027	446.947	0,10	EUR	790.000	Telecom Italia SpA 6.88% 15/02/2028	808.338	0,19
Total de Gibraltar		446.947	0,10	Total de Italia		8.062.168	1,88		
GRECIA				JERSEY - ISLAS DEL CANAL					
EUR	2.400.000	Eurobank SA FRN 26/01/2029	2.339.648	0,55	EUR	286.352	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	285.721	0,07
Total de Grecia		2.339.648	0,55	EUR	6.500.000	Avis Budget Finance plc 4.13% 15/11/2024	6.479.692	1,51	
INDIA				GBP	416.000	Heathrow Funding Limited 6.45% 10/12/2031	504.532	0,12	
USD	2.080.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	1.464.700	0,35	Total de Jersey - Islas del Canal		7.269.945	1,70	
USD	1.729.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	1.397.684	0,32	LUXEMBURGO				
Total de India		2.862.384	0,67	EUR	1.423.000	Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	1.137.956	0,27	
IRLANDA				EUR	2.882.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	2.163.647	0,50	
EUR	1.275.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	1.156.400	0,27	EUR	3.300.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	2.215.220	0,52
EUR	1.716.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	1.602.431	0,37	EUR	3.600.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	2.241.273	0,52
EUR	3.710.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	3.189.797	0,74	GBP	1.855.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	1.334.546	0,31
EUR	2.747.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	2.609.846	0,61	EUR	2.826.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	2.310.617	0,54
Total de Irlanda		8.558.474	1,99	EUR	603.559	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	603.502	0,14	
ISLA DE MAN				EUR	1.613.000	Gamma Bondco Sarl 8.13% 15/11/2026	1.567.427	0,37	
EUR	1.207.547	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	1.204.162	0,28	EUR	437.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 6.75% 01/11/2025	336.622	0,08
Total de Isla de Man		1.204.162	0,28	GBP	931.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.75% 01/11/2025	807.084	0,19	
ITALIA				EUR	2.100.000	Grand City Properties SA - Perp FRN	752.895	0,18	
EUR	709.000	Autostrade per l'Italia SpA 4.75% 24/01/2031	700.799	0,16	EUR	6.124.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	5.224.512	1,22
EUR	1.444.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	1.239.299	0,29	EUR	1.025.563	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	1.020.711	0,24
EUR	2.461.000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	2.198.288	0,51					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*			Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valor nominal	Inversión			Valor nominal	Inversión				
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	1.500.000	Loarre Investments Sarl 6.50% 15/05/2029	1.400.085	0,33	EUR	3.635.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	3.540.992	0,82
EUR	840.000	Loarre Investments Sarl FRN 15/05/2029	810.587	0,19	EUR	1.038.000	Villa Dutch Bidco BV 9.00% 03/11/2029	984.104	0,23
EUR	3.200.000	Matterhorn Telecom SA 2.63% 15/09/2024	3.172.661	0,74	Total de Países Bajos			45.693.920	10,66
EUR	3.835.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	2.884.242	0,66					
EUR	1.673.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	1.556.251	0,36	ESPAÑA				
EUR	2.340.000	SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	2.150.756	0,50	EUR	2.800.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	2.334.070	0,54
Total de Luxemburgo		33.690.594	7,86	EUR	1.503.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	1.371.386	0,32	
				EUR	2.400.000	International Consolidated Airlines Group SA 0.50% 04/07/2023	2.377.794	0,56	
				EUR	2.439.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	2.245.648	0,52	
				Total de España			8.328.898	1,94	
PAÍSES BAJOS				SUECIA					
EUR	702.000	ASR Nederland NV FRN 07/12/2043	728.850	0,17	EUR	817.623	Intrum AB 3.13% 15/07/2024	787.017	0,18
EUR	1.000.000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/01/2025	989.923	0,23	EUR	3.731.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	3.457.449	0,80
EUR	4.300.000	Constellium SE 4.25% 15/02/2026	4.199.798	0,98	EUR	2.306.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	1.874.479	0,44
EUR	4.600.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/06/2169	3.520.986	0,82	EUR	1.252.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	1.113.464	0,26
EUR	3.600.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/06/2170	3.109.287	0,73	EUR	170.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	151.189	0,04
EUR	3.028.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	2.946.715	0,69	EUR	380.000	Verisure Holding AB 7.13% 01/02/2028	381.169	0,09
GBP	1.718.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	2.062.023	0,48	EUR	642.000	Verisure Holding AB 9.25% 15/10/2027	690.523	0,16
USD	4.600.000	ING Groep NV FRN 16/11/2170	3.074.923	0,72	Total de Suecia			8.455.290	1,97
EUR	1.000.000	OI European Group BV 2.88% 15/02/2025	974.889	0,23	SUIZA				
EUR	1.391.000	Sagax Euro Mtn NL BV 0.75% 26/01/2028	1.020.323	0,24	USD	2.876.000	Credit Suisse AG 5.00% 09/07/2027	2.551.194	0,60
EUR	4.700.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	3.895.402	0,90	EUR	3.100.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	2.035.512	0,47
EUR	2.920.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	2.458.514	0,57	USD	5.205.000	UBS Group AG Perp FRN	4.552.287	1,06
EUR	3.140.000	Stichting AK Rabobank Certificaten 6.50% 29/03/2070	3.040.178	0,71	Total de Suiza			9.138.993	2,13
EUR	2.738.715	Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	2.148.887	0,50	REINO UNIDO				
EUR	300.000	Telefonica Europe BV FRN 23/11/2171	306.068	0,07	EUR	2.300.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	1.713.146	0,40
EUR	1.600.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	1.333.326	0,31	GBP	1.973.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	1.467.257	0,34
EUR	900.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	880.514	0,21	EUR	2.838.000	British American Tobacco plc FRN 27/12/2169	2.316.608	0,54
EUR	4.200.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	3.154.511	0,74					
EUR	1.430.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	1.323.707	0,31					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*			Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valor nominal	Inversión			Valor nominal	Inversión				
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	397.500	Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	421.973	0,10	EUR	1.609.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	1.387.808	0,32
EUR	2.258.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	1.821.672	0,43	EUR	3.220.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	2.963.488	0,69
GBP	3.028.000	Co-Operative Bank Finance plcT FRN 06/04/2027	3.234.938	0,75	GBP	1.769.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	1.802.818	0,42
GBP	1.801.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	1.711.842	0,40	GBP	4.904.213	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	5.531.644	1,29
EUR	3.308.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	3.057.584	0,71	GBP	1.940.000	Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	1.955.072	0,46
EUR	6.500.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	6.336.285	1,48	EUR	1.490.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	1.208.422	0,28
EUR	6.600.000	HSBC Holdings plc FRN 04/01/2066	5.336.167	1,24	EUR	695.000	Vmed O2 UK Financing I plc 3.25% 31/01/2031	568.864	0,13
GBP	1.001.000	HSBC Holdings plc FRN 16/11/2034	1.198.124	0,28	GBP	2.767.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.00% 31/01/2029	2.611.455	0,62
EUR	521.000	INEOS Finance plc 2.13% 15/11/2025	489.857	0,11	USD	3.500.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	3.153.785	0,74
EUR	1.337.000	INEOS Finance plc 3.38% 31/03/2026	1.254.423	0,29	GBP	1.400.000	Western Power Distribution plc 3.50% 16/10/2026	1.504.886	0,35
EUR	1.217.000	INEOS Finance plc 6.63% 15/05/2028	1.229.062	0,29	GBP	3.634.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	3.128.935	0,73
EUR	787.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	708.357	0,17	Total de Reino Unido		82.716.784	19,31	
EUR	294.217	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	292.807	0,07	ESTADOS UNIDOS				
EUR	2.200.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	2.128.494	0,50	EUR	2.541.000	Air Products and Chemicals Inc. 4.00% 03/03/2035	2.558.801	0,60
EUR	1.466.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	1.443.057	0,34	USD	1.426.000	Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	1.207.238	0,28
GBP	2.376.000	Jerrold Finco plc 4.88% 15/01/2026	2.342.825	0,55	USD	932.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	877.562	0,20
GBP	1.251.766	Mitchells & Butlers Finance plc 5.57% 15/12/2030	1.380.650	0,32	USD	2.578.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	2.439.177	0,58
GBP	49.877	Mitchells & Butlers Finance plc 5.97% 15/12/2023	55.912	0,01	EUR	2.086.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	1.727.464	0,40
GBP	2.033.412	Mitchells & Butlers Finance plc 6.01% 15/12/2028	2.159.780	0,51	EUR	920.000	Bank of America Corp. FRN 24/05/2032	723.975	0,17
EUR	1.117.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	1.095.554	0,26	USD	1.853.000	Bank of America Corp. FRN 22/04/2032	1.424.515	0,33
EUR	2.253.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	1.823.853	0,43	EUR	2.453.000	Berkshire Hathaway Finance Corp. 1.50% 18/03/2030	2.159.228	0,50
EUR	1.856.000	NatWest Group plc FRN 14/09/2032	1.521.236	0,35	EUR	1.050.000	Berry Global Inc. 1.00% 15/01/2025	998.735	0,23
EUR	3.866.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	3.256.305	0,76	EUR	1.630.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	1.470.409	0,34
EUR	2.140.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	1.984.758	0,46	EUR	5.114.000	Digital Euro Finco LLC 1.13% 09/04/2028	4.196.423	0,99
GBP	3.100.000	Santander UK plc Perp 10.06%	5.117.081	1,19	EUR	1.208.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	1.189.044	0,28
					EUR	3.073.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	2.952.086	0,68
					EUR	3.019.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.87% 03/08/2027	2.930.392	0,68

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado	% de valor			Valor de mercado	% de valor			
Valor nominal	Inversión	EUR	liquidativo*	Valor nominal	Inversión	EUR	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						
Bonos (continuación)				Bonos						
ESTADOS UNIDOS (continuación)				PAÍSES BAJOS						
GBP	1.608.000	Ford Motor Credit Company LLC 6.86% 05/06/2026	1.828.210	0,43	USD	2.956.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	2.702.106	0,63	
USD	2.819.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	2.174.032	0,51	Total de Países Bajos			2.702.106	0,63	
USD	1.840.000	JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	1.407.413	0,33	ESTADOS UNIDOS					
USD	1.829.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	1.415.654	0,33	USD	860.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	888.694	0,21	
USD	810.000	Lowe's Companies Inc. 5.80% 15/09/2062	753.530	0,18	Total de Estados Unidos			888.694	0,21	
GBP	962.000	Morgan Stanley FRN 18/11/2033	1.116.758	0,26	Total de bonos			3.590.800	0,84	
GBP	810.000	MPT Operating Partnership LP 2.55% 05/12/2023	877.354	0,20	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				3.590.800	0,84
EUR	1.242.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	1.198.965	0,28	Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario					
EUR	4.000.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	3.936.012	0,92	Bonos					
EUR	640.000	Netflix Inc. 4.63% 15/05/2029	654.259	0,15	AUSTRALIA					
USD	845.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	821.975	0,19	USD	3.582.000	APA Infrastructure Limited 4.25% 15/07/2027	3.192.496	0,74	
USD	775.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	783.328	0,18	Total de Australia			3.192.496	0,74	
USD	1.430.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	1.532.566	0,36	BERMUDAS					
USD	1.338.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	1.095.451	0,26	USD	9.121.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	8.344.218	1,95	
EUR	4.149.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	4.052.255	0,95	Total de Bermudas			8.344.218	1,95	
GBP	3.515.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	3.862.174	0,90	PORTUGAL					
USD	5.735.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	4.286.037	1,00	EUR	12.900.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	1.419.000	0,33	
Total de Estados Unidos		58.651.022	13,69	Total de Portugal			1.419.000	0,33		
Total de bonos		368.284.669	85,92	REINO UNIDO						
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				GBP	4.319.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	4.612.257	1,08		
ALEMANIA				GBP	2.009.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	1.915.016	0,45		
GBP	11.400.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.88% 15/09/2026	11.645.664	2,72	Total de Reino Unido			6.527.273	1,53	
Total de Alemania		11.645.664	2,72	Total de bonos			19.482.987	4,55		
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			19.482.987	4,55		
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		379.930.333	88,64							

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			
Fondos			
IRLANDA			
10.122	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	1.000.544	0,23
951.941	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	1.083.370	0,25
45.545	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	41.921	0,01
33.057	Insight Liquidity Funds plc	37.621	0,01
	Total de Irlanda	2.163.456	0,50
	Total de fondos	2.163.456	0,50
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	2.163.456	0,50
	Valor total de las inversiones	405.167.576	94,53
	(Coste total: 456.035.102 EUR)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

** Título a su valor razonable.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

		Valor de mercado		% de valor				Valor de mercado		% de valor	
Valor nominal	Inversión	EUR	liquidativo*	Valor nominal	Inversión	EUR	liquidativo*	Valor nominal	Inversión	EUR	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	128.293	0,72	USD	300.000	BNP Paribas SA FRN 12/07/2171	216.104	1,21		
USD	139.000	APA Infrastructure Limited 4.25% 15/07/2027	123.885	0,69	EUR	200.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	144.027	0,81		
EUR	100.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	76.294	0,43	EUR	100.000	BPCE SA FRN 02/03/2030	101.466	0,57		
EUR	228.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd 0.63% 25/08/2030	181.348	1,01	EUR	200.000	Credit Agricole SA 4.00% 18/01/2033	204.308	1,14		
EUR	190.000	Australia & New Zealand Banking Group Limited FRN 03/02/2033	190.265	1,06	EUR	100.000	Electricite de France SA 4.25% 25/01/2032	99.306	0,56		
EUR	100.000	NBN Company Limited 4.38% 15/03/2033	103.645	0,58	EUR	141.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	114.975	0,64		
GBP	110.000	Pacific National Finance Pty Limited 5.00% 19/09/2023	124.104	0,70	EUR	100.000	La Banque Postale SA FRN 26/01/2031	88.352	0,49		
USD	150.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	133.299	0,75	Total de Francia			968.538	5,42		
Total de Australia				1.061.133	5,94						
BÉLGICA				ALEMANIA							
EUR	200.000	Elia Transmission Belgium SA 0.88% 28/04/2030	167.864	0,94	EUR	300.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	247.989	1,38		
EUR	200.000	Kbc Group NV Perp FRN	169.069	0,95	EUR	300.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	221.740	1,24		
Total de Bélgica				336.933	1,89	EUR	100.000	Commerzbank AG FRN 29/12/2031	82.365	0,46	
						EUR	100.000	Commerzbank AG FRN 18/01/2030	98.622	0,55	
						EUR	200.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	157.876	0,88	
						EUR	1.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.01% 05/05/2027	889.494	4,97	
						EUR	300.000	Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	309.920	1,73	
						Total de Alemania			2.008.006	11,21	
ISLAS CAIMÁN				IRLANDA							
GBP	100.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	98.579	0,55	EUR	125.000	Aib Group plc FRN 30/05/2031	113.373	0,63		
GBP	200.000	Thames Water Kemble Finance plc 2.38% 03/05/2023	227.008	1,27	EUR	190.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	163.359	0,91		
Total de Islas Caimán				325.587	1,82	Total de Irlanda			276.732	1,54	
DINAMARCA				ITALIA							
USD	242.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	195.066	1,09	EUR	140.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	113.536	0,63		
Total de Dinamarca				195.066	1,09	Total de Italia			113.536	0,63	
FINLANDIA				JERSEY - ISLAS DEL CANAL							
EUR	203.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	172.132	0,96	GBP	96.000	Heathrow Funding Limited 6.45% 10/12/2031	116.431	0,65		
Total de Finlandia				172.132	0,96	Total de Jersey - Islas del Canal			116.431	0,65	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

Estado de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado	% de valor			Valor de mercado	% de valor		
Valor nominal	Inversión	EUR	liquidativo*	Valor nominal	Inversión	EUR	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				SUIZA (continuación)					
EUR	200.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	134.256	0,75	EUR	100.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	65.662	0,37
EUR	200.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	124.515	0,70	USD	200.000	UBS Group AG Perp FRN	174.920	0,98
EUR	100.000	Grand City Properties SA 0.13% 11/01/2028	70.704	0,40	Total de Suiza		424.551	2,38	
EUR	200.000	Grand City Properties SA - Perp FRN	71.704	0,40	REINO UNIDO				
USD	200.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl 6.13% 23/02/2038	189.732	1,07	GBP	149.000	Anglian Water Osprey Financing plc 2.00% 31/07/2028	136.929	0,77
EUR	268.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	201.558	1,13	EUR	100.000	Anglo American Capital plc 5.00% 15/03/2031	102.725	0,57
EUR	231.000	SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	212.318	1,19	EUR	100.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	74.485	0,42
Total de Luxemburgo		1.004.787	5,64	GBP	300.000	BAT International Finance plc 2.25% 26/06/2028	280.910	1,57	
PAÍSES BAJOS				USD	69.000	BP Capital Markets plc FRN 22/09/2168	60.917	0,34	
EUR	100.000	ASR Nederland NV FRN 07/12/2043	103.825	0,58	GBP	100.000	Co-Operative Bank Finance plcT FRN 06/04/2027	106.834	0,60
EUR	400.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/06/2169	306.172	1,71	EUR	32.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	31.194	0,17
EUR	200.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/06/2170	172.738	0,97	EUR	438.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	426.967	2,38
GBP	130.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	156.032	0,87	EUR	400.000	HSBC Holdings plc FRN 04/01/2066	323.403	1,81
USD	400.000	ING Groep NV FRN 16/11/2170	267.384	1,50	GBP	100.000	HSBC Holdings plc FRN 16/11/2034	119.693	0,67
GBP	100.000	ING Groep NV FRN 20/05/2033	111.425	0,62	GBP	40.187	Marston's Issuer plc FRN 15/10/2027	42.253	0,24
EUR	160.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	132.609	0,74	GBP	85.086	Mitchells & Butlers Finance plc FRN 15/12/2028	88.724	0,50
EUR	387.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	325.838	1,83	EUR	100.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	98.080	0,55
EUR	100.000	TenneT Holding BV 4.50% 28/10/2034	107.685	0,60	EUR	210.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	170.000	0,95
EUR	100.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	75.107	0,42	EUR	213.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	179.408	1,00
GBP	200.000	Volkswagen Financial Services NV 1.38% 14/09/2028	185.531	1,04	GBP	100.000	Northumbrian Water Finance plc 4.50% 14/02/2031	108.176	0,60
Total de Países Bajos		1.944.346	10,88	GBP	150.000	Santander UK plc Perp 10.06% 161.706	247.601	1,38	
SUECIA				GBP	161.706	Tesco Property Finance 1 plc 7.62% 13/07/2039	208.218	1,16	
EUR	468.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	380.424	2,12	EUR	200.000	Thames Water Kemble Finance plc 0.19% 23/10/2023	196.317	1,10
Total de Suecia		380.424	2,12	GBP	100.000	Wessex Water Services Finance plc 5.13% 31/10/2032	112.398	0,63	
SUIZA				Total de Reino Unido		3.115.232	17,41		
EUR	100.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	78.910	0,44					
EUR	160.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	105.059	0,59					

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 negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente						
Bonos (continuación)					Bonos						
ESTADOS UNIDOS					PAÍSES BAJOS						
EUR	156.000	Air Products and Chemicals Inc. 4.00% 03/03/2035	157.093	0,88	USD	50.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	45.705	0,26		
USD	250.000	Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	211.648	1,18	Total de Países Bajos					45.705	0,26
USD	94.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	88.509	0,49	Total de bonos					45.705	0,26
USD	232.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	219.507	1,24	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente					45.705	0,26
USD	147.000	Bank of America Corp. FRN 22/04/2032	113.008	0,63							
EUR	289.000	Digital Euro Finco LLC 1.13% 09/04/2028	237.146	1,33	Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario						
USD	181.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	139.588	0,78	Bonos						
USD	131.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	101.395	0,57	BERMUDAS						
EUR	248.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	239.407	1,34	USD	233.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	213.157	1,19		
USD	119.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	97.428	0,54	Total de Bermudas					213.157	1,19
USD	200.000	Stellantis Finance USA Inc. 6.38% 12/09/2032	193.219	1,08	Total de bonos					213.157	1,19
GBP	195.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	214.260	1,20	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario					213.157	1,19
USD	316.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	236.162	1,32							
Total de Estados Unidos			2.248.370	12,58							
Total de bonos			14.691.804	82,16							
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios						
					Fondos						
ALEMANIA					IRLANDA						
GBP	700.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.13% 04/07/2025	746.360	4,17	7.720	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	763.152	4,27			
Total de Alemania			746.360	4,17	Total de Irlanda					763.152	4,27
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			746.360	4,17	Total de fondos					763.152	4,27
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			15.438.164	86,33	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios					763.152	4,27
					Valor total de las inversiones					16.460.178	92,05
					(Coste total: 18.185.794 EUR)						

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

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				SUIZA			
26.619	Novo Nordisk AS	3.879.952	4,97	21.107	Compagnie Financiere		
22.018	Pandora A/S	1.937.176	2,48		Richemont SA - Reg	3.102.700	3,97
	Total de Dinamarca	5.817.128	7,45	18.528	Novartis AG - Reg	1.563.591	2,00
				3.470	Swatch Group AG - B	1.095.687	1,40
				196.979	UBS Group AG	3.828.337	4,91
					Total de Suiza	9.590.315	12,28
FRANCIA				REINO UNIDO			
18.908	Air Liquide SA	2.915.614	3,73	199.217	3i Group plc	3.820.262	4,89
63.340	Compagnie de Saint-Gobain	3.313.949	4,24	55.689	Burberry Group plc	1.638.946	2,10
871	Hermes International	1.623.544	2,08	18.055	Compass Group plc	417.736	0,53
1.347	Kering SA	808.200	1,04	59.716	InterContinental Hotels Group		
4.523	Legrand SA	380.294	0,49		plc	3.610.070	4,62
8.675	L'Oreal SA	3.567.594	4,57	113.102	RELX plc	3.369.820	4,32
4.520	LVMH Moet Hennessy Louis				Total de Reino Unido	12.856.834	16,46
	Vuitton SE	3.816.687	4,89		Total de renta variable	73.806.142	94,51
18.450	Pernod-Ricard SA	3.850.515	4,93		Total de valores mobiliarios e instrumentos		
49.718	Publicis Groupe SA	3.568.758	4,57		del mercado monetario admitidos		
	Total de Francia	23.845.155	30,54		oficialmente a cotización en bolsa	73.806.142	94,51
ALEMANIA				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
30.804	Beiersdorf AG	3.694.940	4,73	Fondos			
	Total de Alemania	3.694.940	4,73	IRLANDA			
ITALIA				17.816	BlackRock ICS Euro Liquidity		
47.063	Moncler SpA	2.990.383	3,83		Fund	1.761.093	2,26
	Total de Italia	2.990.383	3,83		Total de Irlanda	1.761.093	2,26
JERSEY - ISLAS DEL CANAL					Total de fondos	1.761.093	2,26
333.818	WPP plc	3.641.782	4,66		Total de organismos de inversión colectiva en		
	Total de Jersey - Islas del				valores mobiliarios	1.761.093	2,26
	Canal	3.641.782	4,66		Valor total de las inversiones	75.567.235	96,77
PAÍSES BAJOS					(Coste total: 68.115.751 EUR)		
2.241	ASM International NV	833.428	1,07	* Diferencias menores debido al redondeo.			
1.363	ASML Holding NV	852.148	1,09				
51.794	Davide Campari-Milano NV	582.683	0,75				
40.672	STMicroelectronics NV	1.991.097	2,55				
18.622	Wolters Kluwer NV	2.166.670	2,77				
	Total de Países Bajos	6.426.026	8,23				
SUECIA							
134.549	Epiroc AB	2.457.850	3,15				
127.408	Sandvik AB	2.485.729	3,18				
	Total de Suecia	4.943.579	6,33				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
Renta variable			
CANADÁ			
13.212	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	743.703	0,84
	Total de Canadá	743.703	0,84
ISLAS CAIMÁN			
24.376	Globalfoundries Inc.	1.759.460	1,98
	Total de Islas Caimán	1.759.460	1,98
CURAZAO			
21.803	Schlumberger Limited	1.070.527	1,20
	Total de Curazao	1.070.527	1,20
ESTADOS UNIDOS			
17.870	Advanced Micro Devices Inc.	1.751.439	1,97
147.097	AES Corp.	3.542.096	3,99
21.450	Alphabet Inc. - A	2.225.009	2,50
8.336	Applied Industrial Technologies Inc.	1.184.796	1,33
32.866	Aris Water Solutions Inc.	256.026	0,29
14.766	Beacon Roofing Supply Inc.	868.979	0,98
7.820	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	760.417	0,86
9.483	Catalent Inc.	623.128	0,70
2.079	Cintas Corp.	961.912	1,08
6.199	Cirrus Logic Inc.	678.047	0,76
27.602	Coca Cola Company	1.712.152	1,93
4.235	Conmed Corp.	439.847	0,49
16.623	CrowdStrike Holdings Inc. - A	2.281.673	2,57
28.597	Darling International Inc.	1.670.065	1,88
32.848	Domo Inc.	466.113	0,52
12.263	Exact Sciences Corp.	831.554	0,94
2.565	Goldman Sachs Group Inc.	839.037	0,94
5.321	Herc Holdings Inc.	606.062	0,68
6.476	Hess Corp.	857.034	0,96
31.173	Hilton Worldwide Holdings Inc.	4.391.341	4,94
8.397	Hostess Brands Inc.	208.917	0,24
2.587	Installed Building Products Inc.	294.996	0,33
12.420	Intuitive Surgical Inc.	3.172.938	3,58
23.119	Kellogg Company	1.548.048	1,74
49.424	Kontoor Brands Inc.	2.391.627	2,69
8.657	Lam Research Corp.	4.589.248	5,16
45.702	Marvell Technology Inc.	1.978.896	2,23
10.399	Microsoft Corp.	2.998.032	3,37
34.590	Northern Trust Corp.	3.048.417	3,43
205.951	NOV Inc.	3.812.153	4,29
5.581	Procter & Gamble Company	829.839	0,93
18.139	Prologis Inc.	2.263.203	2,55
22.963	QUALCOMM Inc.	2.929.619	3,30
1.315	S&P Global Inc.	453.373	0,51

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)			
18.065	Salesforce Inc.	3.609.025	4,06
37.314	Schnitzer Steel Industries Inc.	1.160.465	1,31
393.139	Sharecare Inc.	558.257	0,63
6.315	Sherwin-Williams Company	1.419.423	1,60
4.704	Shift4 Payments Inc.	356.563	0,40
14.078	Stanley Black & Decker Inc.	1.134.405	1,28
63.592	State Street Corp.	4.813.278	5,42
29.050	Teradata Corp.	1.170.134	1,32
6.949	Teradyne Inc.	747.087	0,84
19.789	TransUnion	1.229.689	1,38
10.880	Trimble Inc.	570.330	0,64
89.177	Uber Technologies Inc.	2.826.911	3,18
5.689	United Parcel Service Inc.	1.103.609	1,24
5.719	Vertex Pharmaceuticals Inc.	1.801.885	2,02
22.793	Voya Financial Inc.	1.628.788	1,83
4.710	Walt Disney Company	471.612	0,53
25.276	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	1.184.939	1,33
14.777	Xponential Fitness Inc.	449.073	0,51
	Total de Estados Unidos	83.701.506	94,18
	Total de renta variable	87.275.196	98,20
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	87.275.196	98,20
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
520.573	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	520.573	0,59
	Total de Irlanda	520.573	0,59
	Total de fondos	520.573	0,59
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	520.573	0,59
	Valor total de las inversiones	87.795.769	98,79
	(Coste total: 90.132.022 USD)		

* 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 31 de marzo de 2023

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				JAPÓN			
3.874	CSL Limited	748.027	0,92	3.400	Keyence Corp.	1.646.479	2,04
	Total de Australia	748.027	0,92	11.300	Sony Group Corp.	1.017.586	1,26
CANADÁ				PAÍSES BAJOS			
6.865	Nutrien Limited	506.296	0,63	10.742	Akzo Nobel NV	840.053	1,04
	Total de Canadá	506.296	0,63	5.286	Koninklijke DSM NV	624.261	0,77
DINAMARCA				Total de Países Bajos			
6.107	Novo Nordisk AS	967.102	1,19			1.464.314	1,81
14.739	Orsted A/S	1.254.091	1,54	NORUEGA			
	Total de Dinamarca	2.221.193	2,73	43.152	Equinor ASA	1.230.728	1,52
FRANCIA				Total de Noruega			
26.964	AXA SA	825.095	1,02			1.230.728	1,52
3.603	EssilorLuxottica SA	649.804	0,80	REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
1.956	L'Oreal SA	873.946	1,08	1.455	Samsung Sdi Company Limited	821.468	1,01
902	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	827.493	1,02		Total de República de Corea (Sur)	821.468	1,01
5.310	Schneider Electric SE	886.588	1,09	SINGAPUR			
38.973	TotalEnergies SE	2.301.723	2,85	50.200	DBS Group Holdings Limited	1.245.985	1,54
	Total de Francia	6.364.649	7,86		Total de Singapur	1.245.985	1,54
ALEMANIA				SUIZA			
3.514	Adidas AG	621.459	0,77	1.368	Lonza Group AG - Reg	819.707	1,01
	Total de Alemania	621.459	0,77		Total de Suiza	819.707	1,01
INDIA				TAIWÁN			
237.673	HDFC Bank Limited	4.654.827	5,74	108.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	1.890.574	2,34
54.599	Kotak Mahindra Bank Limited	1.151.237	1,42		Total de Taiwán	1.890.574	2,34
	Total de India	5.806.064	7,16	REINO UNIDO			
INDONESIA				20.454	Anglo American plc	677.276	0,84
1.759.949	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	555.165	0,69	22.167	Diageo plc	990.539	1,22
	Total de Indonesia	555.165	0,69	16.953	Reckitt Benckiser Group plc	1.290.811	1,59
IRLANDA				40.657	Shell plc	1.160.491	1,43
896	CRH plc	45.242	0,06	42.853	SSE plc	955.330	1,18
3.920	Linde plc	1.393.325	1,72		Total de Reino Unido	5.074.447	6,26
	Total de Irlanda	1.438.567	1,78				

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				IRLANDA			
10.515	Abbott Laboratories	1.064.749	1,31	2.255.696	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.255.696	2,79
1.214	Adobe Inc.	467.839	0,58				
6.115	Advanced Micro Devices Inc.	599.331	0,74		Total de Irlanda	2.255.696	2,79
2.041	Alphabet Inc. - A	211.713	0,26				
38.905	Amazon.com Inc.	4.018.498	4,97		Total de fondos	2.255.696	2,79
3.305	Cooper Companies Inc.	1.233.954	1,53		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	2.255.696	2,79
4.170	Crowdstrike Holdings Inc. - A	572.374	0,71		Valor total de las inversiones	73.822.965	91,16
1.856	Deere & Company	766.305	0,95				
13.904	Ecolab Inc.	2.301.529	2,84		(Coste total: 70.911.032 USD)		
9.143	Electronic Arts Inc.	1.101.274	1,36				
2.808	Elevance Health Inc.	1.291.146	1,59				
4.376	Eli Lilly & Company	1.502.806	1,86				
642	Equinix Inc.	462.908	0,57				
8.077	IntercontinentalExchange Inc.	842.350	1,04				
4.837	Intuit Inc.	2.156.480	2,66				
2.986	JPMorgan Chase & Company	389.106	0,48				
3.192	Mastercard Inc. - A	1.160.005	1,43				
1.403	Mercadolibre Inc.	1.849.238	2,29				
14.375	Micron Technology Inc.	867.388	1,07				
9.829	NextEra Energy Inc.	757.619	0,94				
4.167	NVIDIA Corp.	1.157.468	1,43				
10.277	ON Semiconductor Corp.	846.003	1,04				
9.437	Paypal Holdings Inc.	716.646	0,88				
7.597	PepsiCo Inc.	1.384.933	1,71				
11.171	QUALCOMM Inc.	1.425.196	1,76				
2.395	Thermo Fisher Scientific Inc.	1.380.406	1,70				
22.200	T-Mobile USA Inc.	3.215.448	3,97				
15.502	Trimble Inc.	812.615	1,00				
51.644	Uber Technologies Inc.	1.637.115	2,02				
3.855	Union Pacific Corp.	775.857	0,96				
11.248	Walt Disney Company	1.126.262	1,39				
	Total de Estados Unidos	38.094.561	47,04				
	Total de renta variable	71.567.269	88,37				
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	71.567.269	88,37				

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

Estado de la Cartera

a 31 de marzo de 2023

		Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*			Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valor nominal	Inversión			Valor nominal	Inversión				
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				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				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					
ESTADOS UNIDOS				ESTADOS UNIDOS					
USD	19.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 07/09/2023	18.613.453	9,33	USD	29.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 11/04/2023	28.970.516	14,52
Total de Estados Unidos			18.613.453	9,33	USD	29.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 18/04/2023	28.945.022	14,51
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			18.613.453	9,33	USD	30.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 25/04/2023	29.916.903	15,00
Instrumentos estructurados - Materias primas					USD	32.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 04/05/2023	31.874.828	15,99
IRLANDA					USD	32.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 11/05/2023	31.846.141	15,97
1.563	Invesco Physical Gold ETC 0.00%		298.689	0,15	USD	17.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 18/05/2023	16.902.570	8,47
Total de Irlanda			298.689	0,15	Total de Estados Unidos			168.455.980	84,46
Total de instrumentos estructurados - Materias primas			298.689	0,15	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			168.455.980	84,46
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			18.912.142	9,48	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente			168.455.980	84,46
Valor total de las inversiones					Valor total de las inversiones			187.368.122	93,94
					(Coste total: 186.671.892 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 Carteras separadas (las «Carteras»). Cada una de ellas tiene un objetivo de inversión diferente y es una Cartera separada de activos representados por Acciones separadas. Cada Cartera puede tener una o más Clases de Acciones (las «Clases de Acciones») relacionadas con ella. La SICAV en su conjunto, incluidas todas las Carteras actuales y todas las Carteras futuras, es una persona jurídica. Sin embargo, con respecto a terceros y, en particular, con respecto a los acreedores de la SICAV y entre Accionistas, cada Cartera será exclusivamente responsable de todos los pasivos que se le atribuyan.

Acontecimientos significativos durante el año:

Nuevos folletos

Se han publicado nuevos folletos en julio de 2022 y enero de 2023.

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.

Cierre de cartera

Con efecto a partir del 21 de mayo de 2021, la Cartera Threadneedle (Lux) – STANLIB Africa Equity está en liquidación y el reembolso final se pagó el 23 de enero de 2023.

Lanzamiento de clases de acciones

Las siguientes clases de acciones se lanzaron durante el ejercicio cerrado a 31 de marzo de 2023:

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

Las siguientes clases de acciones se cerraron durante el ejercicio cerrado a 31 de marzo de 2023:

AEP	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	23 de marzo de 2023
IE	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	27 de marzo de 2023
IEP	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	23 de marzo de 2023
LE	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	28 de marzo de 2023
LEP	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	23 de marzo de 2023
ZE	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	23 de marzo de 2023
ZEP	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	23 de marzo de 2023

A 31 de marzo de 2023, 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

Notas a los estados financieros

(continuación)

1 GENERAL

(continuación)

Las Carteras de renta variable:

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

Las Carteras de rendimiento absoluto:

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

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 31 de marzo de 2023, 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 calculan a 31 de marzo de 2023. El último Valor liquidativo oficial de las Carteras correspondientes se calculó el 31 de marzo de 2023.

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 y para el que se produjo el reembolso final el 23 de enero de 2023, para Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return Portfolio, que se puso en liquidación el 28 de abril de 2023 y para Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities Portfolio y Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha Portfolio, que se pusieron en liquidación el 13 de julio de 2023. Como tal, los estados financieros de estas Carteras se han preparado sobre una base de empresa no consolidada, y cualquier gasto adicional respecto al cierre de estas Carteras correrá a cargo de la Sociedad Gestora.

Notas a los estados financieros

(continuación)

2 RESUMEN DE POLÍTICAS CONTABLES SIGNIFICATIVAS

(continuación)

I) Valoración de valores

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

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

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

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

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. Los contratos de futuros abiertos se valoran a los precios del mercado de valores para el cual se negocian los contratos. El movimiento neto en la ganancia/(pérdida) no realizada que surge de los contratos de divisas a plazo se registra en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto. Los contratos vigentes a 31 de marzo de 2023 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 31 de marzo de 2023 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 31 de marzo de 2023 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 31 de marzo de 2023 se muestran en el Programa de inversiones. Las opciones de venta libre («OTC», por sus siglas en inglés) se valoran según los precios recibidos de los agentes o los modelos de precios de terceros. Dichas opciones abiertas a 31 de marzo de 2023 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 año, las transacciones, los ingresos y los gastos denominados en una divisa distinta de la divisa base se registran sobre la base de los tipos de cambio vigentes en la fecha en que ocurren o se acumulan en la Cartera.

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

Notas a los estados financieros

(continuación)

2 RESUMEN DE POLÍTICAS CONTABLES SIGNIFICATIVAS

(continuación)

El Estado consolidado del patrimonio neto y el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto se presentan en USD en función de los tipos de cambio vigentes en la fecha del Estado del patrimonio neto. Los tipos de cambio utilizados a 31 de marzo de 2023 son: 1 USD = 1,493094 AUD, 1 USD = 0,920429 EUR, 1 USD = 0,808767 GBP, 1 USD = 0,913550 CHF, 1 USD = 10,369572 SEK, 1 USD = 6,856547 DKK, 1 USD = 10,473069 NOK, 1 USD = 7,849971 HKD 1 USD = 1,329550 SGD.

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

VII) Efectivo en el banco

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

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

VIII) Depósitos a plazo

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

IX) Transacciones de inversión e ingresos por inversiones

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

Los resultados sobre las ventas de valores se determinan en función del método del coste promedio. Las transacciones de inversión se contabilizan en la fecha de transacción. Los dividendos se contabilizan en 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.

Notas a los estados financieros

(continuación)

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 ejercicio que finaliza el 31 de marzo de 2023, la SICAV no realizó transacciones con personas relacionadas.

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

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 233 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 233 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.

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				
	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
	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

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

ACCIONES B:

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

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

ACCIONES D:

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

Los costes de venta son los máximos, a los que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en 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

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 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

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

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 (continuación)				
	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
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

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

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
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%

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

Los costes de venta son los máximos, a los que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en 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
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
	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

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 (continuación)				
	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
	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

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 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

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

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

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

ACCIONES 4:

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

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

ACCIONES 8:

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

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

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				
(continuación)				
	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
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75%	0,09%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75%	0,14%	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75%	0,08%	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75%	0,09%	GBP
Cartera de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75%	0,15%	USD

* Consulte la Nota 1.

¹ 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.

Notas a los estados financieros

(continuación)

6 ACUERDOS DE REPARTO DE COMISIONES

La Sociedad Gestora y algunos Subasesores podrán celebrar acuerdos de reparto de comisiones con corredores de bolsa/agentes en virtud de los cuales determinados servicios comerciales se 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 el Subasesor Columbia Management Investment Advisors, LLC puede celebrar acuerdos de reparto de comisiones.

7 DIVIDENDOS

La SICAV declaró los siguientes dividendos durante el ejercicio cerrado a 31 de marzo de 2023:

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 AEC	22/12/2022	EUR	0,075	121.935
	Clase AEC	27/03/2023	EUR	0,087	147.580
	Clase AUP	24/06/2022	USD	0,082	9.754
	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,086	10.591
	Clase AUP	22/12/2022	USD	0,091	10.285
	Clase AUP	27/03/2023	USD	0,101	11.643
	Clase DEC	24/06/2022	EUR	0,064	6.059
	Clase DEC	26/09/2022	EUR	0,069	6.318
	Clase DEC	22/12/2022	EUR	0,068	6.810
	Clase DEC	27/03/2023	EUR	0,079	7.160
	Clase DUP	24/06/2022	USD	0,074	4.718
	Clase DUP	26/09/2022	USD	0,079	4.845
	Clase DUP	22/12/2022	USD	0,081	4.987
	Clase DUP	27/03/2023	USD	0,091	5.033
	Clase IEC	24/06/2022	EUR	0,071	26.772
	Clase IEC	26/09/2022	EUR	0,079	15.785
	Clase IEC	22/12/2022	EUR	0,073	77.356
	Clase IEC	27/03/2023	EUR	0,086	110.934
	Clase IEP	24/06/2022	EUR	0,083	7
	Clase IEP	26/09/2022	EUR	0,097	7
	Clase IEP	22/12/2022	EUR	0,092	7
	Clase IEP	27/03/2023	EUR	0,103	8
	Clase IGC	24/06/2022	GBP	0,074	98
	Clase IGC	26/09/2022	GBP	0,085	57
	Clase IGC	22/12/2022	GBP	0,078	58
	Clase IGC	27/03/2023	GBP	0,089	67
	Clase IUP	24/06/2022	USD	0,079	43.205
	Clase IUP	26/09/2022	USD	0,085	44.685

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond					
<i>(continuación)</i>					
	Clase IUP	22/12/2022	USD	0,085	25.156
	Clase IUP	27/03/2023	USD	0,096	26.712
	Clase NEC	24/06/2022	EUR	0,071	9.821
	Clase NEC	26/09/2022	EUR	0,079	15.222
	Clase NEC	22/12/2022	EUR	0,074	27.067
	Clase NEC	27/03/2023	EUR	0,087	42.919
	Clase NGC	24/06/2022	GBP	0,073	1.383.354
	Clase NGC	26/09/2022	GBP	0,083	2.485.421
	Clase NGC	22/12/2022	GBP	0,076	2.998.447
	Clase NGC	27/03/2023	GBP	0,088	4.058.889
	Clase NUP	24/06/2022	USD	0,078	6.297
	Clase NUP	26/09/2022	USD	0,082	7.210
	Clase NUP	22/12/2022	USD	0,086	8265
	Clase NUP	27/03/2023	USD	0,097	11.210
					12.011.784 USD
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond					
	Clase IEP	24/06/2022	EUR	0,034	3
	Clase IEP	26/09/2022	EUR	0,039	3
	Clase IEP	22/12/2022	EUR	0,044	4
	Clase IEP	27/03/2023	EUR	0,048	25.702
					25.712 EUR
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond					
	Clase IEP	27/03/2023	EUR	0,351	2.074.526
	Clase ZEP	27/03/2023	EUR	0,350	42.033
	Clase 1EP	27/03/2023	EUR	0,343	359.296
	Clase 1GP	27/03/2023	GBP	0,337	1.333
	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
	Clase 1UT	25/10/2022	USD	0,032	5.798
	Clase 1UT	23/11/2022	USD	0,028	4.876
	Clase 1UT	22/12/2022	USD	0,029	4.893
	Clase 1UT	25/01/2023	USD	0,032	5.269
	Clase 1UT	22/02/2023	USD	0,032	3.569
	Clase 1UT	27/03/2023	USD	0,034	3.765
	Clase 2EP	27/03/2023	EUR	0,351	1.012
	Clase 2GP	27/03/2023	GBP	0,340	29
	Clase 3EP	27/03/2023	EUR	0,355	655.200
	Clase 3FC	27/03/2023	CHF	0,346	2.285
	Clase 3GP	27/03/2023	GBP	0,343	23.117
	Clase 8EP	27/03/2023	EUR	0,352	1.955.544
	Clase 8GP	27/03/2023	GBP	0,344	1.963
	Clase 9EP	27/03/2023	EUR	0,355	2.689
	Clase 9FC	27/03/2023	CHF	0,345	32
	Clase 9GP	27/03/2023	GBP	0,342	29
					5.191.845 EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	Clase AEP	27/03/2023	EUR	3,485	1.089
	Clase IEP	27/03/2023	EUR	3,538	331.231
	Clase IGC	27/03/2023	GBP	3,616	33
	Clase XGC	27/03/2023	GBP	3,742	215.386
					547.739 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 AEP	22/12/2022	EUR	0,030	1.360
	Clase AEP	27/03/2023	EUR	0,034	1.541
	Clase ASC	24/06/2022	SGD	0,028	2
	Clase ASC	26/09/2022	SGD	0,030	2
	Clase ASC	22/12/2022	SGD	0,034	2
	Clase ASC	27/03/2023	SGD	0,037	3
	Clase AUC	24/06/2022	USD	0,027	3
	Clase AUC	26/09/2022	USD	0,027	3
	Clase AUC	22/12/2022	USD	0,032	3
	Clase AUC	27/03/2023	USD	0,035	3
	Clase IEP	24/06/2022	EUR	0,027	77.800
	Clase IEP	26/09/2022	EUR	0,030	81.738
	Clase IEP	22/12/2022	EUR	0,031	84.213
	Clase IEP	27/03/2023	EUR	0,036	93.226
	Clase ISC	24/06/2022	SGD	0,028	2
	Clase ISC	26/09/2022	SGD	0,031	2
	Clase ISC	22/12/2022	SGD	0,034	2
	Clase ISC	27/03/2023	SGD	0,037	3
	Clase IUC	24/06/2022	USD	0,026	2.431
	Clase IUC	26/09/2022	USD	0,031	2.306
	Clase IUC	22/12/2022	USD	0,033	2.699
	Clase IUC	27/03/2023	USD	0,035	2.704
	Clase NEP	24/06/2022	EUR	2,732	267.909
	Clase NEP	26/09/2022	EUR	2,817	290.888
	Clase NEP	22/12/2022	EUR	3,175	309.245
	Clase NEP	27/03/2023	EUR	3,497	389.704
	Clase ZEP	24/06/2022	EUR	0,028	16.537
	Clase ZEP	26/09/2022	EUR	0,029	16.855
	Clase ZEP	22/12/2022	EUR	0,031	18.017
	Clase ZEP	27/03/2023	EUR	0,034	19.761
	Clase ZGC	24/06/2022	GBP	0,026	130.082
	Clase ZGC	26/09/2022	GBP	0,030	165.116
	Clase ZGC	22/12/2022	GBP	0,033	200.521
	Clase ZGC	27/03/2023	GBP	0,035	220.183
					2.397.305 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

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond					
<i>(continuación)</i>					
	Clase AEP	25/10/2022	EUR	0,038	27.088
	Clase AEP	23/11/2022	EUR	0,038	27.298
	Clase AEP	22/12/2022	EUR	0,041	30.164
	Clase AEP	25/01/2023	EUR	0,041	30.321
	Clase AEP	22/02/2023	EUR	0,041	31.583
	Clase AEP	27/03/2023	EUR	0,043	32.860
	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
	Clase DEP	25/10/2022	EUR	0,029	43.716
	Clase DEP	23/11/2022	EUR	0,029	43.731
	Clase DEP	22/12/2022	EUR	0,030	45.239
	Clase DEP	25/01/2023	EUR	0,030	42.143
	Clase DEP	22/02/2023	EUR	0,030	40.716
	Clase DEP	27/03/2023	EUR	0,032	42.797
					817.049 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 AEC	25/10/2022	EUR	0,040	20.547
	Clase AEC	23/11/2022	EUR	0,040	21.591
	Clase AEC	22/12/2022	EUR	0,043	24.320
	Clase AEC	25/01/2023	EUR	0,043	25.232
	Clase AEC	22/02/2023	EUR	0,043	24.599
	Clase AEC	27/03/2023	EUR	0,042	24.282
	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 AUP	25/10/2022	USD	0,027	18.638
	Clase AUP	23/11/2022	USD	0,027	18.610
	Clase AUP	22/12/2022	USD	0,029	20.155
	Clase AUP	25/01/2023	USD	0,029	20.038
	Clase AUP	22/02/2023	USD	0,029	19.622
	Clase AUP	27/03/2023	USD	0,028	19.561
	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

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds					
(continuación)	Clase DEC	26/09/2022	EUR	0,029	1.093
	Clase DEC	25/10/2022	EUR	0,029	1.315
	Clase DEC	23/11/2022	EUR	0,029	1.353
	Clase DEC	22/12/2022	EUR	0,031	1.408
	Clase DEC	25/01/2023	EUR	0,031	1.442
	Clase DEC	22/02/2023	EUR	0,031	1.417
	Clase DEC	27/03/2023	EUR	0,031	1.359
	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 IEC	25/10/2022	EUR	0,031	6.560
	Clase IEC	23/11/2022	EUR	0,031	8.228
	Clase IEC	22/12/2022	EUR	0,033	9.040
	Clase IEC	25/01/2023	EUR	0,033	9.262
	Clase IEC	22/02/2023	EUR	0,033	9.099
	Clase IEC	27/03/2023	EUR	0,033	9.166
	Clase XUP	24/06/2022	USD	0,115	10
	Clase XUP	26/09/2022	USD	0,120	10
	Clase XUP	22/12/2022	USD	0,129	11
	Clase XUP	27/03/2023	USD	0,144	12
					568.945 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
	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 AEC	25/10/2022	EUR	0,030	1.411
	Clase AEC	23/11/2022	EUR	0,030	1.469
	Clase AEC	22/12/2022	EUR	0,032	1.618
	Clase AEC	25/01/2023	EUR	0,032	1.659
	Clase AEC	22/02/2023	EUR	0,032	1.631
	Clase AEC	27/03/2023	EUR	0,032	1.603
	Clase AUP	25/04/2022	USD	0,039	106.883
	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 AUP	25/10/2022	USD	0,037	96.612
	Clase AUP	23/11/2022	USD	0,037	94.403
	Clase AUP	22/12/2022	USD	0,041	103.601
	Clase AUP	25/01/2023	USD	0,041	102.393
	Clase AUP	22/02/2023	USD	0,041	101.873
	Clase AUP	27/03/2023	USD	0,041	100.793

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt (continuación)	Clase 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 SUP	25/10/2022	USD	0,036	1.577
	Clase SUP	23/11/2022	USD	0,036	1.557
	Clase SUP	22/12/2022	USD	0,039	1.687
	Clase SUP	25/01/2023	USD	0,039	1.687
	Clase SUP	22/02/2023	USD	0,039	1.632
	Clase SUP	27/03/2023	USD	0,039	1.632
	Clase XUP	24/06/2022	USD	0,119	11
	Clase XUP	26/09/2022	USD	0,110	10
	Clase XUP	22/12/2022	USD	0,115	10
	Clase XUP	27/03/2023	USD	0,129	11
					1.244.671 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 AEC	25/10/2022	EUR	0,017	43.247
	Clase AEC	23/11/2022	EUR	0,017	45.528
	Clase AEC	22/12/2022	EUR	0,018	50.144
	Clase AEC	25/01/2023	EUR	0,018	51.773
	Clase AEC	22/02/2023	EUR	0,018	51.317
	Clase AEC	27/03/2023	EUR	0,017	48.925
	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 ASC	25/10/2022	SGD	0,024	8.943
	Clase ASC	23/11/2022	SGD	0,024	810
	Clase ASC	22/12/2022	SGD	0,025	720
	Clase ASC	25/01/2023	SGD	0,025	739
	Clase ASC	22/02/2023	SGD	0,025	732
	Clase ASC	27/03/2023	SGD	0,024	693
	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 AUP	25/10/2022	USD	0,019	25.872

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds					
(continuación)	Clase AUP	23/11/2022	USD	0,019	25.798
	Clase AUP	22/12/2022	USD	0,019	25.373
	Clase AUP	25/01/2023	USD	0,019	25.295
	Clase AUP	22/02/2023	USD	0,019	25.212
	Clase AUP	27/03/2023	USD	0,019	24.275
	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
	Clase XUP	25/10/2022	USD	0,033	11.511
	Clase XUP	23/11/2022	USD	0,033	11.511
	Clase XUP	22/12/2022	USD	0,034	11.860
	Clase XUP	25/01/2023	USD	0,034	11.860
	Clase XUP	22/02/2023	USD	0,034	11.860
	Clase XUP	27/03/2023	USD	0,034	6.287
					1.043.441 USD
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 AEC	25/10/2022	EUR	0,049	690
	Clase AEC	23/11/2022	EUR	0,049	718
	Clase AEC	22/12/2022	EUR	0,050	757
	Clase AEC	25/01/2023	EUR	0,050	775
	Clase AEC	22/02/2023	EUR	0,050	762
	Clase AEC	27/03/2023	EUR	0,049	725
	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 AUP	25/10/2022	USD	0,053	11.456
	Clase AUP	23/11/2022	USD	0,053	11.462
	Clase AUP	22/12/2022	USD	0,055	11.642
	Clase AUP	25/01/2023	USD	0,055	11.645
	Clase AUP	22/02/2023	USD	0,055	11.581
	Clase AUP	27/03/2023	USD	0,054	11.362
	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

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond (continuación)	Clase DEC	25/10/2022	EUR	0,037	777
	Clase DEC	23/11/2022	EUR	0,037	437
	Clase DEC	22/12/2022	EUR	0,037	500
	Clase DEC	25/01/2023	EUR	0,037	513
	Clase DEC	22/02/2023	EUR	0,037	504
	Clase DEC	27/03/2023	EUR	0,037	507
	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 IEC	25/10/2022	EUR	0,036	3
	Clase IEC	23/11/2022	EUR	0,036	3
	Clase IEC	22/12/2022	EUR	0,037	4
	Clase IEC	25/01/2023	EUR	0,037	4
	Clase IEC	22/02/2023	EUR	0,037	4
	Clase IEC	27/03/2023	EUR	0,036	4
	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 ISC	25/10/2022	SGD	0,040	7.170
	Clase ISC	23/11/2022	SGD	0,040	8.052
	Clase ISC	22/12/2022	SGD	0,041	9.803
	Clase ISC	25/01/2023	SGD	0,041	10.496
	Clase ISC	22/02/2023	SGD	0,041	10.764
	Clase ISC	27/03/2023	SGD	0,040	11.478
	Clase XUP	24/06/2022	USD	0,137	12
	Clase XUP	26/09/2022	USD	0,141	13
	Clase XUP	22/12/2022	USD	0,138	12
	Clase XUP	27/03/2023	USD	0,153	14
					254.693 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 ASC	25/10/2022	SGD	0,031	101
	Clase ASC	23/11/2022	SGD	0,031	109
	Clase ASC	22/12/2022	SGD	0,031	114
	Clase ASC	25/01/2023	SGD	0,031	120
	Clase ASC	22/02/2023	SGD	0,031	121
	Clase ASC	27/03/2023	SGD	0,030	120
	Clase AUP	25/04/2022	USD	0,032	22.341
	Clase AUP	23/05/2022	USD	0,032	21.537

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond (continuación)	Clase 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 AUP	25/10/2022	USD	0,033	19.486
	Clase AUP	23/11/2022	USD	0,033	19.559
	Clase AUP	22/12/2022	USD	0,033	20.162
	Clase AUP	25/01/2023	USD	0,033	20.230
	Clase AUP	22/02/2023	USD	0,033	19.400
	Clase AUP	27/03/2023	USD	0,031	16.128
	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
	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 AVC	25/10/2022	AUD	0,030	2
	Clase AVC	23/11/2022	AUD	0,030	2
	Clase AVC	22/12/2022	AUD	0,030	2
	Clase AVC	25/01/2023	AUD	0,030	2
	Clase AVC	22/02/2023	AUD	0,030	2
	Clase AVC	27/03/2023	AUD	0,028	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
	Clase ZUP	25/10/2022	USD	0,032	3
	Clase ZUP	23/11/2022	USD	0,032	3
	Clase ZUP	22/12/2022	USD	0,032	3
	Clase ZUP	25/01/2023	USD	0,032	3
	Clase ZUP	22/02/2023	USD	0,032	3
	Clase ZUP	27/03/2023	USD	0,030	3
					244.636 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 AEC	25/10/2022	EUR	0,014	849
	Clase AEC	23/11/2022	EUR	0,014	884

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return (continuación)	Clase AEC	22/12/2022	EUR	0,017	1.108
	Clase AEC	25/01/2023	EUR	0,017	1.137
	Clase AEC	22/02/2023	EUR	0,017	1.116
	Clase AEC	27/03/2023	EUR	0,019	1.257
	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
	Clase AUP	25/10/2022	USD	0,017	5.189
	Clase AUP	23/11/2022	USD	0,017	5.173
	Clase AUP	22/12/2022	USD	0,020	5.808
	Clase AUP	25/01/2023	USD	0,020	5.790
	Clase AUP	22/02/2023	USD	0,020	5.634
	Clase AUP	27/03/2023	USD	0,024	6.664
					76.203 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 AEC	22/12/2022	EUR	0,086	379.727
	Clase AEC	27/03/2023	EUR	0,085	384.430
	Clase AEP	24/06/2022	EUR	0,089	180.810
	Clase AEP	26/09/2022	EUR	0,093	179.618
	Clase AEP	22/12/2022	EUR	0,112	250.815
	Clase AEP	27/03/2023	EUR	0,110	261.451
	Clase ASC	24/06/2022	SGD	0,082	1.139
	Clase ASC	26/09/2022	SGD	0,079	988
	Clase ASC	22/12/2022	SGD	0,103	1.395
	Clase ASC	27/03/2023	SGD	0,102	1.218
	Clase ASP	24/06/2022	SGD	0,084	332
	Clase ASP	26/09/2022	SGD	0,083	309
	Clase ASP	22/12/2022	SGD	0,103	406
	Clase ASP	27/03/2023	SGD	0,102	407
	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 AUM	25/10/2022	USD	0,028	1.143
	Clase AUM	23/11/2022	USD	0,028	1.143
	Clase AUM	22/12/2022	USD	0,037	1.511
	Clase AUM	25/01/2023	USD	0,037	1.511
	Clase AUM	22/02/2023	USD	0,037	1.511
	Clase AUM	27/03/2023	USD	0,036	1.470
	Clase AUP	24/06/2022	USD	0,083	85.009
	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,079	80.027
	Clase AUP	22/12/2022	USD	0,104	101.164
	Clase AUP	27/03/2023	USD	0,104	97.805

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					
<i>(continuación)</i>					
	Clase DEC	24/06/2022	EUR	0,066	181.028
	Clase DEC	26/09/2022	EUR	0,062	148.914
	Clase DEC	22/12/2022	EUR	0,081	205.327
	Clase DEC	27/03/2023	EUR	0,080	193.628
	Clase DEP	24/06/2022	EUR	0,083	24.637
	Clase DEP	26/09/2022	EUR	0,087	23.603
	Clase DEP	22/12/2022	EUR	0,104	28.433
	Clase DEP	27/03/2023	EUR	0,102	25.210
	Clase DUP	24/06/2022	USD	0,075	116.300
	Clase DUP	26/09/2022	USD	0,072	99.959
	Clase DUP	22/12/2022	USD	0,094	79.868
	Clase DUP	27/03/2023	USD	0,094	64.141
	Clase ZEC	24/06/2022	EUR	0,077	8
	Clase ZEC	26/09/2022	EUR	0,073	7
	Clase ZEC	22/12/2022	EUR	0,096	9
	Clase ZEC	27/03/2023	EUR	0,095	10
	Clase ZUP	24/06/2022	USD	0,083	8
	Clase ZUP	26/09/2022	USD	0,080	8
	Clase ZUP	22/12/2022	USD	0,105	11
	Clase ZUP	27/03/2023	USD	0,105	11
					3.793.193 USD
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities					
	Clase AEC	26/09/2022	EUR	0,090	9
	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,085	7
	Clase ZEC	26/09/2022	EUR	0,091	9
	Clase ZUP	26/09/2022	USD	0,086	8
	Clase AEC	27/03/2023	EUR	0,061	7
	Clase AUP	27/03/2023	USD	0,065	7
	Clase ZEC	27/03/2023	EUR	0,062	7
	Clase ZUP	27/03/2023	USD	0,066	7
					61 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
	Clase AEP	27/03/2023	EUR	0,117	506.043
	Clase AUP	27/03/2023	USD	0,087	2.983
	Clase IUP	27/03/2023	USD	0,090	4.588
	Clase ZEP	27/03/2023	EUR	0,121	487.443
					1.983.901 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 AEC	22/12/2022	EUR	0,047	16
	Clase AEC	27/03/2023	EUR	0,068	24
	Clase AUP	24/06/2022	USD	0,106	9
	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,075	6
	Clase AUP	22/12/2022	USD	0,053	4
	Clase AUP	27/03/2023	USD	0,076	6

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income (continuación)	Clase DEC	24/06/2022	EUR	0,097	8
	Clase DEC	26/09/2022	EUR	0,072	5
	Clase DEC	22/12/2022	EUR	0,046	4
	Clase DEC	27/03/2023	EUR	0,066	5
	Clase DUP	24/06/2022	USD	0,104	5.127
	Clase DUP	26/09/2022	USD	0,075	3.697
	Clase DUP	22/12/2022	USD	0,053	2.613
	Clase DUP	27/03/2023	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 1EP	22/12/2022	EUR	0,060	91.837
	Clase 1EP	27/03/2023	EUR	0,083	127.226
	Clase 1SC	24/06/2022	SGD	0,104	33.653
	Clase 1SC	26/09/2022	SGD	0,076	24.001
	Clase 1SC	22/12/2022	SGD	0,052	16.975
	Clase 1SC	27/03/2023	SGD	0,074	24.070
	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 1ST	25/10/2022	SGD	0,014	821
	Clase 1ST	23/11/2022	SGD	0,015	916
	Clase 1ST	22/12/2022	SGD	0,023	1.395
	Clase 1ST	25/01/2023	SGD	0,021	1.274
	Clase 1ST	22/02/2023	SGD	0,017	1.020
	Clase 1ST	27/03/2023	SGD	0,036	2.183
	Clase 1UP	24/06/2022	USD	0,107	43.826
	Clase 1UP	26/09/2022	USD	0,077	31.317
	Clase 1UP	22/12/2022	USD	0,055	22.193
	Clase 1UP	27/03/2023	USD	0,078	30.902
	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
	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 1VT	25/10/2022	AUD	0,014	78
	Clase 1VT	23/11/2022	AUD	0,014	83
	Clase 1VT	22/12/2022	AUD	0,022	131
	Clase 1VT	25/01/2023	AUD	0,019	119
	Clase 1VT	22/02/2023	AUD	0,016	98
	Clase 1VT	27/03/2023	AUD	0,035	134
	Clase 2EP	24/06/2022	EUR	0,118	9
	Clase 2EP	26/09/2022	EUR	0,092	6
	Clase 2EP	22/12/2022	EUR	0,060	5
	Clase 2EP	27/03/2023	EUR	0,083	6
	Clase 2UP	24/06/2022	USD	0,109	9

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income (continuación)	Clase 2UP	26/09/2022	USD	0,078	6
	Clase 2UP	22/12/2022	USD	0,055	5
	Clase 2UP	27/03/2023	USD	0,079	6
	Clase 3EP	24/06/2022	EUR	0,118	1.044.736
	Clase 3EP	26/09/2022	EUR	0,093	650.582
	Clase 3EP	22/12/2022	EUR	0,061	466.789
	Clase 3EP	27/03/2023	EUR	0,084	651.468
	Clase 3UP	24/06/2022	USD	0,110	4.337
	Clase 3UP	26/09/2022	USD	0,079	1.592
	Clase 3UP	22/12/2022	USD	0,056	1.129
	Clase 3UP	27/03/2023	USD	0,080	1.613
	Clase 8EP	24/06/2022	EUR	0,118	30
	Clase 8EP	26/09/2022	EUR	0,092	21
	Clase 8EP	22/12/2022	EUR	0,060	15
	Clase 8EP	27/03/2023	EUR	0,084	21
	Clase 8UP	24/06/2022	USD	0,109	6.320
	Clase 8UP	26/09/2022	USD	0,078	4.523
	Clase 8UP	22/12/2022	USD	0,056	3.247
	Clase 8UP	27/03/2023	USD	0,079	8.333
	Clase 9EP	24/06/2022	EUR	0,119	9
	Clase 9EP	26/09/2022	EUR	0,093	7
	Clase 9EP	22/12/2022	EUR	0,060	5
	Clase 9EP	27/03/2023	EUR	0,084	7
	Clase 9UP	24/06/2022	USD	0,110	9
	Clase 9UP	26/09/2022	USD	0,079	6
	Clase 9UP	22/12/2022	USD	0,056	5
	Clase 9UP	27/03/2023	USD	0,079	6
					3.631.334 USD
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	Clase AEP	27/03/2023	EUR	0,124	2.831.822
	Clase AUP	27/03/2023	USD	0,113	7.187
	Clase IEP	27/03/2023	EUR	0,106	269.229
					3.108.238 EUR
Threadneedle (Lux) - American	Clase 1EP	27/03/2023	EUR	0,226	75.664
					75.664 USD
Threadneedle (Lux) - American Select	Clase 1EP	27/03/2023	EUR	0,083	34.680
					34.680 USD
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	Clase 1EP	27/03/2023	EUR	0,220	265.086
					265.086 USD
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	Clase XUP	26/09/2022	USD	0,185	473.152
	Clase XUP	27/03/2023	USD	0,106	271.103
					744.255 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 Contrarian Core Equities	Clase AEC	26/09/2022	EUR	0,123	6
	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,129	1.189
	Clase AEC	27/03/2023	EUR	0,108	6
	Clase AUP	27/03/2023	USD	0,131	1.165
					2.366 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
	Clase AUP	27/03/2023	USD	0,135	9
	Clase IEC	27/03/2023	EUR	0,117	7
					31 USD
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	Clase 1EP	27/03/2023	EUR	0,368	24
	Clase 1GP	27/03/2023	GBP	0,360	24
	Clase 3GP	27/03/2023	GBP	0,371	161
	Clase 9GP	27/03/2023	GBP	0,373	24
					233 EUR
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	Clase 1EP	26/09/2022	EUR	0,035	371.038
	Clase 1EP	27/03/2023	EUR	0,011	114.499
	Clase 1GP	26/09/2022	GBP	0,031	11.429
	Clase 1GP	27/03/2023	GBP	0,010	3.736
	Clase 2EP	26/09/2022	EUR	0,356	26
	Clase 2EP	27/03/2023	EUR	0,113	8
	Clase 2GP	26/09/2022	GBP	0,359	25
	Clase 2GP	27/03/2023	GBP	0,113	8
	Clase 3EP	26/09/2022	EUR	0,056	3.990
	Clase 3EP	27/03/2023	EUR	0,018	1.283
	Clase 3GP	26/09/2022	GBP	0,050	34.197
	Clase 3GP	27/03/2023	GBP	0,016	11.108
	Clase 4GP	26/09/2022	GBP	0,046	267.760
	Clase 4GP	27/03/2023	GBP	0,014	116.916
	Clase 8EP	26/09/2022	EUR	0,037	31.847
	Clase 8EP	27/03/2023	EUR	0,012	10.329
	Clase 8GP	26/09/2022	GBP	0,033	16.998
	Clase 8GP	27/03/2023	GBP	0,010	5.389
	Clase 9EP	26/09/2022	EUR	0,357	25
	Clase 9EP	27/03/2023	EUR	0,114	8
	Clase 9GP	26/09/2022	GBP	0,362	26
	Clase 9GP	27/03/2023	GBP	0,114	34
	Clase AEP	26/09/2022	EUR	0,346	11.866
	Clase AEP	27/03/2023	EUR	0,109	4.174
	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,305	25
	Clase AUP	27/03/2023	USD	0,107	8
	Clase DEP	26/09/2022	EUR	0,341	5.875
	Clase DEP	27/03/2023	EUR	0,107	1.863
	Clase IEP	26/09/2022	EUR	0,357	307.207
	Clase IEP	27/03/2023	EUR	0,114	74.498

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend (continuación)	Clase ZEP	26/09/2022	EUR	0,355	8.095
	Clase ZEP	27/03/2023	EUR	0,113	2.577
					1.416.867 EUR
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	Clase 1EP	27/03/2023	EUR	0,186	126.015
	Clase 3EP	27/03/2023	EUR	0,192	180.310
	Clase 3GP	27/03/2023	GBP	0,187	30.570
	Clase 9EP	27/03/2023	EUR	0,192	12
	Clase 9GP	27/03/2023	GBP	0,188	12
					336.919 EUR
Threadneedle (Lux) - European Select	Clase 1EP	27/03/2023	EUR	0,213	194.688
	Clase 2EP	27/03/2023	EUR	0,221	13
	Clase 8EP	27/03/2023	EUR	0,221	5.790
					200.491 EUR
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	Clase 1EP	27/03/2023	EUR	0,226	781.099
	Clase 3EP	27/03/2023	EUR	0,233	18.966
	Clase 9EP	27/03/2023	EUR	0,233	129.402
					929.467 EUR
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	Clase AUP	26/09/2022	USD	0,286	45.163
	Clase AUP	27/03/2023	USD	0,168	31.295
	Clase DUP	26/09/2022	USD	0,278	16.296
	Clase DUP	27/03/2023	USD	0,163	4.483
	Clase IEP	26/09/2022	EUR	0,342	348.469
	Clase IEP	27/03/2023	EUR	0,180	205.943
	Clase XUP	26/09/2022	USD	0,302	75.948
	Clase XUP	27/03/2023	USD	0,178	48.022
	Clase ZGP	26/09/2022	GBP	0,313	19
	Clase ZGP	27/03/2023	GBP	0,163	11
	Clase ZUP	26/09/2022	USD	0,334	1.227
	Clase ZUP	27/03/2023	USD	0,197	743
					777.619 USD
Threadneedle (Lux) - Global Technology	Clase AUP	27/03/2023	USD	0,145	10.451
					10.451 USD
Threadneedle (Lux) - UK Equities	Clase AGP	26/09/2022	GBP	0,383	16.731
	Clase AGP	27/03/2023	GBP	0,197	5.892
	Clase IGP	26/09/2022	GBP	0,567	338.830
	Clase IGP	27/03/2023	GBP	0,293	65.024
	Clase NGP	26/09/2022	GBP	0,227	13
	Clase NGP	27/03/2023	GBP	0,116	7
	Clase TGP	26/09/2022	GBP	0,227	13
	Clase TGP	27/03/2023	GBP	0,116	7
	Clase ZGP	26/09/2022	GBP	0,204	265.325
	Clase ZGP	27/03/2023	GBP	0,105	12.195

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) - UK Equities					
(continuación)	Clase 9EP	26/09/2022	EUR	0,179	412.664
	Clase 9EP	27/03/2023	EUR	0,093	211.997
					1.328.698 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 AEC	22/12/2022	EUR	0,089	3.617
	Clase AEC	27/03/2023	EUR	0,059	2.346
	Clase ASC	24/06/2022	SGD	0,122	10
	Clase ASC	26/09/2022	SGD	0,080	7
	Clase ASC	22/12/2022	SGD	0,095	8
	Clase ASC	27/03/2023	SGD	0,062	5
	Clase AUC	24/06/2022	USD	0,127	56.110
	Clase AUC	26/09/2022	USD	0,082	39.960
	Clase AUC	22/12/2022	USD	0,105	41.605
	Clase AUC	27/03/2023	USD	0,066	9.790
	Clase DEC	24/06/2022	EUR	0,112	1.228
	Clase DEC	26/09/2022	EUR	0,074	839
	Clase DEC	22/12/2022	EUR	0,084	938
	Clase DEC	27/03/2023	EUR	0,055	617
	Clase DGP	24/06/2022	GBP	0,125	101
	Clase DGP	26/09/2022	GBP	0,085	69
	Clase DGP	22/12/2022	GBP	0,094	76
	Clase DGP	27/03/2023	GBP	0,061	49
	Clase IGP	24/06/2022	GBP	0,133	180.846
	Clase IGP	26/09/2022	GBP	0,089	125.937
	Clase IGP	22/12/2022	GBP	0,100	149.178
	Clase IGP	27/03/2023	GBP	0,065	103.841
	Clase LGP	24/06/2022	GBP	0,134	1.576.236
	Clase LGP	26/09/2022	GBP	0,091	1.098.940
	Clase LGP	22/12/2022	GBP	0,102	1.249.139
	Clase LGP	27/03/2023	GBP	0,067	808.633
	Clase ZGP	24/06/2022	GBP	0,138	17.245
	Clase ZGP	26/09/2022	GBP	0,092	15.120
	Clase ZGP	22/12/2022	GBP	0,104	10.586
	Clase ZGP	27/03/2023	GBP	0,069	6.662
					5.509.577 GBP
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Clase 1EP	27/03/2023	EUR	0,377	20.237
	Clase 2EP	27/03/2023	EUR	0,385	104.683
	Clase 2GC	27/03/2023	GBP	0,397	34
	Clase 8EP	27/03/2023	EUR	0,385	47.983
	Clase 8GC	27/03/2023	GBP	0,407	577
					173.514 EUR
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 IEP	22/12/2022	EUR	0,081	7
	Clase IEP	27/03/2023	EUR	0,074	7

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 Investment Grade Credit Opportunities					
(continuación)	Clase LEP	24/06/2022	EUR	0,087	7
	Clase LEP	26/09/2022	EUR	0,078	7
	Clase LEP	22/12/2022	EUR	0,082	7
	Clase LEP	27/03/2023	EUR	0,075	7
					57 EUR
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha					
	Clase AEP	27/03/2023	EUR	0,195	5.516
					5.516 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 rendimiento para garantizar que las Carteras ofrezcan una tasa de rendimiento 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 el 1,75%, sujeto a un mínimo del 1,50%	20%
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Acciones J Acciones Y	El Euro Short-Term Rate (€STR) compuesto medio más elevado a 1 mes más el 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 más elevado a 3 meses más el 1,50%, sujeto a un mínimo del 1,50%	20%

¹ El índice de referencia es proporcionado por European Money Markets Institute, un administrador incluido en el registro de administradores de índices de referencia de la ESMA. La Sociedad Gestora mantiene un plan escrito en el que se establecen las medidas que se tomarán en caso de que el índice de referencia cambie sustancialmente o deje de cumplirse.

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

High Water Mark del VL: con respecto a cada Clase de Acciones, es el Valor liquidativo de una Acción de dicha Clase de Acciones en la última Fecha de valoración del último año calendario pertinente en el que se pagó cualquier comisión de rendimiento acumulado. Si nunca se ha pagado una comisión de rendimiento, la High Water Mark del VL es el precio inicial de la Clase de Acciones correspondiente. 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 acumulado 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 la comisión de rendimiento es negativo y se ha superado la High Water Mark del VL, dicha cantidad negativa se transferirá y la Sociedad Gestora no recibirá el pago de una comisión de rendimiento hasta que el importe de la comisión de rendimiento acumulada sea positivo y se haya excedido la High Water Mark del VL, al final de cualquier año calendario posterior.

Notas a los estados financieros

(continuación)

8 COMISIONES DE RENDIMIENTO

(continuación)

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.

Para el ejercicio cerrado a 31 de marzo de 2023, no se han pagado comisiones de rendimiento.

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

A 31 de marzo de 2023, la SICAV tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	6.984	USD	7.485	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	111
19/04/2023	GBP	180.185	USD	221.968	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	909
19/04/2023	GBP	287.799	USD	354.537	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.452
19/04/2023	GBP	61	USD	75	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	1.096.517	USD	1.350.791	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.530
19/04/2023	GBP	17.712	USD	21.667	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	241
19/04/2023	GBP	795.037	USD	963.534	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19.876
19/04/2023	GBP	4.239	USD	5.186	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	58
19/04/2023	GBP	316.884	USD	387.646	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.319
19/04/2023	GBP	226.800	USD	279.701	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	836
19/04/2023	GBP	1.005.551	USD	1.233.174	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10.629
19/04/2023	EUR	13.840	USD	14.955	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	97
19/04/2023	EUR	13.395	USD	14.284	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	285
19/04/2023	EUR	322	USD	343	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
19/04/2023	EUR	12.415	USD	13.305	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	197
19/04/2023	GBP	3.847.317	USD	4.682.045	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	76.840
19/04/2023	EUR	113.222	USD	121.344	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.797
19/04/2023	EUR	44.471	USD	47.661	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	706
19/04/2023	EUR	3.990	USD	4.211	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	129
19/04/2023	GBP	26.080.232	USD	31.734.713	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	524.865
19/04/2023	EUR	109.434	USD	117.511	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.509
19/04/2023	EUR	8	USD	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	299.600	USD	324.935	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	911
19/04/2023	EUR	27.893	USD	30.252	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	85
19/04/2023	CHF	8	USD	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	8	USD	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	2.990	USD	3.181	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	71
19/04/2023	EUR	135.774	USD	145.514	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.155
19/04/2023	EUR	151.422	USD	162.284	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.403
19/04/2023	EUR	22.675	USD	24.301	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	360
19/04/2023	EUR	22.179	USD	24.044	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	78
19/04/2023	EUR	186.881	USD	200.287	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.966
19/04/2023	EUR	16.832.911	USD	18.107.216	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	200.291
19/04/2023	EUR	458.158	USD	491.024	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7.271
19/04/2023	EUR	40.630.500	USD	43.706.359	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	483.454
19/04/2023	EUR	26.015	USD	27.454	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	840
19/04/2023	EUR	1.100.118	USD	1.183.401	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13.090
19/04/2023	EUR	75.000.000	USD	80.953.905	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	616.245
19/04/2023	EUR	87	USD	94	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)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	105.903	USD	115.483	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(303)
19/04/2023	EUR	15	USD	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	14.897	USD	15.847	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	354
19/04/2023	EUR	40.446	USD	43.584	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	405
19/04/2023	EUR	4.380	USD	4.751	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	CHF	768	USD	845	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	EUR	10.086.292	USD	10.849.856	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	120.015
19/04/2023	EUR	1.281	USD	1.399	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
19/04/2023	NOK	82	USD	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	NOK	82	USD	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	14.339	USD	15.398	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	198
19/04/2023	SEK	96.500	USD	9.089	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	227
19/04/2023	GBP	3.595	USD	4.375	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	72
19/04/2023	EUR	12.273.737	USD	13.202.898	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	146.043
19/04/2023	EUR	13.694.081	USD	14.730.767	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	162.943
19/04/2023	SEK	7.163	USD	679	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	EUR	2.129.877	USD	2.291.116	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25.343
19/04/2023	GBP	320.401	USD	395.134	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.182
19/04/2023	EUR	4.990	USD	5.392	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	35
19/04/2023	EUR	24.406	USD	26.372	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	172
19/04/2023	GBP	31.606	USD	38.675	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	420
19/04/2023	EUR	501	USD	541	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	GBP	1.068.039	USD	1.303.173	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17.923
19/04/2023	EUR	49.869	USD	54.061	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	176
19/04/2023	EUR	209.287	USD	226.881	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	741
19/04/2023	EUR	2.990	USD	3.213	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	39
19/04/2023	GBP	731.745	USD	889.436	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15.686
19/04/2023	GBP	321.159.349	USD	390.790.228	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.463.333
19/04/2023	GBP	538.066	USD	660.644	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.909
19/04/2023	USD	25.864	EUR	24.313	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(577)
19/04/2023	GBP	1.181.631	USD	1.456.680	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.922
19/04/2023	GBP	1.179	USD	1.460	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	GBP	5.528	USD	6.727	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	111
19/04/2023	EUR	3.934.074	USD	4.231.895	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	46.811
19/04/2023	EUR	707	USD	761	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
19/04/2023	GBP	751.955	USD	914.980	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15.139
19/04/2023	GBP	98.663.213	USD	120.054.483	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.985.597
19/04/2023	NOK	7.248	USD	690	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	NOK	7.291	USD	694	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	GBP	64.847	USD	79.854	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	358
19/04/2023	GBP	298.090	USD	369.179	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(460)
19/04/2023	GBP	983.139	USD	1.203.025	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13.055
19/04/2023	GBP	16.432.095	USD	19.994.754	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	330.696
19/04/2023	SEK	8.468.579	USD	802.214	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15.351
19/04/2023	GBP	302.464	USD	368.041	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.087
19/04/2023	GBP	118.283	USD	142.399	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.910
19/04/2023	GBP	870.282	USD	1.047.719	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	28.765
19/04/2023	GBP	791.575	USD	961.547	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17.580
19/04/2023	SEK	81	USD	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)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	657.237	USD	706.992	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7.820
19/04/2023	USD	7.391	EUR	6.821	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28)
19/04/2023	CHF	766	USD	844	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	EUR	2.304.000	USD	2.486.904	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18.931
19/04/2023	USD	4.058	GBP	3.316	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(44)
19/04/2023	USD	24.845	EUR	22.784	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	65
19/04/2023	USD	27.869	EUR	25.837	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(231)
19/04/2023	USD	11.486	GBP	9.413	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(158)
19/04/2023	USD	172	EUR	159	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	USD	30.067	EUR	28.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(386)
19/04/2023	USD	41.054	GBP	33.289	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(123)
19/04/2023	USD	41.770	EUR	39.580	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.276)
19/04/2023	USD	9.942	GBP	8.064	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(34)
19/04/2023	USD	87	GBP	71	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	44.986	GBP	37.367	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.235)
19/04/2023	USD	33.968	GBP	27.963	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(621)
19/04/2023	USD	622	EUR	578	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
19/04/2023	USD	58.087	EUR	54.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(643)
19/04/2023	USD	485	EUR	451	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	USD	15.839	GBP	13.069	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(327)
19/04/2023	USD	257	EUR	238	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	USD	147.868	EUR	136.472	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(558)
19/04/2023	USD	15.098	EUR	13.824	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	64
19/04/2023	USD	111	EUR	103	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	USD	236.247	GBP	191.565	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(706)
19/04/2023	USD	240.327	EUR	225.377	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.788)
19/04/2023	USD	1.218	EUR	1.154	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(37)
19/04/2023	USD	3.261	EUR	3.037	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42)
19/04/2023	USD	274.992	GBP	223.312	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.231)
19/04/2023	USD	320.918	GBP	260.607	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.436)
19/04/2023	USD	86.659	GBP	70.296	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(293)
19/04/2023	USD	130	EUR	121	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	USD	2.506	GBP	2.061	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(44)
19/04/2023	USD	24.153	GBP	19.672	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(179)
05/04/2023	USD	52.168	JPY	6.881.139	Operaciones comerciales	JP Morgan	430
05/04/2023	USD	9.811	AUD	14.627	Operaciones comerciales	JP Morgan	13
05/04/2023	USD	30.798	JPY	4.036.927	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	445
05/04/2023	USD	221.637	CAD	303.145	Operaciones comerciales	JP Morgan	(2.373)
05/04/2023	USD	7.177	AUD	10.792	Operaciones comerciales	JP Morgan	(52)
05/04/2023	USD	1.394.010	GBP	1.135.120	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(9.643)
05/04/2023	USD	764.112	EUR	710.310	Operaciones comerciales	JP Morgan	(7.799)
05/04/2023	JPY	4.572.392	USD	34.097	Operaciones comerciales	JP Morgan	282
05/04/2023	JPY	4.040.268	USD	31.190	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(813)
05/04/2023	USD	593.192	GBP	485.420	Operaciones comerciales	JP Morgan	(7.062)
05/04/2023	USD	1.461.904	EUR	1.356.779	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(12.540)
05/04/2023	GBP	1.129.280	USD	1.394.500	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	1.933
05/04/2023	USD	2.432	AUD	3.644	Operaciones comerciales	JP Morgan	(9)
05/04/2023	USD	2.141.312	EUR	1.975.420	Operaciones comerciales	Barclays	(5.427)
05/04/2023	USD	216.795	EUR	200.000	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(550)

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
05/04/2023	USD	593.525	EUR	554.410	Operaciones comerciales	JP Morgan	(8.964)
05/04/2023	JPY	4.263.392	USD	32.317	Operaciones comerciales	JP Morgan	(261)
05/04/2023	USD	173.923	CAD	238.261	Operaciones comerciales	JP Morgan	(2.141)
05/04/2023	USD	5.509.708	EUR	5.209.140	Operaciones comerciales	JP Morgan	(151.161)
05/04/2023	USD	233.462	CAD	320.853	Operaciones comerciales	JP Morgan	(3.634)
05/04/2023	USD	21.347.734	EUR	19.720.000	Operaciones comerciales	Barclays	(82.482)
05/04/2023	USD	11.706	AUD	17.624	Operaciones comerciales	JP Morgan	(100)
05/04/2023	USD	14.835	AUD	22.196	Operaciones comerciales	JP Morgan	(33)
05/04/2023	USD	163.792	EUR	150.000	Operaciones comerciales	Barclays	783
05/04/2023	USD	179.319.822	EUR	168.916.094	Operaciones comerciales	JP Morgan	(4.244.610)
05/04/2023	USD	248.700	EUR	235.190	Operaciones comerciales	JP Morgan	(6.886)
05/04/2023	USD	676.171	EUR	628.750	Operaciones comerciales	Barclays	(7.107)
05/04/2023	USD	7.129	AUD	10.708	Operaciones comerciales	JP Morgan	(44)
05/04/2023	USD	6.577	AUD	9.856	Operaciones comerciales	JP Morgan	(25)
05/04/2023	USD	65.227.254	GBP	54.637.542	Operaciones comerciales	JP Morgan	(2.335.612)
05/04/2023	USD	8.019.588	CAD	10.922.399	Operaciones comerciales	JP Morgan	(51.570)
05/04/2023	USD	1.444	AUD	2.156	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	0
05/04/2023	JPY	2.764.716	USD	21.079	Operaciones comerciales	JP Morgan	(292)
05/04/2023	JPY	8.265.002	USD	62.237	Operaciones comerciales	JP Morgan	(95)
05/04/2023	USD	12.174	AUD	18.222	Operaciones comerciales	JP Morgan	(32)
05/04/2023	CAD	122.598	USD	89.488	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	1.107
05/04/2023	USD	7.287	AUD	11.031	Operaciones comerciales	JP Morgan	(102)
05/04/2023	USD	720.863	CAD	985.000	Operaciones comerciales	JP Morgan	(7.008)
05/04/2023	EUR	1.806.260	USD	1.914.370	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	48.539
05/04/2023	USD	18.981	JPY	2.588.984	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(484)
05/04/2023	AUD	25.093	USD	16.870	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(61)
05/04/2023	AUD	171.397	USD	115.305	Operaciones comerciales	JP Morgan	(493)
05/04/2023	AUD	8.526	USD	5.709	Operaciones comerciales	JP Morgan	2
05/04/2023	EUR	1.275.745	USD	1.370.985	Operaciones comerciales	JP Morgan	15.401
05/04/2023	EUR	1.057.617	USD	1.144.877	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	4.464
05/04/2023	AUD	15.094	USD	10.063	Operaciones comerciales	JP Morgan	48
05/04/2023	AUD	5.413	USD	3.650	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(25)
05/04/2023	USD	45.873	JPY	6.086.880	Operaciones comerciales	JP Morgan	107
05/04/2023	AUD	10.707	USD	7.250	Operaciones comerciales	JP Morgan	(78)
05/04/2023	USD	242.476	EUR	228.580	Operaciones comerciales	Barclays	(5.926)
05/04/2023	CAD	208.089	USD	151.981	Operaciones comerciales	JP Morgan	1.788
05/04/2023	CAD	69.337	USD	50.893	Operaciones comerciales	JP Morgan	344
05/04/2023	EUR	1.300.000	USD	1.412.683	Operaciones comerciales	JP Morgan	61
05/04/2023	CAD	100.662	USD	73.644	Operaciones comerciales	JP Morgan	741
05/04/2023	EUR	1.656.590	USD	1.778.020	Operaciones comerciales	JP Morgan	22.240
05/04/2023	CAD	97.076	USD	71.353	Operaciones comerciales	JP Morgan	381
05/04/2023	CAD	232.274	USD	169.577	Operaciones comerciales	JP Morgan	2.063
05/04/2023	CAD	317.889	USD	232.638	Operaciones comerciales	JP Morgan	2.268
05/04/2023	AUD	8.255	USD	5.466	Operaciones comerciales	JP Morgan	63
05/04/2023	USD	6.648.320	GBP	5.400.000	Operaciones comerciales	Barclays	(29.150)
05/04/2023	USD	3.137.320	GBP	2.534.230	Operaciones comerciales	Barclays	3.570
05/04/2023	USD	2.875.127	JPY	391.796.323	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(70.625)
05/04/2023	USD	348.467	JPY	45.600.000	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	5.610
05/04/2023	JPY	5.625.897	USD	41.535	Operaciones comerciales	JP Morgan	764

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
05/04/2023	USD	182.408	CAD	247.967	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(828)
05/04/2023	CAD	68.427	USD	50.463	Operaciones comerciales	JP Morgan	101
05/04/2023	USD	46.329	CAD	63.727	Operaciones comerciales	JP Morgan	(762)
05/04/2023	USD	761.372	EUR	721.010	Operaciones comerciales	JP Morgan	(22.162)
05/04/2023	USD	716.123	GBP	581.390	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(2.806)
05/04/2023	USD	6.084	AUD	9.146	Operaciones comerciales	JP Morgan	(42)
05/04/2023	JPY	5.362.561	USD	40.436	Operaciones comerciales	JP Morgan	(117)
05/04/2023	USD	78.240	CAD	107.897	Operaciones comerciales	JP Morgan	(1.491)
05/04/2023	JPY	11.556.083	USD	87.088	Operaciones comerciales	JP Morgan	(201)
05/04/2023	USD	301.581	CAD	414.173	Operaciones comerciales	JP Morgan	(4.473)
05/04/2023	USD	4.840	AUD	7.226	Operaciones comerciales	JP Morgan	0
05/04/2023	USD	1.417	AUD	2.133	Operaciones comerciales	JP Morgan	(11)
05/04/2023	USD	1.549.865	EUR	1.458.348	Operaciones comerciales	JP Morgan	(34.950)
05/04/2023	USD	84.263	CAD	115.881	Operaciones comerciales	JP Morgan	(1.368)
05/04/2023	USD	2.929	AUD	4.442	Operaciones comerciales	JP Morgan	(47)
05/04/2023	USD	113.441	CAD	156.902	Operaciones comerciales	JP Morgan	(2.503)
05/04/2023	USD	1.416.321	EUR	1.320.703	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(18.917)
05/04/2023	USD	246.037	EUR	231.840	Operaciones comerciales	JP Morgan	(5.908)
04/04/2023	GBP	581.390	USD	716.110	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	2.801
03/04/2023	EUR	1.975.420	USD	2.141.089	Operaciones comerciales	Barclays	5.379
							4.390.217 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
04/05/2023	EUR	4.022.426	GBP	3.537.901	Operaciones comerciales	Lloyds	980
04/05/2023	EUR	8.588.282	USD	9.362.361	Operaciones comerciales	Lloyds	(12.537)
04/05/2023	EUR	198.777	GBP	175.000	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(141)
19/04/2023	CHF	785	EUR	803	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
19/04/2023	NOK	85	EUR	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	NOK	84	EUR	7	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	643	EUR	727	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	USD	903	EUR	839	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
19/04/2023	NOK	7.532	EUR	667	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	USD	14	EUR	13	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	NOK	7.464	EUR	661	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	CHF	10	EUR	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	10	EUR	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	795	EUR	814	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
19/04/2023	GBP	9	EUR	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
04/04/2023	EUR	48.432	USD	51.503	Operaciones comerciales	JP Morgan	1.036
04/04/2023	EUR	4.103.796	GBP	3.637.901	Operaciones comerciales	Lloyds	(35.880)
04/04/2023	EUR	9.057.564	USD	9.693.260	Operaciones comerciales	NatWest Markets	137.333
04/04/2023	USD	47.052	EUR	43.783	Operaciones comerciales	JP Morgan	(483)
04/04/2023	USD	300.000	EUR	282.624	Operaciones comerciales	JP Morgan	(6.548)
04/04/2023	USD	51.790	EUR	48.266	Operaciones comerciales	Lloyds	(606)
04/04/2023	GBP	100.000	EUR	113.868	Operaciones comerciales	Barclays	(75)

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
04/04/2023	USD	48.802	EUR	45.323	Operaciones comerciales	Lloyds	(413)
04/04/2023	EUR	59.896	USD	65.242	Operaciones comerciales	JP Morgan	(143)
							82.484 EUR

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	USD	1.088.802	EUR	1.012.177	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11.074)
19/04/2023	EUR	3.040	CHF	2.995	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
19/04/2023	EUR	614	CHF	604	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	EUR	3.532	CHF	3.479	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
19/04/2023	CHF	56.611	EUR	57.947	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(854)
19/04/2023	CHF	280.555	EUR	287.176	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.231)
19/04/2023	CHF	68.503	EUR	70.120	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.033)
19/04/2023	EUR	744	CHF	733	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	CHF	813	EUR	832	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
19/04/2023	EUR	8	NOK	96	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	11	NOK	120	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	7	SEK	79	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	10	SEK	112	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	31	CHF	31	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	2.198	CHF	2.178	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	CHF	837	EUR	857	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
19/04/2023	EUR	9	CHF	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	324.296	EUR	331.950	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.891)
19/04/2023	EUR	11.928	USD	12.783	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	174
19/04/2023	SEK	7.700	EUR	678	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	SEK	7.776	EUR	685	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	SEK	88	EUR	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	12.473	EUR	11.423	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	46
19/04/2023	EUR	11.537	USD	12.387	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	148
19/04/2023	EUR	9	NOK	102	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	9	CHF	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	NOK	7.799	EUR	690	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	NOK	88	EUR	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	NOK	86	EUR	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	NOK	7.985	EUR	707	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
05/04/2023	USD	26.534	EUR	24.739	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(323)
05/04/2023	USD	41.630	EUR	38.880	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(572)
05/04/2023	USD	21.851	EUR	20.647	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(539)
05/04/2023	USD	24.692	EUR	23.279	Operaciones comerciales	JP Morgan	(558)
05/04/2023	USD	18.709	EUR	17.374	Operaciones comerciales	Lloyds	(158)
05/04/2023	USD	26.850	EUR	24.934	Operaciones comerciales	JP Morgan	(226)
05/04/2023	EUR	402.553	GBP	353.677	Operaciones comerciales	JP Morgan	109
05/04/2023	USD	67.490	EUR	63.522	Operaciones comerciales	Lloyds	(1.418)
05/04/2023	EUR	34.286	USD	37.115	Operaciones comerciales	JP Morgan	133
05/04/2023	EUR	34.145	USD	36.640	Operaciones comerciales	Lloyds	429

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
05/04/2023	EUR	42.357	USD	46.017	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	13
05/04/2023	EUR	27.342	USD	29.202	Operaciones comerciales	Barclays	471
05/04/2023	EUR	53.399	USD	57.634	Operaciones comerciales	JP Morgan	364
05/04/2023	EUR	6.342.132	USD	6.732.321	Operaciones comerciales	JP Morgan	147.120
05/04/2023	GBP	462.384	EUR	527.095	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(955)
05/04/2023	GBP	162.898	EUR	184.746	Operaciones comerciales	JP Morgan	614
05/04/2023	GBP	213.781	EUR	243.350	Operaciones comerciales	Lloyds	(92)
05/04/2023	GBP	140.079	EUR	159.157	Operaciones comerciales	JP Morgan	237
05/04/2023	GBP	146.053	EUR	165.133	Operaciones comerciales	NatWest Markets	1.058
05/04/2023	EUR	16.859	USD	17.962	Operaciones comerciales	NatWest Markets	330
05/04/2023	EUR	2.275.864	GBP	2.000.000	Operaciones comerciales	Barclays	96
05/04/2023	EUR	160.800	GBP	142.953	Operaciones comerciales	JP Morgan	(1.864)
05/04/2023	EUR	49.791.028	GBP	44.270.288	Operaciones comerciales	JP Morgan	(583.518)
05/04/2023	EUR	1.969.780	GBP	1.750.000	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(21.520)
05/04/2023	EUR	31.942	USD	33.969	Operaciones comerciales	JP Morgan	684
							(481.773) EUR

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	29	GBP	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	10	SEK	109	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	10	NOK	113	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	70.440	GBP	61.973	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42)
19/04/2023	GBP	4.960.998	EUR	5.612.029	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30.139
19/04/2023	NOK	8.608	EUR	762	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
19/04/2023	EUR	163.134	GBP	143.255	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	209
19/04/2023	SEK	8.475	EUR	746	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
19/04/2023	GBP	21.270.535	EUR	24.061.865	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	129.221
19/04/2023	GBP	767	EUR	868	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	GBP	737	EUR	834	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	NOK	8.616	EUR	763	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
19/04/2023	EUR	10	SEK	109	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	1.291.096	GBP	1.140.110	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.560)
19/04/2023	EUR	38.255	GBP	33.642	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
19/04/2023	NOK	101	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SEK	103	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	NOK	102	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SEK	8.402	EUR	740	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
19/04/2023	GBP	8	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	235.224	EUR	267.187	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	334
19/04/2023	SEK	100	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	10	NOK	115	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
05/04/2023	GBP	32.746	EUR	37.276	Operaciones comerciales	Barclays	(15)
05/04/2023	USD	1.177	EUR	1.093	Operaciones comerciales	JP Morgan	(10)
05/04/2023	USD	1.490	EUR	1.408	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(37)
05/04/2023	EUR	988	USD	1.074	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	0

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
05/04/2023	EUR	1.789	USD	1.903	Operaciones comerciales	JP Morgan	38
05/04/2023	USD	1.932	EUR	1.819	Operaciones comerciales	JP Morgan	(41)
05/04/2023	GBP	25.040	EUR	28.450	Operaciones comerciales	JP Morgan	42
05/04/2023	GBP	48.514	EUR	55.020	Operaciones comerciales	JP Morgan	183
05/04/2023	GBP	61.270	EUR	69.844	Operaciones comerciales	JP Morgan	(125)
05/04/2023	EUR	2.855	USD	3.062	Operaciones comerciales	Barclays	37
05/04/2023	EUR	1.298	USD	1.401	Operaciones comerciales	JP Morgan	9
05/04/2023	EUR	29.766	GBP	26.384	Operaciones comerciales	Barclays	(257)
05/04/2023	EUR	42.946	GBP	37.732	Operaciones comerciales	JP Morgan	12
05/04/2023	EUR	383.654	USD	407.292	Operaciones comerciales	JP Morgan	8.868
05/04/2023	EUR	1.811	USD	1.934	Operaciones comerciales	Barclays	31
05/04/2023	EUR	29.647	GBP	26.357	Operaciones comerciales	JP Morgan	(344)
05/04/2023	USD	1.369	EUR	1.276	Operaciones comerciales	JP Morgan	(16)
05/04/2023	EUR	31.248	GBP	27.500	Operaciones comerciales	Barclays	(44)
05/04/2023	EUR	1.967	USD	2.132	Operaciones comerciales	JP Morgan	6
05/04/2023	EUR	11.009.697	GBP	9.788.741	Operaciones comerciales	JP Morgan	(128.776)
05/04/2023	GBP	311.990	EUR	354.398	Operaciones comerciales	JP Morgan	611
							34.475 EUR

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - European Social Bond tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	SGD	869	EUR	600	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	CHF	30.491	EUR	31.211	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(460)
19/04/2023	GBP	7.403.441	EUR	8.374.994	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	44.977
19/04/2023	CHF	20.126	EUR	20.603	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(305)
19/04/2023	CHF	352.210	EUR	361.503	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.291)
19/04/2023	CHF	454	EUR	466	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
19/04/2023	GBP	23.967	EUR	27.141	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	117
19/04/2023	GBP	423.728	EUR	482.702	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(794)
19/04/2023	GBP	8.191	EUR	9.265	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	50
19/04/2023	CHF	4.567	EUR	4.590	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
19/04/2023	GBP	7.333	EUR	8.374	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(35)
19/04/2023	GBP	5.836	EUR	6.657	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
19/04/2023	EUR	3.869	GBP	3.420	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21)
19/04/2023	EUR	233.627	GBP	206.534	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.266)
19/04/2023	EUR	20.983	GBP	18.446	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	GBP	11.941	EUR	13.621	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(41)
19/04/2023	GBP	3.460	EUR	3.914	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21
19/04/2023	SEK	7.339	EUR	646	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	NOK	7.464	EUR	661	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	GBP	48.314.537	EUR	54.654.849	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	293.515
19/04/2023	SGD	852	EUR	589	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	GBP	633	EUR	716	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	GBP	1.079	EUR	1.225	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	GBP	1.004	EUR	1.137	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	CHF	23.625.309	EUR	24.182.924	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(356.302)

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	GBP	15.125	EUR	17.182	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21
19/04/2023	GBP	778.736	EUR	887.142	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.482)
19/04/2023	CHF	73.838	EUR	74.335	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	132
19/04/2023	USD	14.242	EUR	13.240	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(145)
19/04/2023	USD	876	EUR	814	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
19/04/2023	USD	711.340	EUR	661.279	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.235)
19/04/2023	USD	144	EUR	135	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	USD	874	EUR	813	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
19/04/2023	SGD	871	EUR	602	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	CHF	773	EUR	791	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
19/04/2023	SEK	7.328	EUR	645	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	CHF	11	EUR	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	927	GBP	816	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	117	GBP	103	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	4.778	GBP	4.194	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
19/04/2023	EUR	14.874	GBP	13.103	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(27)
19/04/2023	SGD	841	EUR	581	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	14.904	GBP	13.083	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25
19/04/2023	EUR	324	GBP	286	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	GBP	29.425	EUR	33.265	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	200
19/04/2023	GBP	1.134	EUR	1.290	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	NOK	7.460	EUR	660	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	USD	855	EUR	794	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
19/04/2023	SGD	14	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
17/04/2023	EUR	723.976	CAD	1.054.875	Operaciones comerciales	HSBC	7.051
17/04/2023	EUR	8.706	CAD	12.729	Operaciones comerciales	HSBC	55
17/04/2023	GBP	200.000	EUR	228.292	Operaciones comerciales	HSBC	(815)
17/04/2023	EUR	11.542.489	USD	12.200.972	Operaciones comerciales	HSBC	323.294
17/04/2023	EUR	478.168	SEK	5.347.693	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	3.482
17/04/2023	EUR	22.342.750	GBP	19.586.586	Operaciones comerciales	HSBC	65.260
17/04/2023	USD	200.000	EUR	188.276	Operaciones comerciales	HSBC	(4.364)
17/04/2023	CAD	5.832	EUR	3.993	Operaciones comerciales	HSBC	(29)
							358.560 EUR

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	14	USD	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	307	USD	329	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	USD	20.768	EUR	19.306	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(211)
19/04/2023	EUR	12	SEK	136	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	917	EUR	853	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
19/04/2023	SEK	7.772	EUR	684	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	NOK	7.886	EUR	698	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	NOK	7.978	EUR	706	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	EUR	12	NOK	140	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	12	NOK	140	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)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
18/04/2023	USD	289.873	EUR	271.558	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(5.018)
18/04/2023	EUR	492.473	USD	526.959	Operaciones comerciales	HSBC	7.940
18/04/2023	EUR	17.655.716	USD	18.994.404	Operaciones comerciales	Barclays	190.447
18/04/2023	EUR	143.763	USD	155.888	Operaciones comerciales	JP Morgan	423
18/04/2023	EUR	48.906	USD	52.200	Operaciones comerciales	HSBC	909
18/04/2023	EUR	49.117	JPY	6.987.374	Operaciones comerciales	HSBC	702
18/04/2023	EUR	65.125	GBP	57.543	Operaciones comerciales	Lloyds	(321)
18/04/2023	EUR	21.276.019	GBP	18.924.417	Operaciones comerciales	HSBC	(247.747)
18/04/2023	JPY	24.803.747	EUR	172.596	Operaciones comerciales	HSBC	(738)
18/04/2023	EUR	120.155	GBP	105.955	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(353)
18/04/2023	USD	326.448	EUR	303.776	Operaciones comerciales	HSBC	(3.605)
18/04/2023	USD	215.610	EUR	201.696	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(3.441)
18/04/2023	USD	341.658	EUR	322.783	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(8.626)
18/04/2023	GBP	88.640	EUR	100.532	Operaciones comerciales	JP Morgan	282
18/04/2023	GBP	2.408.755	EUR	2.744.204	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(4.616)
18/04/2023	JPY	37.821.542	EUR	271.670	Operaciones comerciales	HSBC	(9.615)
18/04/2023	GBP	125.026	EUR	143.064	Operaciones comerciales	JP Morgan	(866)
18/04/2023	EUR	165.848	GBP	147.698	Operaciones comerciales	Lloyds	(2.137)
18/04/2023	EUR	112.969	AUD	175.664	Operaciones comerciales	NatWest Markets	4.720
							(81.880) EUR

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	USD	6.200	EUR	5.686	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
19/04/2023	USD	9.695	EUR	8.939	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(27)
19/04/2023	USD	3.708	EUR	3.447	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(41)
19/04/2023	USD	1.077	EUR	999	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
19/04/2023	USD	10.824	EUR	10.028	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(82)
19/04/2023	USD	16.004	EUR	15.008	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(319)
19/04/2023	SEK	7.279	USD	690	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	SGD	100.463	USD	74.638	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	969
19/04/2023	EUR	981	USD	1.063	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	EUR	518	USD	559	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	EUR	3.198	USD	3.402	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	76
19/04/2023	EUR	21.865	USD	23.561	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	219
19/04/2023	NOK	7.358	USD	701	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	EUR	4.727.870	USD	5.085.785	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	56.256
19/04/2023	EUR	55.000	USD	59.623	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	195
19/04/2023	USD	12.258	EUR	11.522	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(274)
19/04/2023	EUR	245	USD	263	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	EUR	5.477.394	USD	5.892.051	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	65.174
19/04/2023	EUR	137.446	USD	147.851	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.635
19/04/2023	EUR	305.305	USD	328.418	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.633
19/04/2023	EUR	173	USD	182	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
19/04/2023	EUR	2.039.008	USD	2.193.367	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24.262
19/04/2023	EUR	11.304.599	USD	12.160.393	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	134.511

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	2.007.745	USD	2.159.737	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23.890
19/04/2023	EUR	9.000	USD	9.714	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	74
19/04/2023	EUR	7.328	USD	8.004	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(34)
19/04/2023	EUR	4	USD	4	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	9.000	USD	9.597	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	191
19/04/2023	USD	12.820	EUR	11.918	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(142)
19/04/2023	USD	3.081	EUR	2.864	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(34)
19/04/2023	USD	1.626	EUR	1.500	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	EUR	4.988	USD	5.380	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	45
19/04/2023	USD	4.618	EUR	4.235	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
							310.224 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	435.118	USD	468.058	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.177
19/04/2023	USD	7.935	EUR	7.364	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(74)
19/04/2023	USD	4.173	EUR	3.913	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(83)
19/04/2023	USD	679	EUR	623	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	USD	19.018	EUR	17.680	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(210)
19/04/2023	USD	4.209	EUR	3.954	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(92)
19/04/2023	USD	3.338	EUR	3.136	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(73)
19/04/2023	USD	453.528	MXN	8.654.610	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(24.106)
19/04/2023	USD	8	NOK	83	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	8	SEK	79	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	42.803	SGD	57.627	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(566)
19/04/2023	USD	262.328	SGD	349.580	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(761)
19/04/2023	USD	52.781	SGD	69.871	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	197
19/04/2023	USD	1.161.333	SGD	1.568.763	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19.284)
19/04/2023	USD	50	SGD	67	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	EUR	328.478	USD	353.345	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.909
19/04/2023	SGD	4.936.860	USD	3.667.816	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	47.595
19/04/2023	SGD	466	USD	350	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	3.792	USD	4.110	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
19/04/2023	EUR	3.026	USD	3.281	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
19/04/2023	EUR	5.068	USD	5.493	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
19/04/2023	SGD	37.502	USD	28.263	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40)
19/04/2023	SEK	81	USD	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	NOK	80	USD	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	29.840	USD	32.539	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(85)
19/04/2023	EUR	97	USD	106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SEK	6.843	USD	648	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
19/04/2023	NOK	6.970	USD	664	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	EUR	333.928	USD	359.207	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.973
19/04/2023	EUR	281.337	USD	302.635	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.348

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	USD	961.665	EUR	888.081	Operaciones comerciales	Lloyds	(4.209)
19/04/2023	USD	5.366	EUR	5.042	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(117)
							14.559 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	SGD	199	USD	147	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	NOK	7.406	USD	705	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	EUR	864.150	USD	929.569	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10.282
19/04/2023	EUR	2.834.630	USD	3.049.221	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	33.729
19/04/2023	EUR	9.246.813	USD	9.946.827	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	110.026
19/04/2023	EUR	11.053.763	USD	11.890.568	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	131.528
19/04/2023	EUR	10.000	USD	10.806	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	70
19/04/2023	USD	191.271	EUR	176.635	Operaciones comerciales	Lloyds	(837)
19/04/2023	USD	63.818	EUR	59.223	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(593)
19/04/2023	USD	459	EUR	423	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	USD	446	EUR	418	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
19/04/2023	USD	28	EUR	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	159.990	USD	118.864	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.542
19/04/2023	USD	3.523	SGD	4.692	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
19/04/2023	USD	135	SGD	179	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	2.008	SGD	2.667	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	6.805	SGD	9.032	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
19/04/2023	USD	3.666	SGD	4.924	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40)
19/04/2023	SGD	236	USD	177	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	12	USD	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	99	USD	75	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	229.780	USD	170.714	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.215
19/04/2023	EUR	99.990	USD	105.522	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.227
19/04/2023	SEK	7.325	USD	694	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	EUR	152.609	USD	164.161	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.816
19/04/2023	USD	1.941	SGD	2.596	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
19/04/2023	EUR	207	USD	226	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
							292.959 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	USD	2.023	EUR	1.887	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30)
19/04/2023	SGD	477.359	USD	354.652	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.602
19/04/2023	SGD	1	USD	1	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)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	SGD	1.846	USD	1.380	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	14.682	USD	10.974	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	76
19/04/2023	SGD	14.380	USD	10.685	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	137
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	38.088	USD	28.669	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	SGD	3.128.661	USD	2.324.424	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30.163
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	6.117	USD	4.593	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	5.445	USD	4.058	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	40
19/04/2023	SGD	14.426	USD	10.717	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	140
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	13.044	USD	9.656	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	160
19/04/2023	SGD	62.385	USD	46.991	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(41)
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	60	USD	65	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	146.275	USD	157.349	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.741
19/04/2023	EUR	98.361	USD	105.807	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.170
19/04/2023	EUR	298	USD	322	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	EUR	57.006.583	USD	61.322.164	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	678.311
19/04/2023	EUR	533.595	USD	573.990	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.349
19/04/2023	SGD	8.180	USD	6.089	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	67
19/04/2023	EUR	702	USD	755	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
19/04/2023	SGD	620	USD	466	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	SGD	36.558	USD	27.596	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(83)
19/04/2023	USD	1.366	EUR	1.274	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
19/04/2023	USD	28.275	SGD	38.067	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(374)
19/04/2023	USD	330	SGD	439	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SEK	7.583	USD	718	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
19/04/2023	SEK	7.726	USD	732	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
19/04/2023	CHF	825	USD	908	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	SGD	247	USD	183	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	GBP	660	USD	803	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	EUR	411.184	USD	442.312	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.893
19/04/2023	NOK	7.714	USD	734	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	NOK	7.841	USD	747	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	3.345	USD	2.510	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
19/04/2023	SGD	37.730	USD	28.502	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(106)
19/04/2023	EUR	2.566	USD	2.770	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	10.661	EUR	9.893	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(99)
19/04/2023	USD	5.401	EUR	5.077	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(121)
19/04/2023	USD	224	EUR	209	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	USD	10	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	1	USD	1	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)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	SGD	7.113	USD	5.360	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
19/04/2023	EUR	30	USD	32	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	54.826	USD	58.976	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	652
							727.720 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	USD	18	SGD	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	46.126	USD	34.269	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	445
19/04/2023	SGD	488.147	USD	362.667	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.706
19/04/2023	EUR	902.054	USD	970.343	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10.733
19/04/2023	THB	22.300.000	USD	648.539	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	4.985
19/04/2023	EUR	6.229	USD	6.693	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	81
19/04/2023	SGD	1.000	USD	744	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
19/04/2023	SEK	7.339	USD	695	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	SGD	5.128	USD	3.808	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	52
19/04/2023	EUR	384	USD	416	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	SGD	238	USD	178	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	285	USD	213	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	SGD	30	USD	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	9.069	USD	9.670	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	193
19/04/2023	SGD	46	USD	35	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	321	USD	348	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	SGD	889	USD	670	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	SGD	297	USD	222	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	SGD	226	USD	170	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	3.988	USD	4.243	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	95
19/04/2023	EUR	608.395	USD	654.452	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7.239
19/04/2023	AUD	838	USD	561	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	14.727.649	USD	15.842.580	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	175.240
19/04/2023	USD	87.133	EUR	82.565	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.662)
19/04/2023	USD	5.342	EUR	4.952	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(44)
19/04/2023	USD	5	SGD	7	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	10.976	EUR	10.066	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29
19/04/2023	USD	54.190	EUR	50.205	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(412)
19/04/2023	USD	27	SGD	35	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	609	SGD	808	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	123	EUR	112	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	10	SGD	13	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	864.840	PHP	47.134.664	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(3.047)
19/04/2023	USD	391	SGD	519	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	1.185	USD	881	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
19/04/2023	SGD	486	USD	361	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	SGD	13	USD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	634	USD	772	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	SGD	1.187	USD	879	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)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	AUD	9	USD	6	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	AUD	1.020	USD	683	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	1.451	EUR	1.346	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
19/04/2023	USD	27.292	EUR	25.371	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(302)
19/04/2023	USD	6	AUD	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	274	USD	204	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
							197.394 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
02/06/2023	GBP	1.600.000	EUR	1.821.342	Operaciones comerciales	Barclays	(4.745)
02/06/2023	USD	1.900.000	EUR	1.794.571	Operaciones comerciales	Barclays	(52.190)
02/06/2023	USD	1.990.000	EUR	1.866.655	Operaciones comerciales	Barclays	(41.740)
02/06/2023	JPY	89.300.003	EUR	628.585	Operaciones comerciales	Barclays	(7.426)
02/06/2023	JPY	69.500.000	EUR	499.983	Operaciones comerciales	Barclays	(16.550)
02/06/2023	JPY	15.750.000	EUR	111.746	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(2.191)
02/06/2023	GBP	32.049	EUR	36.093	Operaciones comerciales	Barclays	295
02/06/2023	USD	199.086	EUR	182.350	Operaciones comerciales	Barclays	220
02/06/2023	USD	15.000	EUR	13.861	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(105)
02/06/2023	EUR	2.583.159	GBP	2.300.000	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(28.266)
02/06/2023	EUR	690.322	JPY	99.200.000	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	298
02/06/2023	EUR	2.567.231	USD	2.750.000	Operaciones comerciales	Barclays	45.532
02/06/2023	EUR	534.025	JPY	76.000.000	Operaciones comerciales	Barclays	5.348
02/06/2023	EUR	742.389	USD	805.000	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	4.186
02/06/2023	EUR	508.349	USD	550.000	Operaciones comerciales	Barclays	3.990
02/06/2023	GBP	640.000	EUR	726.720	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(81)
24/04/2023	EUR	63.000	USD	68.651	Operaciones comerciales	Barclays	(103)
							(93.528) EUR

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
02/06/2023	EUR	240.000	USD	257.092	Operaciones comerciales	Lloyds	4.619
02/06/2023	GBP	1.620.000	USD	1.948.850	Operaciones comerciales	Lloyds	56.839
02/06/2023	JPY	82.755.000	USD	616.908	Operaciones comerciales	Lloyds	10.798
19/04/2023	USD	10.748	EUR	9.857	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	28
19/04/2023	USD	25	EUR	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	USD	6.415	EUR	5.937	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42)
19/04/2023	USD	2.895	EUR	2.669	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
19/04/2023	USD	10.312	EUR	9.570	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(96)
19/04/2023	USD	16	GBP	13	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SEK	7.069	USD	670	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	GBP	626	USD	762	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	EUR	80	USD	87	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)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	6.855.916	USD	7.374.930	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	81.576
19/04/2023	EUR	107.150	USD	115.262	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.275
19/04/2023	EUR	148	USD	161	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	1.650.806	USD	1.775.777	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19.643
19/04/2023	GBP	13	USD	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	716.351	USD	770.581	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8.524
							183.181 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
02/06/2023	EUR	9.300.000	USD	9.957.685	Operaciones comerciales	JP Morgan	183.612
09/05/2023	USD	4.937	JPY	654.242	Operaciones comerciales	Lloyds	(9)
04/05/2023	USD	4.544.957	EUR	4.168.982	Operaciones comerciales	JP Morgan	6.815
04/05/2023	USD	1.393.312	GBP	1.124.130	Operaciones comerciales	Lloyds	2.397
04/05/2023	USD	53.942	CAD	73.029	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(47)
19/04/2023	CHF	831	USD	915	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
19/04/2023	SGD	131.402	USD	97.625	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.267
19/04/2023	USD	48.068	EUR	45.161	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.049)
19/04/2023	USD	157.536	EUR	145.320	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(514)
19/04/2023	USD	2.158	SGD	2.865	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	USD	32.165	EUR	29.657	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(90)
19/04/2023	USD	16.955	EUR	15.633	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(47)
19/04/2023	USD	4.350	EUR	4.030	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(33)
19/04/2023	USD	24.956	EUR	23.121	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(190)
19/04/2023	USD	23.050	EUR	21.452	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(280)
19/04/2023	USD	15.570	EUR	14.628	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(340)
19/04/2023	USD	214.677	EUR	201.696	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.683)
19/04/2023	USD	15	EUR	14	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	19.558	EUR	18.202	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(238)
19/04/2023	USD	28.851	EUR	26.415	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	122
19/04/2023	USD	25.302	EUR	23.415	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(164)
19/04/2023	USD	16.269	EUR	15.056	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(106)
19/04/2023	USD	20.324	EUR	19.060	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(405)
19/04/2023	USD	7.271	EUR	6.819	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(145)
19/04/2023	USD	9.395	EUR	8.749	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(121)
19/04/2023	USD	57.841	EUR	53.865	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(742)
19/04/2023	USD	9.542	EUR	8.870	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(106)
19/04/2023	USD	616.352	EUR	579.083	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13.447)
19/04/2023	USD	318.739	EUR	299.466	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.954)
19/04/2023	SGD	93	USD	69	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	12	EUR	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	98.814	USD	104.282	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.189
19/04/2023	SGD	1.206	USD	909	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	EUR	22.779	USD	24.879	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(105)
19/04/2023	EUR	747.963	USD	804.586	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8.900
19/04/2023	EUR	710	USD	764	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)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	2.285	USD	2.411	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	74
19/04/2023	USD	5.638	EUR	5.232	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(52)
19/04/2023	USD	18	CHF	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	9.985	USD	10.824	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	35
19/04/2023	EUR	48.336	USD	52.759	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(189)
19/04/2023	EUR	5.584	USD	5.892	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	180
19/04/2023	CHF	18	USD	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	225.158	USD	245.762	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(880)
19/04/2023	SGD	6.612	USD	4.913	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	64
19/04/2023	EUR	10.045.773	USD	10.806.270	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	119.533
19/04/2023	EUR	6.986	USD	7.432	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	166
19/04/2023	EUR	6.108	USD	6.498	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	145
19/04/2023	EUR	14.596.781	USD	15.701.804	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	173.684
19/04/2023	EUR	14.778	USD	15.925	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	148
19/04/2023	EUR	28.832.207	USD	31.014.898	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	343.068
19/04/2023	USD	7.800	EUR	7.153	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
19/04/2023	USD	4.952	EUR	4.541	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	EUR	16.470	USD	17.977	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(64)
19/04/2023	EUR	2.181.949	USD	2.347.129	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25.963
18/04/2023	USD	41.268	EUR	38.436	Operaciones comerciales	JP Morgan	(532)
18/04/2023	EUR	1.635	USD	1.739	Operaciones comerciales	Barclays	39
18/04/2023	AUD	46.489	USD	32.162	Operaciones comerciales	JP Morgan	(1.006)
18/04/2023	CNY	16.829	USD	2.451	Operaciones comerciales	Barclays	3
18/04/2023	CNY	23.895	USD	3.497	Operaciones comerciales	UBS	(13)
18/04/2023	EUR	601.223	USD	646.778	Operaciones comerciales	Barclays	7.077
18/04/2023	USD	12.931	CNY	89.491	Operaciones comerciales	HSBC	(118)
18/04/2023	USD	134.005	EUR	125.233	Operaciones comerciales	UBS	(2.189)
18/04/2023	USD	5.447	EUR	4.992	Operaciones comerciales	NatWest Markets	18
18/04/2023	JPY	730.032	USD	5.514	Operaciones comerciales	HSBC	(13)
18/04/2023	USD	6.603	GBP	5.414	Operaciones comerciales	HSBC	(94)
18/04/2023	SGD	16.213	USD	12.235	Operaciones comerciales	Lloyds	(34)
18/04/2023	JPY	405.512	USD	3.005	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	51
18/04/2023	EUR	5.752	USD	6.140	Operaciones comerciales	JP Morgan	116
18/04/2023	USD	4.199	JPY	568.484	Operaciones comerciales	JP Morgan	(84)
18/04/2023	THB	602.030	USD	17.889	Operaciones comerciales	HSBC	(248)
18/04/2023	EUR	4.004	USD	4.303	Operaciones comerciales	NatWest Markets	51
18/04/2023	NOK	48.675	USD	4.803	Operaciones comerciales	HSBC	(151)
18/04/2023	MXN	1.170.185	USD	62.219	Operaciones comerciales	HSBC	2.361
18/04/2023	JPY	74.378.134	USD	562.598	Operaciones comerciales	Barclays	(2.139)
18/04/2023	CHF	27.089	USD	29.567	Operaciones comerciales	NatWest Markets	143
18/04/2023	CAD	18.984	USD	14.176	Operaciones comerciales	HSBC	(145)
18/04/2023	NZD	14.125	USD	8.881	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(43)
18/04/2023	JPY	639.405	USD	4.857	Operaciones comerciales	HSBC	(39)
18/04/2023	GBP	131.327	USD	160.099	Operaciones comerciales	Barclays	2.341
18/04/2023	JPY	5.450.263	USD	40.781	Operaciones comerciales	HSBC	288
18/04/2023	EUR	59.365	USD	62.632	Operaciones comerciales	UBS	1.930
18/04/2023	EUR	3.622	USD	3.899	Operaciones comerciales	UBS	40
18/04/2023	KRW	79.474.929	USD	62.816	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(1.797)
18/04/2023	AUD	3.229	USD	2.136	Operaciones comerciales	HSBC	28

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
18/04/2023	CNY	592.791	USD	87.374	Operaciones comerciales	HSBC	(931)
18/04/2023	USD	3.510	EUR	3.316	Operaciones comerciales	UBS	(96)
18/04/2023	USD	126.232	GBP	105.340	Operaciones comerciales	HSBC	(4.063)
18/04/2023	USD	4.382	GBP	3.630	Operaciones comerciales	HSBC	(108)
18/04/2023	GBP	4.654	USD	5.761	Operaciones comerciales	JP Morgan	(4)
18/04/2023	IDR	355.453.455	USD	23.448	Operaciones comerciales	HSBC	325
18/04/2023	USD	6.419	GBP	5.239	Operaciones comerciales	UBS	(61)
18/04/2023	USD	146.620	GBP	121.789	Operaciones comerciales	HSBC	(4.021)
18/04/2023	GBP	3.599	USD	4.329	Operaciones comerciales	HSBC	122
18/04/2023	JPY	294.719	USD	2.233	Operaciones comerciales	HSBC	(12)
18/04/2023	USD	10.732	GBP	8.820	Operaciones comerciales	UBS	(177)
18/04/2023	USD	72.270	GBP	59.756	Operaciones comerciales	HSBC	(1.642)
18/04/2023	USD	149.277	GBP	124.933	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(5.252)
18/04/2023	SEK	231.471	USD	22.394	Operaciones comerciales	UBS	(49)
05/04/2023	GBP	16.386	USD	20.090	Operaciones comerciales	Lloyds	173
05/04/2023	EUR	300.000	USD	319.540	Operaciones comerciales	HSBC	6.478
05/04/2023	GBP	8.762	USD	10.583	Operaciones comerciales	NatWest Markets	252
05/04/2023	GBP	25.919	USD	31.755	Operaciones comerciales	Lloyds	295
05/04/2023	EUR	68.190	USD	73.499	Operaciones comerciales	JP Morgan	605
05/04/2023	GBP	13.715	USD	16.687	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	273
05/04/2023	EUR	75.811	USD	80.568	Operaciones comerciales	JP Morgan	1.817
05/04/2023	EUR	140.526	USD	151.017	Operaciones comerciales	JP Morgan	1.696
05/04/2023	EUR	98.983	USD	106.149	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	1.418
05/04/2023	USD	20.618.318	EUR	19.421.671	Operaciones comerciales	Lloyds	(487.594)
05/04/2023	USD	144.754	GBP	118.540	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(1.829)
05/04/2023	USD	102.602	GBP	86.630	Operaciones comerciales	Lloyds	(4.522)
05/04/2023	USD	9.802	GBP	8.160	Operaciones comerciales	JP Morgan	(289)
05/04/2023	USD	119.560	GBP	100.000	Operaciones comerciales	Lloyds	(4.097)
05/04/2023	USD	3.585.463	GBP	3.003.384	Operaciones comerciales	Lloyds	(128.415)
05/04/2023	USD	208.081	EUR	194.090	Operaciones comerciales	HSBC	(2.841)
05/04/2023	USD	53.755	EUR	49.890	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(461)
05/04/2023	USD	26.978	GBP	21.957	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(173)
05/04/2023	USD	124.923	EUR	116.990	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(2.213)
05/04/2023	USD	204.999	EUR	189.886	Operaciones comerciales	UBS	(1.354)
05/04/2023	USD	79.630	EUR	75.000	Operaciones comerciales	JP Morgan	(1.874)
05/04/2023	GBP	11.554	USD	13.981	Operaciones comerciales	NatWest Markets	307
05/04/2023	EUR	104.454	USD	111.787	Operaciones comerciales	NatWest Markets	1.725
04/04/2023	CAD	946	USD	694	Operaciones comerciales	JP Morgan	5
04/04/2023	USD	155	JPY	20.767	Operaciones comerciales	JP Morgan	(1)
04/04/2023	CAD	4.743	USD	3.471	Operaciones comerciales	JP Morgan	34
04/04/2023	USD	62	JPY	8.236	Operaciones comerciales	JP Morgan	1
04/04/2023	USD	37	JPY	4.938	Operaciones comerciales	JP Morgan	0
04/04/2023	CAD	1.750	USD	1.291	Operaciones comerciales	JP Morgan	3
04/04/2023	USD	4.657	JPY	627.673	Operaciones comerciales	JP Morgan	(62)
04/04/2023	CAD	1.969	USD	1.437	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	18
04/04/2023	EUR	125.000	USD	135.484	Operaciones comerciales	Lloyds	348
04/04/2023	JPY	4.152	USD	32	Operaciones comerciales	Barclays	(1)
04/04/2023	CAD	1.853	USD	1.361	Operaciones comerciales	JP Morgan	8
04/04/2023	GBP	8.220	USD	10.071	Operaciones comerciales	Lloyds	94

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
04/04/2023	CAD	3.130	USD	2.286	Operaciones comerciales	JP Morgan	27
04/04/2023	JPY	4.609	USD	34	Operaciones comerciales	JP Morgan	1
04/04/2023	CAD	1.621	USD	1.186	Operaciones comerciales	JP Morgan	12
04/04/2023	JPY	3.702	USD	27	Operaciones comerciales	JP Morgan	1
04/04/2023	USD	97	JPY	12.949	Operaciones comerciales	JP Morgan	(1)
04/04/2023	USD	3.027	CAD	4.115	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(14)
04/04/2023	USD	1.335.881	GBP	1.106.140	Operaciones comerciales	Lloyds	(31.902)
04/04/2023	USD	3.064	CAD	4.197	Operaciones comerciales	JP Morgan	(38)
04/04/2023	USD	1.247	CAD	1.719	Operaciones comerciales	JP Morgan	(24)
04/04/2023	USD	4.895	CAD	6.722	Operaciones comerciales	JP Morgan	(73)
04/04/2023	USD	872	CAD	1.199	Operaciones comerciales	JP Morgan	(14)
04/04/2023	USD	1.731	CAD	2.395	Operaciones comerciales	JP Morgan	(38)
04/04/2023	USD	3.656	CAD	5.000	Operaciones comerciales	JP Morgan	(39)
04/04/2023	USD	431	CAD	591	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(6)
04/04/2023	USD	45.929	CAD	62.372	Operaciones comerciales	JP Morgan	(161)
04/04/2023	JPY	16.768	USD	126	Operaciones comerciales	JP Morgan	0
04/04/2023	USD	1.068	CAD	1.468	Operaciones comerciales	JP Morgan	(17)
04/04/2023	CAD	1.458	USD	1.072	Operaciones comerciales	JP Morgan	6
04/04/2023	USD	4.596.553	EUR	4.293.982	Operaciones comerciales	Lloyds	(69.519)
04/04/2023	CAD	3.553	USD	2.594	Operaciones comerciales	JP Morgan	32
04/04/2023	JPY	8.403	USD	64	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(1)
04/04/2023	CAD	1.067	USD	776	Operaciones comerciales	JP Morgan	13
04/04/2023	USD	3.885	CAD	5.339	Operaciones comerciales	JP Morgan	(60)
04/04/2023	USD	121.958	GBP	99.310	Operaciones comerciales	HSBC	(843)
04/04/2023	USD	48	JPY	6.373	Operaciones comerciales	JP Morgan	0
04/04/2023	GBP	98.100	USD	120.916	Operaciones comerciales	Lloyds	389
							105.827 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	67.753	USD	72.882	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	805
19/04/2023	EUR	715	USD	769	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	EUR	22	USD	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	23	USD	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	23	USD	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	2.051	USD	2.223	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
19/04/2023	EUR	22	USD	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	728	USD	783	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	EUR	747	USD	804	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	EUR	751	USD	808	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	USD	16	EUR	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	16	EUR	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	16	EUR	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	1.458	EUR	1.370	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32)
19/04/2023	USD	15	EUR	14	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
							816 USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Focus tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	5.000	USD	5.388	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	50
19/04/2023	EUR	1.845.532	USD	2.003.497	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.707
19/04/2023	EUR	2.398	USD	2.558	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	51
19/04/2023	SGD	52.942	USD	39.850	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
19/04/2023	SGD	21.428	USD	16.146	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
19/04/2023	SGD	762.653	USD	566.609	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7.353
19/04/2023	EUR	54.542.699	USD	58.671.756	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	648.992
19/04/2023	EUR	657.865	USD	714.174	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.321
19/04/2023	EUR	26.548.752	USD	28.558.577	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	315.898
19/04/2023	USD	3.540	EUR	3.295	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(43)
19/04/2023	USD	80.918	EUR	75.306	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(984)
19/04/2023	USD	32.023	EUR	30.031	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(638)
19/04/2023	USD	18.239	EUR	17.104	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(363)
19/04/2023	USD	16.388	EUR	15.166	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(107)
19/04/2023	USD	30.224	EUR	27.971	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(196)
19/04/2023	USD	3.741	SGD	5.004	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(25)
19/04/2023	USD	48.949	EUR	45.132	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(137)
19/04/2023	EUR	62.990	USD	68.382	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	127
19/04/2023	SGD	11.077	USD	8.318	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
19/04/2023	EUR	33.927	USD	36.092	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	807
19/04/2023	EUR	1.252.045	USD	1.366.618	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.891)
19/04/2023	SGD	1.000	USD	755	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	EUR	1.521.898	USD	1.641.361	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13.858
19/04/2023	EUR	4.118	USD	4.422	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	57
19/04/2023	EUR	120.342	USD	129.224	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.660
19/04/2023	CHF	18	USD	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	53.921	USD	58.798	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(154)
19/04/2023	EUR	2.298.816	USD	2.472.844	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	27.353
19/04/2023	EUR	22.810	USD	24.072	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	736
19/04/2023	EUR	2.660	USD	2.808	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	86
19/04/2023	EUR	113.634	USD	122.021	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.567
19/04/2023	EUR	606	USD	661	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	EUR	246	USD	265	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	CHF	742	USD	818	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	USD	131.910	EUR	121.625	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(369)
19/04/2023	USD	309.935	EUR	288.128	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.429)
19/04/2023	USD	55.412	EUR	51.513	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(613)
19/04/2023	USD	57.597	EUR	53.130	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(188)
19/04/2023	EUR	72.915.994	USD	78.435.968	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	867.612
19/04/2023	EUR	11.533	USD	12.392	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	151
19/04/2023	EUR	17.258	USD	18.403	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	367
19/04/2023	EUR	566	USD	611	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	SGD	20.000	USD	15.070	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
19/04/2023	USD	241	EUR	222	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	EUR	24.141	USD	26.086	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	170
19/04/2023	EUR	990	USD	1.065	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
19/04/2023	SGD	1.583	USD	1.189	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	EUR	5.702	USD	6.184	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	SGD	1.000	USD	743	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
19/04/2023	EUR	3.392	USD	3.648	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	40
19/04/2023	SGD	1.303	USD	964	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
19/04/2023	SGD	480	USD	357	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	USD	40.721	EUR	37.563	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(133)
19/04/2023	USD	41.105	EUR	38.108	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(341)
19/04/2023	USD	69.527	EUR	63.759	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	182
19/04/2023	USD	6.478	EUR	6.138	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(198)
19/04/2023	USD	149.838	EUR	140.848	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.345)
19/04/2023	USD	201.087	EUR	186.610	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.868)
19/04/2023	USD	17.579	EUR	16.095	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	74
19/04/2023	USD	1.280	EUR	1.172	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	USD	17.129	EUR	16.101	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(382)
19/04/2023	USD	26.256	EUR	24.039	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	111
19/04/2023	USD	50.273	EUR	46.575	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(382)
19/04/2023	USD	1.527	EUR	1.414	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
19/04/2023	USD	53.854	EUR	49.893	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(410)
19/04/2023	USD	3.642	EUR	3.376	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30)
19/04/2023	USD	49.156	EUR	45.572	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(408)
19/04/2023	USD	170.109	EUR	161.191	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.197)
19/04/2023	USD	7.719	EUR	7.189	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(99)
19/04/2023	USD	1.171	EUR	1.074	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	EUR	35.500	USD	38.254	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	356
19/04/2023	EUR	66.431	USD	70.671	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.579
							1.869.364 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	491	USD	518	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
19/04/2023	EUR	99	USD	106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	386.493	USD	415.751	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.599
19/04/2023	EUR	794.022	USD	854.132	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9.448
19/04/2023	EUR	592.902	USD	637.787	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7.055
19/04/2023	EUR	22.194	USD	24.058	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	80
19/04/2023	EUR	11.002	USD	12.009	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(43)
19/04/2023	EUR	17.134	USD	18.702	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(67)
19/04/2023	USD	16.623	EUR	15.618	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(363)
							20.726 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Equity Income tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	65	USD	70	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	8.629	SGD	11.621	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(117)

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	USD	16.730	SGD	22.531	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(227)
19/04/2023	USD	89.808	SGD	120.950	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.217)
19/04/2023	USD	910	AUD	1.365	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	USD	21	EUR	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	90	EUR	84	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	USD	2.604	SGD	3.484	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
19/04/2023	SGD	496	USD	367	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
19/04/2023	AUD	56.209	USD	37.616	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	55
19/04/2023	AUD	1.191	USD	799	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	AUD	1.555	USD	1.042	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	198	USD	147	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	SGD	1.884	USD	1.395	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
19/04/2023	EUR	3.147	USD	3.385	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	37
19/04/2023	SGD	53	USD	40	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	12.423	USD	9.361	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
19/04/2023	SGD	21.235	USD	16.001	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
19/04/2023	SGD	97.422	USD	73.408	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(90)
19/04/2023	SGD	99	USD	74	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	SGD	149	USD	111	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	SGD	119	USD	89	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	SGD	433.942	USD	322.395	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.184
19/04/2023	SGD	839.488	USD	623.694	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8.093
19/04/2023	SGD	4.506.512	USD	3.348.091	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	43.447
19/04/2023	SGD	785	USD	591	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	SGD	134	USD	101	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	99	USD	74	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	15	USD	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	8.465	USD	6.356	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
19/04/2023	EUR	727	USD	782	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
							54.167 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	GBP	1.340	EUR	1.516	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
19/04/2023	GBP	635	EUR	718	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	EUR	7.439	GBP	6.580	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(45)
19/04/2023	EUR	7.363	GBP	6.502	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32)
19/04/2023	EUR	18.964	GBP	16.677	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
19/04/2023	GBP	215	EUR	245	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	GBP	2.883.833	EUR	3.262.278	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17.520
19/04/2023	CHF	4.778.686	EUR	4.891.475	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(72.068)
19/04/2023	GBP	1.179	EUR	1.337	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	GBP	60.729	EUR	68.982	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	86
19/04/2023	GBP	635	EUR	722	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	14.675	EUR	16.760	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(70)
19/04/2023	GBP	799	EUR	907	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)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	GBP	5.000	EUR	5.676	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
19/04/2023	CHF	787	EUR	805	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
19/04/2023	GBP	14	EUR	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	44.412	CHF	43.430	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	612
							(53.987) EUR

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - American tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	98	USD	106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	23.305	USD	24.594	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	752
19/04/2023	EUR	623	USD	680	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	EUR	3.006.809	USD	3.281.959	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11.747)
19/04/2023	EUR	1.810.668	USD	1.947.741	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21.545
19/04/2023	EUR	47.802.509	USD	51.511.090	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	479.014
19/04/2023	EUR	772	USD	821	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
19/04/2023	EUR	15	USD	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	9.489	USD	10.137	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	183
19/04/2023	EUR	19.759	USD	21.109	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	381
19/04/2023	EUR	1.514	USD	1.633	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
19/04/2023	EUR	3.333	USD	3.595	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30
19/04/2023	EUR	24.190.994	USD	26.022.329	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	287.843
19/04/2023	EUR	47.335	USD	51.093	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	389
19/04/2023	EUR	56	USD	61	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	56.284	USD	61.375	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(161)
19/04/2023	EUR	67.439	USD	72.743	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	604
19/04/2023	EUR	20.655.667	USD	22.219.367	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	245.778
19/04/2023	EUR	73.725	USD	79.219	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	964
19/04/2023	EUR	15.637	USD	16.803	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	205
19/04/2023	EUR	715	USD	769	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	EUR	451.834	USD	486.040	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.376
19/04/2023	EUR	949.092	USD	1.020.941	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11.293
19/04/2023	EUR	3.285.087	USD	3.533.725	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	39.142
19/04/2023	EUR	2.693.718	USD	2.910.752	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18.942
19/04/2023	EUR	2	USD	2	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	3.098	EUR	2.875	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(29)
19/04/2023	USD	34.829	EUR	32.322	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(324)
19/04/2023	USD	9.263	EUR	8.573	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(60)
19/04/2023	EUR	8.040.978	USD	8.574.373	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	171.011
19/04/2023	EUR	601.030	USD	642.079	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11.602
19/04/2023	EUR	704.176	USD	752.270	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13.593
19/04/2023	EUR	37.433	USD	39.989	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	723
19/04/2023	EUR	672.360	USD	718.281	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12.979
19/04/2023	EUR	208	USD	225	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	207.329	USD	224.758	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	734
19/04/2023	EUR	33.536.915	USD	36.075.767	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	399.048
19/04/2023	EUR	8.380.843	USD	9.015.164	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	99.859

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	100	USD	106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	EUR	36.661.707	USD	39.761.872	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	111.474
19/04/2023	USD	111.181	EUR	105.352	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.396)
19/04/2023	USD	10.805	EUR	10.238	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(330)
19/04/2023	USD	14.669	EUR	13.900	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(448)
19/04/2023	USD	41.575	EUR	38.065	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	175
19/04/2023	USD	6.679	EUR	6.188	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(51)
19/04/2023	USD	2.195	EUR	2.043	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(27)
19/04/2023	USD	23.406	EUR	22.002	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(523)
19/04/2023	USD	3.119	EUR	2.902	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(38)
19/04/2023	USD	1.206	EUR	1.121	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
19/04/2023	USD	18.014	EUR	16.747	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(199)
19/04/2023	USD	131	EUR	121	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	7.436	EUR	6.973	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(148)
19/04/2023	USD	60.794	EUR	57.012	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.211)
19/04/2023	USD	2.541	EUR	2.352	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
19/04/2023	EUR	6.667	USD	7.184	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	67
19/04/2023	EUR	62.799	USD	67.434	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	866
							1.915.892 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - American Select tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	206	USD	220	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	USD	7.151	EUR	6.659	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(92)
19/04/2023	USD	8.519	EUR	7.858	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28)
19/04/2023	EUR	175.878	USD	189.193	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.093
19/04/2023	EUR	398.745	USD	428.931	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.745
19/04/2023	EUR	519.514	USD	558.843	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.183
19/04/2023	EUR	1.686	USD	1.812	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
19/04/2023	EUR	14.943	USD	16.056	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	195
19/04/2023	EUR	14.853	USD	15.977	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	177
19/04/2023	USD	346	EUR	320	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	EUR	9.234	USD	9.933	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	110
19/04/2023	EUR	664	USD	714	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
19/04/2023	EUR	69	USD	73	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	EUR	331	USD	354	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
19/04/2023	EUR	11.681	USD	12.479	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	225
19/04/2023	EUR	8.649	USD	9.240	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	167
19/04/2023	EUR	3.941	USD	4.210	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	76
19/04/2023	EUR	15	USD	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	5.198	USD	5.554	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	100
19/04/2023	EUR	234.443	USD	252.191	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.790
19/04/2023	USD	6.328	EUR	5.996	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(193)
							16.587 USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	USD	9.287	EUR	8.699	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(174)
19/04/2023	EUR	1.485.596	USD	1.602.209	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13.528
19/04/2023	EUR	1.568	USD	1.691	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
19/04/2023	EUR	7.045	USD	7.598	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	64
19/04/2023	EUR	54.371	USD	58.639	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	495
19/04/2023	EUR	63.438	USD	68.475	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	521
19/04/2023	EUR	721	USD	768	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
19/04/2023	EUR	10.000	USD	10.663	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	213
19/04/2023	EUR	5.000	USD	5.277	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	161
19/04/2023	EUR	63.273	USD	68.371	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	445
19/04/2023	USD	1.928.258	EUR	1.806.230	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(36.163)
19/04/2023	USD	13	SGD	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	5.794	EUR	5.368	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(44)
19/04/2023	USD	16	SGD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	16	SGD	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	9.719	EUR	9.035	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(108)
19/04/2023	USD	449	EUR	411	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	USD	2.038	EUR	1.909	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(38)
19/04/2023	EUR	90.892	USD	97.943	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	911
19/04/2023	EUR	111.180	USD	117.331	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.588
19/04/2023	EUR	24.858	USD	27.106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(71)
19/04/2023	USD	71.017	EUR	66.522	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.332)
19/04/2023	USD	22	SGD	29	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	1.402.583	EUR	1.284.466	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.589
19/04/2023	USD	1.480	EUR	1.356	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
19/04/2023	USD	6.700	EUR	6.136	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	27
19/04/2023	USD	51.573	EUR	47.230	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	206
19/04/2023	SGD	1.299	USD	965	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	EUR	2.083.480	USD	2.241.206	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24.791
19/04/2023	SGD	20	USD	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	34	USD	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	14.997	USD	16.258	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	53
19/04/2023	EUR	5.988	USD	6.434	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	78
19/04/2023	EUR	56.927.593	USD	61.237.193	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	677.371
19/04/2023	EUR	60.197	USD	64.754	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	716
19/04/2023	EUR	272.142	USD	292.744	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.238
19/04/2023	EUR	15.325	USD	16.711	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(44)
19/04/2023	SGD	16	USD	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	23.037	USD	24.985	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	70
							694.141 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	43.437	USD	46.726	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	517
19/04/2023	EUR	1.073	USD	1.163	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	SGD	371.850	USD	276.264	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.584
19/04/2023	SGD	886	USD	658	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	SGD	14.652	USD	11.042	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15)
19/04/2023	SGD	35	USD	27	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
							4.099 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Asia Equities tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	12	USD	13	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	11	USD	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	530	USD	570	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
19/04/2023	EUR	525	USD	565	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
							13 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	CHF	788	USD	867	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	USD	1.485	EUR	1.382	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
19/04/2023	USD	5.702	EUR	5.301	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(63)
19/04/2023	USD	2.415	EUR	2.289	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(74)
19/04/2023	USD	1.964	EUR	1.801	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	USD	16.340	EUR	15.149	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(136)
19/04/2023	USD	7.780	EUR	7.296	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(155)
19/04/2023	USD	7.459	EUR	6.903	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(48)
19/04/2023	USD	4.840	EUR	4.463	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
19/04/2023	USD	5.111	EUR	4.743	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(47)
19/04/2023	USD	8.760	EUR	8.234	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(196)
19/04/2023	SGD	90.831.288	USD	67.482.664	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	875.691
19/04/2023	SGD	2.211.696	USD	1.667.302	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.810)
19/04/2023	USD	370	EUR	341	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	SGD	3.135.633	USD	2.339.410	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20.423
19/04/2023	GBP	613	USD	746	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
19/04/2023	GBP	21	USD	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	799	USD	859	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
19/04/2023	EUR	130.892	USD	142.870	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(511)
19/04/2023	EUR	577.962	USD	621.716	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.877
19/04/2023	EUR	13.282	USD	14.498	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(52)
19/04/2023	EUR	19.639	USD	20.981	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	379
19/04/2023	EUR	5.676.068	USD	6.105.765	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	67.538
19/04/2023	EUR	98	USD	106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	27	USD	29	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	193.345	USD	206.550	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.732
19/04/2023	CHF	23	USD	25	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)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	GBP	15	USD	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	2.490	EUR	2.280	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
							970.551 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	776	USD	835	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	EUR	19	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	19	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	4.990	USD	5.321	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	106
19/04/2023	EUR	506.802	USD	546.120	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.080
19/04/2023	EUR	1.490	USD	1.615	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	CHF	21	USD	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	763	USD	820	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	CHF	20	USD	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	837	USD	922	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
19/04/2023	EUR	16	USD	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	11.212	USD	12.238	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(44)
19/04/2023	EUR	19	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	749	USD	806	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	EUR	773	USD	831	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	CHF	846	USD	932	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
19/04/2023	EUR	20.236	USD	21.768	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	241
							5.416 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	46	USD	49	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	2.241	EUR	2.065	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
19/04/2023	USD	9.918	EUR	9.220	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(101)
19/04/2023	USD	99	EUR	94	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	USD	137.801	EUR	128.103	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.402)
19/04/2023	USD	9.918	EUR	9.189	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(69)
19/04/2023	USD	10.340	EUR	9.482	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25
19/04/2023	USD	1.064	EUR	989	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
19/04/2023	SGD	17.553	EUR	12.190	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(44)
19/04/2023	SGD	5.207	EUR	3.618	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
19/04/2023	SGD	439.402	EUR	303.763	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	289
19/04/2023	SGD	2.694	EUR	1.871	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
19/04/2023	SGD	2.663	EUR	1.861	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
19/04/2023	SGD	5.367	EUR	3.742	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28)
19/04/2023	SGD	6.984	EUR	4.878	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(45)
19/04/2023	SGD	21.594.109	EUR	14.915.595	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26.842

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	SGD	2.824	EUR	1.957	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	SGD	41.715	EUR	28.769	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	97
19/04/2023	SGD	3.202	EUR	2.227	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
19/04/2023	SGD	33.404	EUR	23.433	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(319)
19/04/2023	EUR	4.060	SGD	5.858	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
19/04/2023	EUR	13.217	SGD	18.989	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	78
19/04/2023	EUR	581.049	SGD	838.691	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	702
19/04/2023	EUR	21.260	SGD	30.785	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(43)
19/04/2023	EUR	891	SGD	1.287	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	5.757	USD	6.170	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	84
19/04/2023	USD	90.420	EUR	84.205	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.068)
19/04/2023	USD	3.122	EUR	2.859	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
							24.948 EUR

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	CHF	60.425	EUR	61.851	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(912)
19/04/2023	SGD	314.062	EUR	216.975	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	347
19/04/2023	EUR	4.516	USD	4.840	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	66
19/04/2023	EUR	547	SGD	787	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	EUR	6.984	SGD	10.053	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	28
19/04/2023	EUR	13.817	SGD	19.784	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	128
19/04/2023	EUR	292.486	SGD	422.177	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	353
19/04/2023	EUR	26.023	SGD	37.409	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	138
19/04/2023	EUR	23.890	SGD	34.470	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	38
19/04/2023	EUR	3.499	SGD	5.026	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21
19/04/2023	SGD	504	EUR	349	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	209	SGD	300	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	SGD	1.407	EUR	975	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	SGD	1.575	EUR	1.087	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	USD	3.180	EUR	2.956	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32)
19/04/2023	USD	136.057	EUR	126.482	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.385)
19/04/2023	SGD	18.607	EUR	13.053	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(178)
19/04/2023	USD	88	EUR	81	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	3.835	EUR	3.514	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	EUR	108	USD	116	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	CHF	1.548	EUR	1.556	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
19/04/2023	SGD	11.645.914	EUR	8.044.126	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14.476
19/04/2023	EUR	2.332	CHF	2.272	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	41
							13.155 EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	CHF	57.377	EUR	58.736	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(869)
19/04/2023	EUR	267.753	CHF	260.870	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.655
19/04/2023	EUR	80.593	CHF	78.521	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.401
19/04/2023	EUR	44.833	CHF	44.643	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(190)
19/04/2023	EUR	34.156	CHF	33.978	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(112)
19/04/2023	USD	8.807.227	EUR	8.187.414	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(89.574)
19/04/2023	EUR	20.678	CHF	20.540	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(37)
19/04/2023	CHF	4.881	EUR	4.920	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	CHF	135.008	EUR	136.078	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	80
19/04/2023	CHF	185.764	EUR	190.148	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.802)
19/04/2023	CHF	6.803.169	EUR	6.963.740	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(102.601)
19/04/2023	CHF	2.031.801	EUR	2.079.756	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30.642)
19/04/2023	EUR	7.289	CHF	7.101	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	127
19/04/2023	USD	1.153.754	EUR	1.072.558	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11.734)
19/04/2023	USD	191.190	EUR	176.375	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(585)
19/04/2023	USD	370.602	EUR	341.885	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.134)
19/04/2023	EUR	5.558	USD	5.989	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	51
19/04/2023	EUR	92.246	USD	100.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	300
19/04/2023	EUR	83.030	USD	89.314	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	911
19/04/2023	EUR	292.571	USD	313.558	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.273
19/04/2023	EUR	582.334	USD	624.106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8.506
19/04/2023	EUR	35.530	USD	38.806	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(151)
19/04/2023	EUR	6.693	USD	7.310	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28)
19/04/2023	EUR	38.276	USD	41.022	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	559
19/04/2023	CHF	39.881	EUR	40.197	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24
19/04/2023	USD	25.060	EUR	23.118	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(77)
19/04/2023	USD	17.345.031	EUR	16.124.365	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(176.406)
							(396.052) EUR

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - European Select tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	2.664	GBP	2.338	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	GBP	1.306.065	EUR	1.477.460	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7.934
19/04/2023	USD	960	EUR	892	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
19/04/2023	USD	9.906.542	EUR	9.209.364	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(100.755)
19/04/2023	SGD	29.700	EUR	20.483	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	69
19/04/2023	GBP	250	EUR	283	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	358.114	EUR	329.879	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(609)
19/04/2023	USD	225.308	EUR	207.543	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(383)
19/04/2023	SGD	644.041	EUR	444.945	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	711
19/04/2023	GBP	14.384	EUR	16.339	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
19/04/2023	GBP	116.357	EUR	132.344	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
19/04/2023	GBP	5.200.219	EUR	5.882.643	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	31.592
19/04/2023	USD	27	EUR	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	1.103	EUR	1.247	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)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	75	GBP	66	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	31.783	SGD	45.689	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	168
19/04/2023	EUR	158.002	SGD	227.517	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	567
19/04/2023	EUR	307.848	SGD	443.371	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.050
19/04/2023	EUR	383.701	USD	408.394	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8.209
19/04/2023	EUR	242.517	USD	258.125	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.189
19/04/2023	EUR	212	USD	228	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	EUR	23	USD	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	271	SGD	391	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	139	EUR	158	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	204	SGD	296	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	2.500	EUR	2.852	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
19/04/2023	USD	204.246	EUR	191.188	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.393)
19/04/2023	EUR	2.513	GBP	2.219	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
19/04/2023	EUR	770.283	GBP	680.203	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.317)
19/04/2023	EUR	1.466	GBP	1.289	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	9.353	GBP	8.239	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
19/04/2023	EUR	155.441	GBP	136.757	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(93)
19/04/2023	EUR	39.187	GBP	34.477	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24)
19/04/2023	EUR	8.423	GBP	7.446	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(45)
19/04/2023	USD	19	EUR	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	12.659	EUR	14.458	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(60)
19/04/2023	GBP	1.152	EUR	1.308	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	SGD	2.877	EUR	2.018	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(27)
19/04/2023	SGD	451.488	EUR	315.519	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.104)
19/04/2023	SGD	713.522	EUR	493.266	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	469
19/04/2023	USD	992	EUR	932	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
19/04/2023	SGD	5.157	EUR	3.602	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(33)
19/04/2023	GBP	2	EUR	2	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	323.910	EUR	303.201	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.381)
19/04/2023	GBP	106.908	EUR	121.876	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(290)
19/04/2023	GBP	26.847	EUR	30.605	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(73)
19/04/2023	GBP	222	EUR	251	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	15.706.533	EUR	14.601.177	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(159.744)
19/04/2023	SGD	28.407.605	EUR	19.621.848	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	35.313
19/04/2023	GBP	16.172	EUR	18.287	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	105
19/04/2023	EUR	508.777	SGD	734.373	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	615
							(185.379) EUR

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	347.933	CHF	338.989	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.050
19/04/2023	EUR	27	CHF	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	63	EUR	63	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	220.729	EUR	222.523	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	87
19/04/2023	CHF	17	EUR	17	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)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	CHF	2.886	EUR	2.954	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(44)
19/04/2023	CHF	10.158.559	EUR	10.398.326	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(153.205)
19/04/2023	CHF	770	EUR	788	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
19/04/2023	EUR	99	CHF	96	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
							(147.122) EUR

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	100	USD	106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	GBP	151.939	USD	184.881	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.058
19/04/2023	USD	7.402	EUR	6.893	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(95)
19/04/2023	EUR	96	USD	104	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	1.000	USD	1.081	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
19/04/2023	EUR	99	USD	106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	1.233.313	USD	1.326.679	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14.675
19/04/2023	EUR	4.285.314	USD	4.609.726	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	50.990
19/04/2023	EUR	10.000	USD	10.745	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	131
							68.771 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Technology tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	USD	22.564	EUR	20.999	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(274)
19/04/2023	EUR	49.131	USD	53.627	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(192)
19/04/2023	EUR	648.613	USD	707.967	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.534)
19/04/2023	EUR	990.785	USD	1.081.451	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.871)
19/04/2023	EUR	128.597	USD	140.365	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(502)
19/04/2023	CHF	844.103	USD	929.423	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.553)
19/04/2023	CHF	26.201	USD	28.421	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	318
19/04/2023	USD	550.640	EUR	513.784	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.145)
19/04/2023	USD	17.161	EUR	15.830	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(56)
19/04/2023	USD	760	EUR	704	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
19/04/2023	USD	23.542	EUR	22.130	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(526)
19/04/2023	USD	35.436	EUR	33.310	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(791)
19/04/2023	USD	30.163	EUR	28.353	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(673)
19/04/2023	USD	86.807	EUR	81.599	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.938)
19/04/2023	USD	59	EUR	55	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	USD	82.653	EUR	76.209	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(231)
19/04/2023	USD	44.555	EUR	41.081	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(125)
19/04/2023	USD	342.241	EUR	316.722	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.225)
19/04/2023	USD	187.617	EUR	173.628	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.220)
19/04/2023	USD	18.383	EUR	17.420	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(562)
19/04/2023	USD	282	EUR	259	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	1.873	EUR	1.736	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	661	USD	722	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	USD	19.604	EUR	18.163	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(149)
19/04/2023	EUR	2.605	USD	2.846	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
19/04/2023	EUR	4.754.827	USD	5.114.783	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	56.577
19/04/2023	USD	1.989	EUR	1.851	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24)
19/04/2023	USD	41.994	EUR	39.039	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(465)
19/04/2023	EUR	60.000	USD	64.763	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	493
19/04/2023	EUR	32.209	USD	34.766	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	265
19/04/2023	EUR	31.219	USD	34.043	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(89)
19/04/2023	EUR	1.815.686	USD	1.953.139	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21.604
19/04/2023	EUR	391	USD	412	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	EUR	1.401	USD	1.511	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	EUR	2.927	USD	3.144	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	40
19/04/2023	EUR	20.905	USD	22.292	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	445
19/04/2023	EUR	11.659	USD	12.432	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	248
19/04/2023	EUR	5.075	USD	5.484	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	36
19/04/2023	EUR	1.771	USD	1.920	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	EUR	1.500.000	USD	1.616.372	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15.031
19/04/2023	EUR	212.886	USD	229.402	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.133
19/04/2023	EUR	56.004	USD	59.829	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.081
19/04/2023	EUR	768.115	USD	820.577	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14.827
19/04/2023	EUR	1.127.730	USD	1.204.752	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21.769
19/04/2023	EUR	145.919	USD	155.885	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.817
19/04/2023	EUR	23.318.799	USD	25.084.107	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	277.465
19/04/2023	EUR	36.786.443	USD	39.571.295	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	437.714
19/04/2023	EUR	5.792	USD	6.230	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	69
19/04/2023	CHF	22.197	USD	24.338	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
							824.792 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - UK Equities tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	1.166	GBP	1.032	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
19/04/2023	EUR	857	GBP	757	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
19/04/2023	EUR	13.777	GBP	12.179	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(66)
19/04/2023	CHF	933	GBP	844	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
19/04/2023	EUR	850	GBP	751	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
19/04/2023	GBP	50.968	EUR	57.891	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	66
19/04/2023	GBP	2.379	CHF	2.632	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	45
19/04/2023	GBP	93.595	USD	113.901	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.512
19/04/2023	GBP	20	EUR	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	23	CHF	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	23	USD	28	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	20	EUR	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	20	EUR	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	23	CHF	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	23	USD	28	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)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	GBP	14.936	USD	18.177	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	241
19/04/2023	GBP	8.545	EUR	9.677	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	37
19/04/2023	GBP	4.872	EUR	5.550	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
19/04/2023	GBP	2.569	EUR	2.918	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	GBP	6.800	EUR	7.746	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
19/04/2023	EUR	48.448	GBP	42.652	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(53)
19/04/2023	CHF	942	GBP	853	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
19/04/2023	EUR	856	GBP	757	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
19/04/2023	CHF	943	GBP	854	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
19/04/2023	EUR	82.304	GBP	72.756	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(389)
19/04/2023	CHF	41.344	GBP	37.414	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(752)
19/04/2023	EUR	2.929	GBP	2.586	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
19/04/2023	GBP	22.214	EUR	25.231	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29
19/04/2023	EUR	180	GBP	158	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	95.945	GBP	84.221	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	141
19/04/2023	EUR	105.860	GBP	93.358	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(278)
19/04/2023	EUR	21.226	GBP	18.687	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23)
19/04/2023	EUR	52.333	GBP	46.072	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(57)
19/04/2023	EUR	116.692	GBP	102.732	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(128)
19/04/2023	CHF	1.510	GBP	1.336	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	EUR	366	GBP	322	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	1.308	GBP	1.148	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	GBP	1.004	CHF	1.111	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
19/04/2023	GBP	1.994	CHF	2.206	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	38
19/04/2023	GBP	202.165	EUR	229.627	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	261
19/04/2023	CHF	20	GBP	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	26	GBP	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	5.001	GBP	4.411	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
19/04/2023	EUR	200	GBP	177	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	EUR	1.989	GBP	1.758	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
19/04/2023	EUR	2.162.449	GBP	1.911.591	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10.211)
19/04/2023	EUR	92.948	GBP	81.483	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	244
19/04/2023	EUR	19	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	679.278	GBP	558.245	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9.083)
19/04/2023	CHF	72.304	GBP	65.431	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.315)
19/04/2023	EUR	5.061.591	GBP	4.474.414	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23.901)
19/04/2023	EUR	2.394.501	GBP	2.116.723	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11.307)
19/04/2023	CHF	98.050	GBP	88.729	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.783)
19/04/2023	EUR	221	GBP	194	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	230	GBP	201	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	2.095	GBP	1.852	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
19/04/2023	EUR	942.098	GBP	832.809	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.449)
19/04/2023	EUR	1.591	GBP	1.400	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	USD	26	GBP	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	19	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	56.591	EUR	64.278	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	73
19/04/2023	GBP	8.283	USD	10.135	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	89
19/04/2023	GBP	845	EUR	963	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	GBP	23	CHF	25	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)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	GBP	23	USD	28	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	16.509	GBP	13.316	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	31
19/04/2023	USD	1.061	GBP	872	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
19/04/2023	CHF	20	GBP	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	1.061	GBP	872	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
19/04/2023	USD	1.053	GBP	865	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
19/04/2023	EUR	1.721	GBP	1.515	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	CHF	2.099	GBP	1.856	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	USD	103.762	GBP	83.695	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	192
19/04/2023	EUR	19	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	20	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	26	GBP	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	4.258.892	GBP	3.500.044	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(56.947)
19/04/2023	CHF	882	GBP	780	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
							(117.886) GBP

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - UK Equity Income tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	GBP	67.291	USD	81.890	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.087
19/04/2023	USD	27	GBP	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	24.580	GBP	19.826	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	45
19/04/2023	USD	1.052.732	GBP	865.156	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14.076)
19/04/2023	USD	3.012.171	GBP	2.475.463	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40.275)
19/04/2023	USD	67.571	GBP	54.503	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	125
19/04/2023	USD	695	GBP	561	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	29.287	GBP	24.069	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(392)
19/04/2023	CHF	2.562	GBP	2.266	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
19/04/2023	CHF	124.069	GBP	112.276	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.256)
19/04/2023	CHF	1.567	GBP	1.386	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	CHF	12.718	GBP	11.248	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30
19/04/2023	CHF	20	GBP	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	75.493	GBP	68.317	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.373)
19/04/2023	USD	949.810	GBP	780.573	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12.700)
19/04/2023	CHF	613.512	GBP	555.195	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11.155)
19/04/2023	EUR	105.044	GBP	92.087	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	275
19/04/2023	GBP	72.380	EUR	82.212	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	93
19/04/2023	EUR	10.000	GBP	8.803	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
19/04/2023	EUR	1.487.061	GBP	1.314.553	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.022)
19/04/2023	EUR	54.719	GBP	48.371	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(258)
19/04/2023	EUR	259.437	GBP	229.340	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.225)
19/04/2023	EUR	442.546	GBP	391.207	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.090)
19/04/2023	EUR	115.301	GBP	101.925	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(544)
19/04/2023	EUR	279.194	GBP	246.806	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.318)
19/04/2023	EUR	40.814	GBP	35.932	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(45)
19/04/2023	EUR	1.908.854	GBP	1.687.415	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9.014)
19/04/2023	EUR	1.548.705	GBP	1.369.045	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.313)

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	33.572	GBP	29.556	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(37)
19/04/2023	CHF	986	GBP	892	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
19/04/2023	EUR	20	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	1.983.784	GBP	1.630.314	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26.525)
19/04/2023	USD	1.116	GBP	917	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15)
19/04/2023	GBP	36	SGD	58	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	10.429	EUR	11.846	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	GBP	2.723	EUR	3.093	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	GBP	9.135	EUR	10.375	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
19/04/2023	GBP	31.655	USD	38.522	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	511
19/04/2023	GBP	37	USD	45	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	GBP	1.831	CHF	2.026	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	35
19/04/2023	GBP	35.681	USD	43.423	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	576
19/04/2023	GBP	24.074	CHF	26.633	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	456
19/04/2023	GBP	39	CHF	43	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	GBP	98.811	USD	120.250	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.596
19/04/2023	GBP	57.469	EUR	65.275	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	74
19/04/2023	GBP	973	USD	1.184	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
19/04/2023	USD	22.452	GBP	18.110	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	41
19/04/2023	GBP	21	EUR	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	56.026	EUR	63.637	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	72
19/04/2023	EUR	10.000	GBP	8.840	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(48)
19/04/2023	EUR	30.255	GBP	26.636	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(33)
19/04/2023	EUR	1.142	GBP	1.006	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	EUR	5.627	GBP	4.954	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
19/04/2023	GBP	2.115	EUR	2.402	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	GBP	220.882	USD	271.999	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	985
19/04/2023	GBP	140.733	USD	170.559	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.846
19/04/2023	GBP	49.596	EUR	56.303	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	90
19/04/2023	GBP	218.380	USD	269.316	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	651
19/04/2023	GBP	9.629	EUR	10.937	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
19/04/2023	GBP	4.888	CHF	5.407	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	93
19/04/2023	SGD	1.381	GBP	844	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	GBP	9.836	EUR	11.126	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	53
19/04/2023	EUR	885	GBP	783	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
							(127.950) GBP

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	1.463	USD	1.581	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
19/04/2023	GBP	4	USD	5	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	419.854	USD	451.638	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.996
19/04/2023	EUR	7.498	USD	7.913	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	242
19/04/2023	EUR	784	USD	844	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	GBP	29.080	USD	35.385	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	585
19/04/2023	GBP	9.636	USD	11.726	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	194

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	100.205	USD	107.791	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.192
19/04/2023	EUR	2.401.859	USD	2.583.688	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	28.580
19/04/2023	GBP	636.371	USD	774.343	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12.807
19/04/2023	GBP	8.427.539	USD	10.254.722	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	169.605
19/04/2023	USD	1.395.104	GBP	1.140.110	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15.133)
19/04/2023	USD	2.751	EUR	2.523	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
19/04/2023	USD	15.231	GBP	12.515	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(250)
19/04/2023	USD	233.065	GBP	191.513	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.823)
19/04/2023	USD	1.387.979	GBP	1.127.135	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.212)
19/04/2023	USD	707	EUR	665	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16)
19/04/2023	USD	810	GBP	666	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
19/04/2023	USD	9.416	EUR	8.922	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(288)
19/04/2023	USD	2.552	EUR	2.381	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(38)
19/04/2023	USD	60.053	EUR	55.729	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(558)
19/04/2023	USD	1.230	GBP	1.011	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
19/04/2023	USD	274.075	GBP	225.484	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.832)
19/04/2023	CHF	10.301	USD	11.342	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(43)
19/04/2023	EUR	1.173	USD	1.260	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
19/04/2023	EUR	1.800	USD	1.919	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	38
							187.055 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	18	GBP	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	9.805	GBP	8.658	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42)
19/04/2023	EUR	181	GBP	158	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	41.179	GBP	36.099	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	124
19/04/2023	USD	1.915.217	EUR	1.780.432	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19.479)
19/04/2023	EUR	39.277	GBP	34.431	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	118
19/04/2023	EUR	748	GBP	657	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	369	GBP	324	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	121.261	GBP	106.301	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	365
19/04/2023	GBP	23	EUR	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	76.164	EUR	86.159	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	463
19/04/2023	GBP	690	EUR	781	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	GBP	1.512.411	EUR	1.710.884	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9.188
19/04/2023	GBP	1.743.077	EUR	1.971.821	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10.589
19/04/2023	GBP	4.598.592	EUR	5.202.065	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	27.937
19/04/2023	EUR	36.458	USD	39.144	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	467
19/04/2023	GBP	11.355	EUR	12.845	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	69
19/04/2023	GBP	228	EUR	260	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	EUR	17.168	GBP	15.098	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	EUR	19	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	29	GBP	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	533	GBP	468	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	2.004	GBP	1.757	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	73.002	GBP	64.177	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	EUR	291	GBP	255	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	4.148	GBP	3.636	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
19/04/2023	EUR	40	GBP	35	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	11.606	GBP	10.260	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(63)
19/04/2023	EUR	699	GBP	616	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	EUR	586	GBP	514	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	35	GBP	31	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	33	GBP	29	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	31.708	GBP	27.963	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(95)
19/04/2023	EUR	687	GBP	607	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
19/04/2023	EUR	838	GBP	741	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	EUR	487	GBP	429	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	EUR	11	GBP	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	134	GBP	118	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	868	GBP	767	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	GBP	477	EUR	542	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
05/04/2023	GBP	558.443	EUR	636.598	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(1.154)
05/04/2023	USD	459.539	EUR	431.317	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(8.451)
05/04/2023	GBP	475.087	EUR	538.804	Operaciones comerciales	JP Morgan	1.790
05/04/2023	GBP	525.043	EUR	597.664	Operaciones comerciales	Lloyds	(225)
05/04/2023	GBP	500.000	EUR	569.352	Operaciones comerciales	Barclays	(410)
05/04/2023	GBP	3.097.510	EUR	3.518.542	Operaciones comerciales	JP Morgan	6.068
05/04/2023	USD	674.753	EUR	628.802	Operaciones comerciales	Lloyds	(7.898)
05/04/2023	EUR	323.329	USD	346.198	Operaciones comerciales	NatWest Markets	4.760
05/04/2023	GBP	500.000	EUR	570.671	Operaciones comerciales	JP Morgan	(1.729)
05/04/2023	EUR	256.942	GBP	227.755	Operaciones comerciales	Barclays	(2.218)
05/04/2023	USD	3.766.280	EUR	3.479.198	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(13.485)
05/04/2023	USD	428.278	EUR	395.637	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(1.537)
05/04/2023	USD	221.532	EUR	205.729	Operaciones comerciales	Lloyds	(1.876)
05/04/2023	USD	2.525.661	EUR	2.350.026	Operaciones comerciales	JP Morgan	(25.925)
05/04/2023	EUR	640.613	GBP	562.834	Operaciones comerciales	JP Morgan	174
05/04/2023	EUR	97.330.858	GBP	86.517.536	Operaciones comerciales	JP Morgan	(1.116.238)
05/04/2023	EUR	1.688.212	GBP	1.500.000	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(18.617)
05/04/2023	GBP	220.795	EUR	251.751	Operaciones comerciales	Lloyds	(512)
05/04/2023	GBP	1.500.000	EUR	1.702.779	Operaciones comerciales	JP Morgan	4.049
05/04/2023	EUR	247.518	USD	265.472	Operaciones comerciales	NatWest Markets	3.233
05/04/2023	EUR	249.556	USD	269.349	Operaciones comerciales	JP Morgan	1.703
05/04/2023	EUR	72.230.562	USD	76.672.995	Operaciones comerciales	JP Morgan	1.676.871
05/04/2023	EUR	671.693	USD	719.090	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	9.992
05/04/2023	USD	250.000	EUR	233.513	Operaciones comerciales	JP Morgan	(3.465)
05/04/2023	USD	286.219	EUR	263.459	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(82)
05/04/2023	GBP	324.233	EUR	368.392	Operaciones comerciales	JP Morgan	548
05/04/2023	USD	1.415.553	EUR	1.332.336	Operaciones comerciales	Lloyds	(29.752)
05/04/2023	EUR	592.886	USD	645.838	Operaciones comerciales	JP Morgan	(1.411)
05/04/2023	GBP	482.993	EUR	546.093	Operaciones comerciales	NatWest Markets	3.498
							507.363 EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
04/05/2023	EUR	4.288.956	GBP	3.772.347	Operaciones comerciales	JP Morgan	1.021
04/05/2023	EUR	3.675.473	USD	4.006.616	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(5.241)
19/04/2023	EUR	238.744	GBP	209.290	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	718
19/04/2023	EUR	12	NOK	132	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	11	NOK	124	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	14	GBP	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	14	GBP	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	14	GBP	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	14	GBP	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	11	GBP	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	11	GBP	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	11	GBP	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	14	GBP	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	167.603	GBP	147.457	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(101)
19/04/2023	USD	986	EUR	917	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
19/04/2023	EUR	11	GBP	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	11	GBP	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	NOK	8.408	EUR	744	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	NOK	8.292	EUR	734	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	SEK	8.185	EUR	721	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
19/04/2023	GBP	716	EUR	810	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	USD	981	EUR	912	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
19/04/2023	GBP	704	EUR	797	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	CHF	868	EUR	889	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
19/04/2023	EUR	13	NOK	144	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	12	SEK	133	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	13	NOK	145	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	16	USD	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	710	EUR	803	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	USD	6.039	EUR	5.614	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(61)
19/04/2023	CHF	872	EUR	892	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
19/04/2023	GBP	709	EUR	802	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	EUR	15	CHF	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	24	CHF	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	12	CHF	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	13	SEK	140	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	16	USD	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	96	USD	104	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	984	EUR	915	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
19/04/2023	EUR	25	USD	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	10	USD	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	10	USD	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	977	EUR	908	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
19/04/2023	EUR	10	USD	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	16	USD	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	977	EUR	908	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
19/04/2023	GBP	12.396.179	EUR	14.022.928	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	75.309

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	10	USD	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	67	USD	72	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	16	USD	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	714	EUR	808	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
04/04/2023	GBP	43.608	EUR	49.712	Operaciones comerciales	JP Morgan	(89)
04/04/2023	USD	146.655	EUR	138.049	Operaciones comerciales	JP Morgan	(3.090)
04/04/2023	GBP	150.000	EUR	170.569	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	120
04/04/2023	GBP	27.225	EUR	31.020	Operaciones comerciales	Barclays	(39)
04/04/2023	USD	268.470	EUR	253.140	Operaciones comerciales	JP Morgan	(6.079)
04/04/2023	USD	180.512	EUR	167.967	Operaciones comerciales	JP Morgan	(1.850)
04/04/2023	USD	30.181	EUR	28.330	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(555)
04/04/2023	USD	43.622	EUR	40.657	Operaciones comerciales	JP Morgan	(514)
04/04/2023	GBP	25.741	EUR	29.303	Operaciones comerciales	Barclays	(12)
04/04/2023	USD	200.000	EUR	185.463	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(1.412)
04/04/2023	GBP	573.820	EUR	654.911	Operaciones comerciales	JP Morgan	(1.945)
04/04/2023	GBP	25.761	EUR	29.187	Operaciones comerciales	JP Morgan	126
04/04/2023	EUR	36.137	GBP	31.748	Operaciones comerciales	JP Morgan	10
04/04/2023	EUR	5.569.729	GBP	4.936.754	Operaciones comerciales	Barclays	(47.952)
04/04/2023	USD	257.670	EUR	237.724	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(603)
04/04/2023	EUR	39.368	USD	42.882	Operaciones comerciales	JP Morgan	(94)
04/04/2023	EUR	28.347	USD	30.399	Operaciones comerciales	Barclays	372
04/04/2023	EUR	4.767.226	USD	5.101.861	Operaciones comerciales	Barclays	72.235
04/04/2023	GBP	250.000	EUR	284.681	Operaciones comerciales	JP Morgan	(199)
04/04/2023	GBP	100.000	EUR	113.880	Operaciones comerciales	Barclays	(87)
04/04/2023	USD	41.416	EUR	38.262	Operaciones comerciales	Barclays	(149)
							79.781 EUR

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	255.062	GBP	225.484	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.382)
19/04/2023	EUR	23	USD	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	927	EUR	949	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
19/04/2023	CHF	19	EUR	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	22	EUR	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	3.588	EUR	4.084	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	USD	1.047	EUR	974	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
19/04/2023	GBP	175.074	EUR	198.049	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.064
19/04/2023	GBP	9.445.688	EUR	10.685.244	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	57.383
19/04/2023	GBP	767	EUR	867	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	GBP	190.937	EUR	217.283	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(129)
19/04/2023	GBP	16	EUR	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	476	EUR	538	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	EUR	4.109	GBP	3.617	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	EUR	372.042	GBP	327.549	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(481)
19/04/2023	EUR	1.694.815	GBP	1.496.617	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.299)
19/04/2023	EUR	771.282	GBP	678.293	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(144)

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	1.534.343	GBP	1.350.728	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.849)
19/04/2023	EUR	21	GBP	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	27	CHF	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
							47.139 EUR

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	4.356	USD	4.686	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	52
19/04/2023	EUR	36.265	USD	38.742	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	700
19/04/2023	EUR	264	USD	282	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	EUR	90	USD	97	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	EUR	663	USD	700	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21
19/04/2023	EUR	1.738.552	USD	1.870.166	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20.686
19/04/2023	EUR	12.664	USD	13.623	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	151
19/04/2023	USD	5	EUR	5	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
							21.617 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	EUR	14	USD	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	3.284	USD	3.565	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
19/04/2023	EUR	614	USD	661	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
19/04/2023	EUR	140.057	USD	150.660	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.666
19/04/2023	EUR	14	USD	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	3.194	USD	3.412	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	62
19/04/2023	USD	14	EUR	13	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	3.250	EUR	3.033	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(48)
							1.694 USD

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	USD	864	EUR	805	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
19/04/2023	EUR	116.664	USD	126.282	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	601
19/04/2023	GBP	22	USD	27	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	2.395.600	USD	2.914.992	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	48.211
19/04/2023	GBP	843.534	USD	1.026.421	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16.976
19/04/2023	GBP	47.385.733	USD	57.659.481	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	953.639
19/04/2023	GBP	17.384	USD	21.437	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	66
19/04/2023	GBP	956.990	USD	1.180.093	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.642

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	GBP	48.557	USD	59.877	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	185
19/04/2023	GBP	400	USD	487	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
19/04/2023	GBP	2.150	USD	2.606	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	54
19/04/2023	GBP	343	USD	420	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	GBP	3.431	USD	4.197	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	47
19/04/2023	GBP	100	USD	123	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	GBP	25	USD	31	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	1.153	USD	1.428	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	GBP	2.421	USD	2.969	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26
19/04/2023	SGD	7.920	USD	5.943	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
19/04/2023	SGD	5.272.279	USD	3.917.014	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	50.829
19/04/2023	SGD	94.304	USD	71.040	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(68)
19/04/2023	EUR	32.952	USD	35.668	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	170
19/04/2023	EUR	7.480	USD	8.032	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	103
19/04/2023	EUR	99	USD	107	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	98	USD	106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	50.723	SGD	67.553	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(116)
19/04/2023	USD	33.673	SGD	45.052	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(232)
19/04/2023	USD	55.292	GBP	45.086	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(476)
19/04/2023	USD	1.220	GBP	1.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
19/04/2023	CHF	1.797.125	USD	1.978.774	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.564)
19/04/2023	CHF	33.384	USD	36.483	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	135
19/04/2023	CHF	19	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	1.018	USD	1.120	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
19/04/2023	EUR	500	USD	540	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	USD	2.584	SGD	3.429	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	EUR	2.490	USD	2.655	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	53
19/04/2023	EUR	1.198	USD	1.264	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	39
19/04/2023	EUR	1.631.693	USD	1.755.217	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19.415
19/04/2023	EUR	5.754.192	USD	6.189.803	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	68.468
19/04/2023	EUR	60.379	USD	65.357	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	311
19/04/2023	EUR	3.279	USD	3.550	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
19/04/2023	EUR	1.000	USD	1.084	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	EUR	161.334	USD	173.548	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.920
19/04/2023	EUR	298	USD	321	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	EUR	2.062	USD	2.219	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25
19/04/2023	EUR	3.014.174	USD	3.242.356	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	35.865
19/04/2023	USD	95.679	SGD	128.814	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.264)
19/04/2023	USD	11.812	SGD	15.800	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(79)
19/04/2023	USD	1.869	SGD	2.516	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24)
19/04/2023	USD	964	GBP	782	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	USD	136	GBP	110	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	12.525	GBP	10.404	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(344)
19/04/2023	USD	8.170	GBP	6.786	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(224)
19/04/2023	USD	2.076	GBP	1.724	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(57)
19/04/2023	USD	148	GBP	122	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	USD	657	GBP	533	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	USD	240	GBP	195	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	USD	513	GBP	418	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
19/04/2023	USD	11.255	GBP	9.250	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(186)
19/04/2023	USD	6.164	GBP	5.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21)
19/04/2023	USD	78.663	GBP	65.003	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.741)
19/04/2023	USD	1.525.629	GBP	1.260.702	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(33.766)
19/04/2023	USD	677	GBP	549	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	USD	5.393	EUR	5.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(45)
19/04/2023	USD	8.568	EUR	7.943	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(71)
19/04/2023	USD	169.992	EUR	159.713	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.709)
19/04/2023	USD	48.432	EUR	45.504	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.057)
19/04/2023	USD	44.202	EUR	40.471	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	186
19/04/2023	USD	89.014	EUR	83.632	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.942)
19/04/2023	USD	9.985	GBP	8.183	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(137)
19/04/2023	USD	27.945	GBP	23.092	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(619)
19/04/2023	USD	1.807.032	GBP	1.486.657	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(31.856)
19/04/2023	USD	4.257	GBP	3.504	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(78)
19/04/2023	USD	33.633	SGD	45.433	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(558)
19/04/2023	USD	2.748	SGD	3.638	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
19/04/2023	USD	258.994	SGD	348.647	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.390)
19/04/2023	USD	11.551	SGD	15.376	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21)
19/04/2023	USD	115.539	SGD	155.211	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.270)
19/04/2023	USD	2.193	SGD	2.911	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	USD	91.110	SGD	122.270	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(908)
19/04/2023	USD	31	CHF	28	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	981	CHF	901	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
19/04/2023	USD	1.067	GBP	878	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
19/04/2023	USD	53.997	CHF	49.766	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(589)
19/04/2023	USD	10.887	EUR	10.210	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(217)
19/04/2023	USD	4.766	EUR	4.478	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(104)
19/04/2023	USD	9.244	EUR	8.477	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24
19/04/2023	USD	4.519	EUR	4.144	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
19/04/2023	USD	19.690	EUR	18.056	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	52
19/04/2023	USD	8.488	EUR	7.900	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(103)
19/04/2023	USD	152	EUR	141	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	USD	494	GBP	399	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	3.775	GBP	3.106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(67)
19/04/2023	USD	52.245	CHF	48.114	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(528)
19/04/2023	USD	17.519	SGD	23.274	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
							1.107.623 USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

A 31 de marzo de 2023, 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 en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Venta	EUR	1.300.000	20/06/2025	16.406	0,00
CDS	JPMorgan	Glencore International	Venta	EUR	1.100.000	20/06/2026	137.572	0,02
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Venta	EUR	1.770.000	20/12/2026	248.476	0,03
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	4.650.000	20/06/2027	41.686	0,00
CDS	JPMorgan	SSE plc	Compra	EUR	1.400.000	20/06/2027	(30.170)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Compra	EUR	1.200.000	20/06/2027	(1.715)	(0,00)
CDS	Barclays	Swedbank AB	Compra	EUR	2.330.000	20/06/2027	(44.141)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	16.200.000	20/12/2027	(629.938)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Venta	USD	49.850.000	20/12/2027	576.905	0,07
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Compra	USD	20.000.000	20/12/2027	(231.456)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	4.000.000	20/12/2027	155.540	0,02
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered plc	Compra	EUR	4.740.000	20/12/2027	(38.288)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Compra	EUR	3.000.000	20/12/2027	(66.281)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Telia Co AB	Compra	EUR	4.000.000	20/12/2027	(106.106)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	580.000	20/12/2023	(13.076)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	200.000	20/12/2023	(4.509)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Venta	USD	22.000.000	20/12/2027	254.602	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	8.000.000	20/12/2027	80.854	0,01
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Venta	USD	11.000.000	20/12/2027	127.301	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	4.000.000	20/12/2027	40.427	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	9.500.000	20/12/2027	96.014	0,01
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Venta	USD	10.700.000	20/12/2027	123.829	0,01
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Compra	USD	5.550.000	20/12/2027	(64.229)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Compra	USD	18.000.000	20/12/2027	(208.311)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	38.000.000	20/12/2027	384.057	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	9.420.000	20/12/2027	95.206	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	31.080.000	20/12/2027	314.118	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	2.000.000	20/12/2027	(20.214)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	20.000.000	20/12/2027	(202.135)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	10.400.000	20/12/2027	(105.110)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	21.710.000	20/12/2027	(219.418)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	45.890.000	20/12/2027	(463.798)	(0,06)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Compra	USD	8.000.000	20/12/2027	(92.582)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Compra	USD	20.000.000	20/12/2027	(231.456)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Compra	USD	22.000.000	20/12/2027	(254.602)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	15.700.000	20/06/2028	125.756	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 en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	10.810.000	20/06/2028	(305.221)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	12.200.000	20/12/2027	474.398	0,06
							(39.609) USD	(0,00)

A 31 de marzo de 2023, 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 en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	4.201.000	20/12/2027	(39.080)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	2.680.000	20/12/2027	(95.919)	(0,12)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	820.000	20/12/2027	(7.628)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	2.600.000	20/12/2027	(24.187)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	1.400.000	20/12/2027	13.024	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	3.900.000	20/12/2027	(36.280)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	5.500.000	20/12/2027	(51.164)	(0,06)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	1.700.000	20/12/2027	15.814	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	11.980.000	20/06/2028	(88.324)	(0,11)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	13.921.000	20/12/2027	129.501	0,16
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	2.370.000	20/06/2028	(61.593)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	2.680.000	20/12/2027	95.920	0,12
CDS	JPMorgan	Glencore International	Venta	EUR	400.000	20/06/2026	46.046	0,06
CDS	JPMorgan	Commerzbank	Venta	EUR	600.000	20/06/2027	6.269	0,01
CDS	Goldman Sachs	Airbus SE	Venta	EUR	600.000	20/06/2027	7.198	0,01
							(90.403) EUR	(0,11)

A 31 de marzo de 2023, 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 en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	325.000	20/12/2023	(6.744)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Venta	EUR	900.000	20/06/2025	10.454	0,01
CDS	JPMorgan	Glencore International	Venta	EUR	600.000	20/06/2026	69.069	0,05
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	1.700.000	20/06/2027	14.027	0,01
CDS	Barclays	Mercedes-Benz Group	Compra	EUR	537.500	20/06/2027	(8.908)	(0,01)
CDS	JPMorgan	SSE plc	Compra	EUR	1.870.000	20/06/2027	(37.092)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Compra	EUR	800.000	20/06/2027	(1.053)	(0,00)
CDS	Barclays	Swedbank AB	Compra	EUR	2.160.000	20/06/2027	(37.664)	(0,03)

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 en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	26.200.000	20/12/2027	(937.723)	(0,69)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	32.524.466	20/12/2027	302.561	0,22
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	1.120.000	20/12/2027	(10.419)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	1.095.534	20/12/2027	10.191	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	3.700.000	20/12/2027	113.575	0,08
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	6.300.000	20/12/2027	(58.606)	(0,04)
CDS	Goldman Sachs	Coöperatieve Rabobank U.A.	Compra	EUR	590.000	20/12/2027	5.003	0,00
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered plc	Compra	EUR	2.190.000	20/12/2027	(16.282)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	1.750.000	20/12/2027	62.634	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	1.000.000	20/12/2027	35.791	0,03
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Compra	EUR	1.750.000	20/12/2027	(35.587)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	Telia Co AB	Compra	EUR	1.700.000	20/12/2027	(41.507)	(0,03)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Compra	USD	800.000	20/06/2023	(7.136)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	600.000	20/12/2027	21.475	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	2.250.000	20/12/2027	80.530	0,06
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	1.000.000	20/12/2027	35.791	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	600.000	20/12/2027	21.475	0,02
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Venta	EUR	580.000	20/12/2027	(56.599)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	800.000	20/12/2027	28.633	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	550.000	20/12/2027	19.685	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	1.500.000	20/12/2027	53.686	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	1.800.000	20/12/2027	64.424	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	6.000.000	20/12/2027	(55.815)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	5.200.000	20/12/2027	(48.373)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	4.000.000	20/12/2027	(37.210)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	900.000	20/12/2027	32.212	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	4.200.000	20/12/2027	(39.071)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	11.920.000	20/06/2028	(309.782)	(0,23)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	13.450.000	20/12/2027	481.388	0,35
							(282.967) EUR	(0,22)

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

A 31 de marzo de 2023, 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 en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	2.080.000	20/12/2027	80.881	0,23
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Venta	USD	3.340.000	20/12/2027	38.653	0,11
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Venta	USD	3.340.000	20/06/2028	37.908	0,11
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Compra	USD	3.340.000	20/12/2027	(38.653)	(0,11)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	2.080.000	20/12/2027	(80.881)	(0,23)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	2.080.000	20/06/2028	58.729	0,16
							96.637 USD	0,27

A 31 de marzo de 2023, 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 en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	230.000	20/12/2027	(8.944)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	640.000	20/12/2027	6.468	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	640.000	20/12/2027	(6.468)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	555.467	20/06/2028	4.449	0,00
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Venta	USD	300.000	20/12/2027	3.472	0,00
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Venta	USD	500.000	20/12/2027	5.786	0,01
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered plc	Compra	EUR	130.000	20/12/2027	(1.050)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	200.000	20/12/2027	(2.021)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Compra	USD	500.000	20/12/2027	(5.786)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	400.000	20/12/2027	(4.043)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Compra	EUR	70.000	20/12/2027	(1.547)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Telia Co AB	Compra	EUR	90.000	20/12/2027	(2.387)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	100.000	20/12/2023	(3.656)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Venta	EUR	40.000	20/12/2026	5.615	0,01
CDS	JPMorgan	SSE plc	Compra	EUR	70.000	20/06/2027	(1.508)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	250.000	20/12/2027	(2.527)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	200.000	20/12/2027	2.021	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	300.000	20/12/2027	3.032	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	300.000	20/12/2027	(3.032)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	650.000	20/12/2027	6.569	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	150.000	20/12/2027	1.516	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	280.000	20/12/2027	2.830	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	340.000	20/12/2027	(3.436)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Compra	USD	300.000	20/12/2027	(3.472)	(0,00)

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 en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	90.000	20/12/2027	(910)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	200.000	20/06/2028	(5.645)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	230.000	20/12/2027	8.944	0,01
							(5.730) USD	(0,01)

A 31 de marzo de 2023, 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 8 acciones y recibe SOFR.	USD	1.168.600	20/04/2023	(41.776)	(0,21)
SRT	UBS	North America Equity Basket	Paga SOFR y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 6 acciones. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 37 acciones y recibe SOFR.	USD	6.499.476	26/06/2023	(221.525)	(1,13)
							(263.301) USD	(1,34)

A 31 de marzo de 2023, 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 en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
CDS	Goldman Sachs	Arcelormittal	Compra	EUR	7.500.000	20/12/2023	(230.831)	(0,05)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Venta	EUR	3.950.000	20/06/2025	45.883	0,01
CDS	JPMorgan	Societe Generale SA	Compra	EUR	19.000.000	20/12/2026	15.073	0,00
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Venta	EUR	4.000.000	20/12/2026	516.847	0,12
CDS	BNP Paribas	Monitchem Holdco 3 S.A.	Compra	EUR	10.000.000	20/06/2027	(670.461)	(0,16)
CDS	BNP Paribas	British Telecommunications plc	Compra	EUR	15.000.000	20/06/2027	(40.054)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	8.600.000	20/06/2027	70.962	0,02
CDS	Citigroup Global Markets	BNP Paribas SA	Compra	EUR	6.500.000	20/12/2027	115.867	0,03
CDS	Barclays	Mercedes-Benz Group	Compra	EUR	19.355.000	20/06/2027	(320.764)	(0,07)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	122.080.000	20/12/2027	(4.369.356)	(1,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	17.840.000	20/12/2027	(59.007)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Compra	USD	126.220.000	20/12/2027	(1.344.489)	(0,31)
CDS	Goldman Sachs	Bayerische Motoren Werke AG	Compra	EUR	10.860.000	20/12/2027	(178.676)	(0,04)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Compra	EUR	10.400.000	20/12/2027	(46.243)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	15.920.000	20/12/2027	488.679	0,11
CDS	Citigroup Global Markets	HSBC Holdings	Compra	EUR	11.800.000	20/12/2027	123.803	0,03

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 en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
CDS	Goldman Sachs	ING Groep NV	Compra	EUR	6.170.000	20/12/2027	93.990	0,02
CDS	Goldman Sachs	Coöperatieve Rabobank U.A.	Compra	EUR	15.370.000	20/12/2027	130.342	0,03
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered plc	Compra	EUR	13.390.000	20/12/2027	(99.552)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	4.430.000	20/12/2027	(53.723)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	13.400.000	20/12/2027	(479.598)	(0,11)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	7.260.000	20/12/2027	(222.853)	(0,05)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Compra	EUR	10.000.000	20/12/2027	(203.355)	(0,05)
CDS	Goldman Sachs	Telia Co AB	Compra	EUR	10.000.000	20/12/2027	(244.158)	(0,06)
CDS	JPMorgan	Commerzbank	Venta	EUR	8.400.000	20/06/2027	87.769	0,02
CDS	Goldman Sachs	Faurecia Se	Venta	EUR	3.200.000	20/06/2027	202.512	0,05
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Compra	EUR	9.700.000	20/06/2027	(12.763)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	164.000.000	21/06/2023	287.091	0,07
CDS	Barclays	Swedbank AB	Compra	EUR	18.560.000	20/06/2027	(323.631)	(0,08)
CDS	Citigroup Global Markets	Westpac banking Corp.	Compra	USD	17.000.000	20/06/2027	(225.512)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Compra	USD	19.000.000	20/12/2027	(202.387)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Venta	USD	25.000.000	20/12/2027	266.299	0,06
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Venta	USD	10.000.000	20/12/2027	106.520	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	1.000.000	20/12/2027	35.791	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	14.110.000	20/12/2027	131.259	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	119.160.000	20/06/2028	(3.096.778)	(0,72)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	134.480.000	20/12/2027	4.813.164	1,12
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	14.470.000	20/06/2028	(7.734)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	17.840.000	20/12/2027	59.007	0,01
CDS	BNP Paribas	Unicredit SPA	Compra	EUR	2.400.000	20/12/2027	3.109	0,00
							(4.837.958) EUR	(1,11)

A 31 de marzo de 2023, 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 en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Compra	EUR	60.000	20/06/2023	(104)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Pearson PLC	Compra	EUR	40.000	20/06/2023	(73)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banca Popolare Di Milano	Compra	EUR	30.000	20/06/2023	(159)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues	Compra	EUR	30.000	20/06/2023	(170)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Compra	EUR	80.000	20/06/2023	(139)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Venta	EUR	350.000	20/06/2025	4.066	0,02
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Compra	EUR	60.000	20/06/2023	(104)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Societe Generale SA	Compra	EUR	1.000.000	20/12/2026	793	0,00
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Venta	EUR	190.000	20/12/2026	24.550	0,14
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	1.000.000	20/06/2027	8.251	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 en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
CDS	Barclays	Mercedes-Benz Group	Compra	EUR	797.500	20/06/2027	(13.217)	(0,07)
CDS	JPMorgan	Commerzbank	Venta	EUR	500.000	20/06/2027	5.224	0,03
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues	Compra	EUR	30.000	20/06/2023	(170)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Compra	EUR	580.000	20/06/2027	(763)	(0,00)
CDS	Barclays	Swedbank AB	Compra	EUR	850.000	20/06/2027	(14.821)	(0,08)
CDS	Citigroup Global Markets	Westpac banking Corp.	Compra	USD	1.420.000	20/06/2027	(18.837)	(0,11)
CDS	Citigroup Global Markets	BNP Paribas SA	Compra	EUR	600.000	20/12/2027	10.695	0,06
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	2.640.000	20/12/2027	(94.488)	(0,53)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	1.010.000	20/12/2027	(3.341)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Compra	USD	9.650.000	20/12/2027	(102.791)	(0,57)
CDS	JPMorgan	United Utilities Group	Compra	EUR	80.000	20/12/2023	(514)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Bayerische Motoren Werke AG	Compra	EUR	480.000	20/12/2027	(7.897)	(0,04)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Compra	EUR	150.000	20/12/2027	(667)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	3.220.000	20/12/2027	98.841	0,55
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	USD	1.150.000	20/12/2027	12.250	0,07
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	280.000	20/12/2027	926	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	240.000	20/12/2027	8.590	0,05
CDS	Citigroup Global Markets	HSBC Holdings	Compra	EUR	720.000	20/12/2027	7.554	0,04
CDS	Goldman Sachs	ING Groep NV	Compra	EUR	560.000	20/12/2027	8.531	0,05
CDS	Goldman Sachs	Coöperatieve Rabobank U.A.	Compra	EUR	910.000	20/12/2027	7.717	0,04
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered plc	Compra	EUR	1.050.000	20/12/2027	(7.807)	(0,04)
CDS	Goldman Sachs	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	200.000	20/12/2027	(2.425)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	440.000	20/12/2027	(13.506)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	300.000	20/12/2027	(9.209)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	250.000	20/12/2027	(7.674)	(0,04)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Compra	EUR	480.000	20/12/2027	(9.761)	(0,05)
CDS	Goldman Sachs	Telia Co AB	Compra	EUR	500.000	20/12/2027	(12.208)	(0,07)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	13.000.000	21/06/2023	22.757	0,13
CDS	Barclays	Natural Energy Group SA	Compra	EUR	500.000	20/12/2027	(5.855)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	30.000	20/06/2023	(159)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	145.000	20/12/2023	(3.009)	(0,02)
CDS	Barclays	Tesco plc	Compra	EUR	100.000	20/12/2023	(558)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Compra	EUR	260.000	20/12/2023	(1.450)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	250.000	20/12/2023	(5.188)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Venta	USD	500.000	20/12/2027	5.326	0,03
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Venta	USD	800.000	20/12/2027	8.522	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Compra	EUR	1.550.000	20/12/2027	(14.419)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	270.000	20/12/2027	9.664	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 en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	80.000	20/12/2027	2.863	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	450.000	20/12/2027	4.186	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	100.000	20/12/2027	930	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	280.000	20/12/2027	2.605	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	1.000.000	20/12/2027	9.303	0,05
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Venta	USD	800.000	20/12/2027	8.522	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	150.000	20/12/2027	5.369	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSUB 38	Venta	EUR	500.000	20/12/2027	(15.348)	(0,09)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 38	Venta	EUR	130.000	20/12/2027	430	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	230.000	20/12/2027	8.232	0,05
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Venta	USD	900.000	20/12/2027	9.587	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSUB 38	Venta	EUR	130.000	20/12/2027	(3.991)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	1.670.000	20/12/2027	59.771	0,33
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	1.480.000	20/06/2028	(38.463)	(0,22)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	490.000	20/06/2028	(262)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Venta	EUR	600.000	20/12/2027	1.985	0,01
							(51.507) EUR	(0,26)

A 31 de marzo de 2023, 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 EURIBOR.	EUR	982.939	del 05/05/2027 al 24/10/2029	(16.183)	(0,02)
SRT	Goldman Sachs	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la acción subyacente y recibe 1M SONIA.	GBP	169.225	18/05/2029	(5.139)	(0,01)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 9 acciones y recibe CHF SARON 1M.	CHF	5.570.292	07/02/2024	(215.043)	(0,28)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 10 acciones y recibe 1M CIBOR.	DKK	73.558.815	07/02/2024	(266.150)	(0,34)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 34 acciones y recibe 1M EURIBOR.	EUR	23.560.734	07/02/2024	(787.916)	(1,01)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 3 acciones y recibe 1M NIBOR.	NOK	33.025.063	07/02/2024	44.968	0,06

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 1M SONIA.	GBP	2.046.162	06/12/2024	(93.878)	(0,12)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 12 acciones y recibe 1M STIBOR.	SEK	96.313.710	07/02/2024	(409.070)	(0,52)
							(1.748.411) EUR	(2,24)

A 31 de marzo de 2023, 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 SOFR y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 8 acciones y recibe SOFR.	USD	5.694.728	20/04/2023	(20.733)	(0,02)
SRT	UBS	North America Equity Basket	Paga SOFR y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 6 acciones. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 36 acciones y recibe SOFR.	USD	23.966.928	26/06/2023	(549.776)	(0,62)
							(570.509) USD	(0,64)

A 31 de marzo de 2023, 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 SWAP OIS 1M.	AUD	1.461.675	10/01/2025	(756)	(0,00)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga 1M CDOR y recibe el rendimiento de la acción subyacente.	CAD	990.444	03/06/2024	(71.338)	(0,09)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga CHF SARON 1M y recibe el rendimiento de la acción subyacente.	CHF	1.395.765	04/11/2024	93.999	0,12
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga 1M CIBOR y recibe el rendimiento de la acción subyacente.	DKK	5.864.700	10/01/2025	(227.335)	(0,28)

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 1M EURIBOR y recibe el rendimiento de la acción subyacente. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 4 acciones y recibe 1M EURIBOR.	EUR	2.357.649	10/01/2025	(9.707)	(0,01)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones y recibe 1M SONIA.	GBP	1.016.948	10/01/2025	98.828	0,12
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga SOFR y recibe el rendimiento de la acción subyacente.	IDR	9.688.254.000	29/01/2026	(8.093)	(0,01)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga 1M-TIBOR y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones. Paga el rendimiento de la acción subyacente y recibe 1M-TIBOR.	JPY	346.912.800	03/06/2024	35.133	0,04
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga 1M STIBOR y recibe el rendimiento de la acción subyacente. Paga el rendimiento de la acción subyacente y recibe 1M STIBOR.	SEK	17.192.546	10/01/2025	(71.957)	(0,09)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga SOFR y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 18 acciones. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 15 acciones y recibe SOFR.	USD	33.396.322	10/01/2025	1.015.006	1,25
							853.780 USD	1,05

A 31 de marzo de 2023, 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	Goldman Sachs	North America Commodities Basket	Paga el 0,11% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 2 índices.	USD	86.609.236	14/04/2023	1.086.000	0,54
SRT	JPMorgan	North America Commodities Basket	Paga del 0% al 0,58% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 33 índices. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 17 índices y recibe el 0%.	USD	612.097.514	03/04/2023 al 14/04/2023	523.994	0,26
SRT	Macquarie	North America Commodities Basket	Paga el 0,17% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 2 índices.	USD	47.581.150	14/04/2023	532.045	0,27
							2.142.039 USD	1,07

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

A 31 de marzo de 2023, la contraparte de los contratos de futuros pendientes es UBS.

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-Bobl Future	Ventas	(88)	EUR	(9.473.469)	08/06/2023	(237.215)	(0,03)
Euro-OAT Future	Ventas	(58)	EUR	(5.866.675)	08/06/2023	(294.276)	(0,04)
Euro-Bund Future	Ventas	(111)	EUR	(11.439.851)	08/06/2023	(365.961)	(0,04)
Japan 10Y Bond	Ventas	(13)	JPY	(9.669.461)	13/06/2023	(290.104)	(0,03)
Australian 10Y Treasury Bond Future	Compras	15	AUD	1.234.548	15/06/2023	37.600	0,00
Canada 10Y Bond Future	Compras	95	CAD	6.315.831	21/06/2023	358.415	0,04
Ultra 10Y US Treasury Note	Ventas	(178)	USD	(18.656.625)	21/06/2023	(182.134)	(0,02)
US Treasury Note	Compras	4	USD	443.250	21/06/2023	20.375	0,00
Ultra US Treasury Bond Future	Ventas	(10)	USD	(930.156)	21/06/2023	(10.000)	(0,00)
Long Gilt Future	Ventas	(176)	GBP	(23.088.538)	28/06/2023	(212.777)	(0,03)
5Y US Treasury Note	Compras	293	USD	29.782.992	30/06/2023	430.718	0,06
2Y US Treasury Note	Compras	16	USD	3.186.125	30/06/2023	36.250	0,00
						(709.109) USD	(0,09)

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-Bund Future	Ventas	(1)	EUR	(94.861)	08/06/2023	(4.340)	(0,01)
Euro-Buxl Future	Ventas	(4)	EUR	(316.472)	08/06/2023	(38.080)	(0,05)
Euro-Bobl Future	Compras	31	EUR	3.071.697	08/06/2023	79.290	0,11
Ultra 10Y US Treasury Note	Ventas	(16)	USD	(1.543.559)	21/06/2023	(57.642)	(0,07)
US Treasury Note	Ventas	(3)	USD	(305.985)	21/06/2023	(14.124)	(0,02)
10Y US Treasury Note	Ventas	(12)	USD	(1.121.773)	21/06/2023	(34.516)	(0,04)
Long Gilt Future	Ventas	(10)	GBP	(1.207.463)	28/06/2023	(23.698)	(0,03)
5Y US Treasury Note	Ventas	(6)	USD	(561.361)	30/06/2023	(12.164)	(0,02)
						(105.274) EUR	(0,13)

A 31 de marzo de 2023, 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
10Y US Treasury Note	Ventas	(26)	USD	(2.430.508)	21/06/2023	(80.768)	(0,02)
						(80.768) EUR	(0,02)

A 31 de marzo de 2023, 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
Long-Term Euro-BTP Future	Ventas	(4)	EUR	(410.020)	08/06/2023	(18.400)	(0,01)

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-Bund Future	Ventas	(6)	EUR	(569.166)	08/06/2023	(30.900)	(0,01)
Short-Term Euro-BTP Future	Ventas	(1)	EUR	(96.961)	08/06/2023	(1.270)	(0,00)
Euro-Bobl Future	Ventas	(153)	EUR	(15.160.311)	08/06/2023	(317.520)	(0,08)
10Y US Treasury Note	Ventas	(35)	USD	(3.271.837)	21/06/2023	(100.672)	(0,03)
Long Gilt Future	Ventas	(74)	GBP	(8.935.229)	28/06/2023	(197.222)	(0,06)
5Y US Treasury Note	Ventas	(14)	USD	(1.309.842)	30/06/2023	(28.382)	(0,01)
2Y US Treasury Note	Ventas	(3)	USD	(549.863)	30/06/2023	(6.256)	(0,00)
						(700.622) EUR	(0,20)

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-Buxl Future	Ventas	(29)	EUR	(2.294.422)	08/06/2023	(279.560)	(0,21)
Euro-Bund Future	Compras	82	EUR	7.778.602	08/06/2023	351.772	0,26
Euro-Schatz Future	Ventas	(4)	EUR	(398.184)	08/06/2023	(4.200)	(0,00)
Euro-Bobl Future	Ventas	(273)	EUR	(27.050.751)	08/06/2023	(552.660)	(0,41)
Japan 10Y Bond	Ventas	(14)	JPY	(9.584.671)	13/06/2023	(286.592)	(0,21)
10Y US Treasury Note	Compras	19	USD	1.776.140	21/06/2023	7.924	0,01
US Treasury Note	Ventas	(15)	USD	(1.529.925)	21/06/2023	(72.052)	(0,05)
Ultra US Treasury Bond Future	Ventas	(37)	USD	(3.167.728)	21/06/2023	(171.344)	(0,13)
Ultra 10Y US Treasury Note	Compras	27	USD	2.604.756	21/06/2023	95.437	0,07
Long Gilt Future	Ventas	(15)	GBP	(1.811.195)	28/06/2023	17.061	0,01
5Y US Treasury Note	Ventas	(46)	USD	(4.303.767)	30/06/2023	(136.612)	(0,10)
						(1.030.826) EUR	(0,76)

A 31 de marzo de 2023, 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
10Y US Treasury Note	Ventas	(41)	USD	(4.164.063)	21/06/2023	(131.328)	(0,22)
5Y US Treasury Note	Compras	79	USD	8.030.227	30/06/2023	175.281	0,29
						43.953 USD	0,07

A 31 de marzo de 2023, 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 Future	Compras	11	JPY	1.655.909	08/06/2023	23.803	0,07
E-Mini RUSs 1000 V	Compras	5	USD	378.050	16/06/2023	11.410	0,03
FTSE 100 Index Future	Compras	24	GBP	2.266.858	16/06/2023	25.294	0,07
MSCI Emerging Markets Index	Compras	9	USD	447.975	16/06/2023	16.900	0,05

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
E-mini S&P 500 Future	Ventas	(25)	USD	(5.172.188)	16/06/2023	(306.873)	(0,86)
Euro Stoxx 50 PR	Ventas	(37)	EUR	(1.712.864)	16/06/2023	(85.221)	(0,24)
						(314.687) USD	(0,88)

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-OAT Future	Ventas	(1)	EUR	(101.150)	08/06/2023	(5.074)	(0,00)
Euro-Bobl Future	Ventas	(8)	EUR	(861.224)	08/06/2023	(16.612)	(0,02)
Euro-Bund Future	Ventas	(2)	EUR	(206.123)	08/06/2023	(11.190)	(0,01)
FTSE 100 Index Future	Compras	8	GBP	755.619	16/06/2023	10.769	0,01
Euro Stoxx 50 PR	Compras	32	EUR	1.481.396	16/06/2023	36.309	0,02
E-mini S&P 500 Future	Compras	51	USD	10.551.263	16/06/2023	323.459	0,29
Canada 10Y Bond Future	Compras	2	CAD	132.965	21/06/2023	7.546	0,01
10Y US Treasury Note	Compras	2	USD	203.125	21/06/2023	6.234	0,01
US Treasury Note	Ventas	(1)	USD	(110.813)	21/06/2023	(5.219)	(0,00)
Ultra 10Y US Treasury Note	Compras	1	USD	104.813	21/06/2023	297	0,00
Long Gilt Future	Ventas	(3)	GBP	(393.555)	28/06/2023	(2.389)	(0,00)
5Y US Treasury Note	Compras	8	USD	813.188	30/06/2023	17.750	0,02
2Y US Treasury Note	Compras	2	USD	398.266	30/06/2023	4.531	0,00
						366.411 USD	0,33

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha tenía pendiente el siguiente contrato de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
E-mini S&P 500 Future	Ventas	(50)	USD	(10.344.375)	16/06/2023	(613.670)	(3,12)
						(613.670) USD	(3,12)

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-OAT Future	Ventas	(187)	EUR	(17.409.887)	08/06/2023	(873.290)	(0,20)
Euro-Buxl Future	Ventas	(37)	EUR	(2.927.366)	08/06/2023	(352.240)	(0,08)
Euro-Bund Future	Ventas	(170)	EUR	(16.126.370)	08/06/2023	(873.400)	(0,20)
Euro-Bobl Future	Ventas	(833)	EUR	(82.539.471)	08/06/2023	(2.290.749)	(0,54)
Japan 10Y Bond	Ventas	(31)	JPY	(21.223.200)	13/06/2023	(636.741)	(0,15)
10Y US Treasury Note	Ventas	(41)	USD	(3.832.724)	21/06/2023	(117.930)	(0,03)
US Treasury Note	Ventas	(13)	USD	(1.325.935)	21/06/2023	(61.206)	(0,01)
Ultra US Treasury Bond Future	Ventas	(15)	USD	(1.284.214)	21/06/2023	3.794	0,00

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
Ultra 10Y US Treasury Note	Ventas	(37)	USD	(3.569.481)	21/06/2023	(133.296)	(0,03)
Long Gilt Future	Ventas	(260)	GBP	(31.394.049)	28/06/2023	(669.492)	(0,16)
5Y US Treasury Note	Compras	205	USD	19.179.833	30/06/2023	418.651	0,10
						(5.585.899) EUR	(1,30)

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-Buxl Future	Ventas	(2)	EUR	(158.236)	08/06/2023	(19.040)	(0,11)
Euro-Bund Future	Ventas	(14)	EUR	(1.328.054)	08/06/2023	(71.890)	(0,39)
Euro-OAT Future	Ventas	(10)	EUR	(931.010)	08/06/2023	(46.700)	(0,26)
Euro-Schatz Future	Ventas	(2)	EUR	(199.092)	08/06/2023	(2.060)	(0,01)
Euro-Bobl Future	Ventas	(24)	EUR	(2.378.088)	08/06/2023	(65.770)	(0,37)
Japan 10Y Bond	Ventas	(2)	JPY	(1.369.239)	13/06/2023	(41.080)	(0,23)
10Y US Treasury Note	Compras	2	USD	186.962	21/06/2023	5.738	0,03
Ultra US Treasury Bond Future	Ventas	(1)	USD	(85.614)	21/06/2023	1.409	0,01
Ultra 10Y US Treasury Note	Ventas	(8)	USD	(771.780)	21/06/2023	(28.821)	(0,16)
Long Gilt Future	Ventas	(11)	GBP	(1.328.210)	28/06/2023	(22.798)	(0,13)
5Y US Treasury Note	Compras	3	USD	280.680	30/06/2023	6.127	0,03
						(284.885) EUR	(1,59)

12 OPCIONES AL VALOR DE MERCADO

A 31 de marzo de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income tenía pendientes las siguientes opciones:

Descripción	Contraparte	Precio de ejercicio	Divisa	Contratos	Fecha de vencimiento	Compromiso en la divisa base de la cartera	Valor de mercado en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Opciones sobre futuros								
Call S&P 500 Index	UBS	4.100.000	USD	(50)	14/04/2023	20.500.000*	(295.500)	(0,27)
Call DJ Euro Stoxx 50	UBS	4.250.000	EUR	(52)	21/04/2023	2.401.055*	(62.371)	(0,06)
Call FTSE 100 Index	UBS	7.625.000	GBP	(16)	21/04/2023	1.508.469*	(19.190)	(0,02)
							(377.061) USD	(0,35)

* El compromiso en posiciones cortas de compra es ilimitado.

13 AGRUPACIÓN

La SICAV podrá invertir y administrar la totalidad o parte de los activos establecidos para dos o más Carteras («Carteras Participantes») de forma conjunta. Cualquier grupo de activos de este tipo se formará mediante la transferencia de efectivo u otros activos (sujeto a que dichos activos sean apropiados con respecto a la política de inversión del conjunto en cuestión) de cada una de las Carteras Participantes.

La participación de una Cartera Participante en un conjunto de activos se medirá por referencia a participaciones nacionales de igual valor en el conjunto de activos.

A 31 de marzo de 2023, la SICAV no tenía agrupación de activos. Sin embargo, la Cartera Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return, para fines de gestión de inversiones, se divide por clases de activos en diversas cestas que solo ella posee.

Notas a los estados financieros

(continuación)

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. 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 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 enero de 2023.

A 31 de marzo de 2023, se ha aplicado el siguiente Ajuste de dilución:

Cartera	VL antes de la dilución	Ajuste de dilución	VL después de la dilución
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	19.637.404	(7.855)	19.629.549
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	431.287.517	(2.673.983)	428.613.534

16 COSTES OPERATIVOS

Para el ejercicio del informe, la SICAV incurrió en costes operativos relacionados con la compra o venta de valores mobiliarios o instrumentos del mercado monetario de la siguiente manera:

Carteras	Divisa	Costes operativos
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	EUR	3.807
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	USD	20.544
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	USD	60.526
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	USD	7.762
Threadneedle (Lux) - Global Focus	USD	2.545.294
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	USD	694.259
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	USD	92.787
Threadneedle (Lux) - Global Select	USD	442.969
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	EUR	1.170.113
Threadneedle (Lux) - American	USD	274.225

Notas a los estados financieros

(continuación)

16 COSTES OPERATIVOS

(continuación)

Carteras	Divisa	Costes operativos
Threadneedle (Lux) - American Select	USD	94.992
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	USD	251.532
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	USD	160.090
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	USD	279.173
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	USD	92.563
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	USD	21.104
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	EUR	1.063.670
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	EUR	140.826
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	EUR	190.056
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	EUR	408.921
Threadneedle (Lux) - European Select	EUR	803.151
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	EUR	440.474
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	USD	82.870
Threadneedle (Lux) - Global Technology	USD	125.990
Threadneedle (Lux) - UK Equities	GBP	504.823
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	GBP	308.630
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity ²	USD	n/d
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	USD	23.713
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	322.208
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	USD	43.830
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	USD	76.183
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	USD	2.726

Los costes operativos se incluyen en el coste total de inversión indicado en los Estados de la Cartera. El importe de los costes operativos soportados por la SICAV durante el ejercicio del informe se incluye en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto bajo el epígrafe «Ganancia/(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones» y «Cambio en la ganancia/(pérdida) neta no realizada en inversiones».

¹ Para los valores de renta fija, los costes operativos no son identificables por separado del precio de compra del valor y, por lo tanto, no se podrán indicar por separado.

² Consulte la Nota 1.

17 INFORMACIÓN SOBRE GARANTÍAS

La siguiente tabla muestra los saldos de garantía en efectivo recibidos y pagados por las Carteras a 31 de marzo de 2023:

Carteras	Contraparte	Tipo de inversión	Divisa	Garantía en efectivo
Garantía recibida por la cartera				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Goldman Sachs	Contratos a plazo y swaps	USD	10.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPMorgan	Contratos a plazo y swaps	USD	12.930.000
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	EUR	70.000
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	NatWest Markets	Contratos a plazo	EUR	60.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	JPMorgan	Contratos a plazo	EUR	210.000
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	HSBC	Contratos a plazo	EUR	340.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Citigroup Global Markets	Contratos a plazo y swaps	EUR	10.000
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	430.000
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	410.000
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	550.000
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	270.000
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	160.000
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	Lloyds	Contratos a plazo	USD	20.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPMorgan	Contratos a plazo y swaps	USD	900.000

Notas a los estados financieros

(continuación)

17 INFORMACIÓN SOBRE GARANTÍAS

(continuación)

Carteras	Contraparte	Tipo de inversión	Divisa	Garantía en efectivo
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	USD	230.000
Threadneedle (Lux) - Global Focus	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	2.600.000
Threadneedle (Lux) - American	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	2.800.000
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	960.000
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	1.050.000
Threadneedle (Lux) - Global Technology	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	610.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	210.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Citigroup Global Markets	Contratos a plazo y swaps	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Goldman Sachs	Contratos a plazo y swaps	EUR	410.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	EUR	1.230.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Goldman Sachs	Swaps	EUR	120.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	UBS	Swaps	EUR	530.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Bank of America Merrill Lynch	Swaps	USD	50.000
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	UBS	Swaps	USD	830.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Goldman Sachs	Swaps	USD	1.920.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	JPMorgan	Contratos a plazo y swaps	USD	2.750.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Macquarie	Swaps	USD	1.070.000
Garantía pagada por la cartera				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	USD	7.640.000
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	JPM Securities	Contratos a plazo	EUR	260.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	JPM Securities	Contratos a plazo	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	JPMorgan	Contratos a plazo	EUR	330.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Goldman Sachs	Swaps	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	HSBC	Contratos a plazo	EUR	250.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Lloyds	Contratos a plazo	USD	840.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	JPMorgan	Contratos a plazo	EUR	540.000
Threadneedle (Lux) - European Select	JPMorgan	Contratos a plazo	EUR	370.000
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	JPMorgan	Contratos a plazo	EUR	150.000
Threadneedle (Lux) - UK Equities	JPMorgan	Contratos a plazo	GBP	20.000
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	JPMorgan	Contratos a plazo	GBP	110.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	UBS	Swaps	USD	170.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Barclays	Contratos a plazo y swaps	EUR	670.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	BNP Paribas	Swaps	EUR	660.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	EUR	20.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	UBS	Swaps	USD	450.000

18 INVERSIÓN CRUZADA EN CARTERAS

A 31 de marzo de 2023, la Cartera Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return invierte en acciones de las siguientes Carteras:

Cartera de inversión cruzada	Divisa	Valor de mercado	% del patrimonio neto en la divisa base de la cartera de inversión cruzada
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio	EUR	25.696	0,01
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	EUR	32.524	0,04
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	EUR	2.395	0,00
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	EUR	38.923	0,06
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	EUR	4.730	0,01
Threadneedle (Lux) - Global Focus	EUR	55.027	0,00
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	EUR	32.503	0,18
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	EUR	8.712	0,00

Notas a los estados financieros

(continuación)

18 INVERSIÓN CRUZADA EN CARTERAS

(continuación)

A 31 de marzo de 2023, la Cartera Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return invierte en acciones de las siguientes Carteras:

Cartera de inversión cruzada	Divisa	Valor de mercado	% del patrimonio neto en la divisa base de la cartera de inversión cruzada
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio	USD	1.885.062	0,95

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 31 de marzo de 2023:

Carteras	Contraparte	Divisa	Depósitos a plazo (en la divisa base de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	Sumitomo Bank Ltd London	USD	1.817.561
	Mitsubishi UFJ Securities	USD	1.829.249
	Total	USD	3.646.810
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	Rabobank Nederland	USD	642.605
	Mitsubishi UFJ Securities	USD	768.696
	Total	USD	1.411.301
Threadneedle (Lux) - American Select	Mitsubishi UFJ Securities	USD	5.001.325
	Total	USD	5.001.325
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Mitsubishi UFJ Securities	USD	2.337.322
	ANZ Banking Group Ltd	USD	2.577.998
	Total	USD	4.915.320

20 OTROS ACTIVOS

Otros activos podrían incluir cualquier ajuste del valor razonable aplicado cuando ciertos mercados se cerraron al cierre del ejercicio para evitar la sincronización del mercado, sobre la base del procedimiento de fijación de precios en el fondo en vigor.

Otros activos también podrían incluir cualquier impuesto de retención y/o impuestos extranjeros.

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

El Índice de Gastos Totales se calcula siguiendo la guía de la Asset Management Association Switzerland (AMAS).

La fórmula aplicada es la siguiente:

El IGT expresa la suma de todos los costes y comisiones cobrados de forma continua a cada Clase de Acciones (Gastos operativos) tomadas retrospectivamente como un porcentaje de su patrimonio neto, y se calcula utilizando la siguiente fórmula:

$$\% \text{ de IGT} = \frac{\text{Total de gastos operativos}}{\text{Patrimonio neto medio}} \times 100$$

Cuando un fondo invierte más del 10% en otras instituciones de inversión colectiva (fondos objetivo), el cálculo incluye la parte del fondo en los gastos de los fondos objetivo menos los reembolsos recibidos.

Los Índices de Gastos Totales durante el ejercicio cerrado a 31 de marzo de 2023 son los siguientes:

Cartera	Clase	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	AEC	0,80%	
	AEH	0,80%	
	AKH	0,71%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ANH	0,73%	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, así como al tamaño pequeño de la clase.
	AU	0,80%	
	AUP	0,80%	
	DEC	1,55%	
	DEH	1,55%	
	DU	1,55%	
	DUP	1,55%	
	IEC	0,50%	
	IEH	0,55%	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.
	IEP	0,50%	
	IGC	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 y a la significativa variación del VL medio.
	IGH	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.
	IKH	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.
	INH	0,50%	
	IU	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 y a la significativa variación del VL medio.
	IUP	0,57%	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.
	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	0,55%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond (continuación)	ZGH	0,55%	
	ZU	0,55%	
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	AE	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.
	ANH	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.
	IE	0,55%	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 y a la significativa variación del VL medio.
	IEP	0,50%	
	INH	0,50%	
	XE	0,10%	
	XFH	0,10%	
	XGH	0,10%	
	XUH	0,10%	
	ZE	0,55%	
	ZFH	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, así como al tamaño pequeño de la clase.
	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	0,60%	
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	AE	1,50%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AKH	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, así como al tamaño pequeño de la clase.
	ANH	1,45%	
	IE	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 y a la significativa variación del VL medio.
	IEP	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.
	IKH	0,65%	
	INH	0,65%	
	XE	0,10%	
	ZE	0,80%	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	0,85%	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 y a la significativa variación del VL medio.
	1E	1,38%	
	1EP	1,38%	
	1G	1,38%	
	1GP	1,38%	
	1UT	1,38%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond (continuación)	2E	0,82%	
	2EP	0,82%	
	2FH	0,82%	
	2G	0,82%	
	2GP	0,74%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	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	0,59%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9FH	0,70%	
	9G	0,62%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9GP	0,62%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	AE	0,90%	
	AEP	0,90%	
	AKH	0,90%	
	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	0,55%	
	AKH	0,55%	
	ANH	0,55%	
	ASC	0,60%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ASH	0,55%	
	AUC	0,55%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - European Social Bond (continuación)	AUH	0,50%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ID	0,40%	
	IE	0,40%	
	IEP	0,40%	
	IFH	0,40%	
	IGH	0,46%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IKH	0,51%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	INH	0,49%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ISC	0,27%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ISH	0,40%	
	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	1,10%	
	ANH	1,10%	
	AUH	1,10%	
	DE	1,65%	
	DEP	1,65%	
	DUH	1,65%	
	IE	0,50%	
	INH	0,50%	
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	ZE	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, así como al tamaño pequeño de la clase.
	AEC	1,55%	
	AEH	1,55%	
	AKH	1,61%	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, así como al tamaño pequeño de la clase.
	ANH	1,55%	
	ASH	1,55%	
	AU	1,60%	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.
	AUP	1,55%	
	DEC	1,65%	
	DEH	1,65%	
	DU	1,65%	
	IEC	0,75%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds (continuación)	IEH	0,75%	
	IU	0,75%	
	W	1,20%	
	WEH	1,20%	
	ZU	0,65%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	XUP	0,10%	
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	AEC	1,55%	
	AEH	1,55%	
	AKH	1,50%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ANH	1,55%	
	ASH	1,55%	
	AU	1,55%	
	AUP	1,55%	
	DEH	1,65%	
	DU	1,65%	
	IEH	0,75%	
	IU	0,67%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la reducción de las comisiones aplicadas a esta Clase de Acciones el 1 de agosto de 2022, así como al tamaño pequeño de la clase.
	SU	1,70%	
	SUP	1,75%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la reducción de las comisiones aplicadas a esta Clase de Acciones el 1 de agosto de 2022.
	W	1,20%	
	XUP	0,10%	
	ZU	0,68%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	AEC	1,50%	
	AEH	1,50%	
	AKH	1,50%	
	ANH	1,50%	
	ASC	1,50%	
	ASH	1,50%	
	AU	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.
	AUP	1,50%	
	DEH	1,65%	
	DU	1,65%	
	IE	0,75%	
	IEH	0,75%	
	XU	0,10%	
	XUP	0,10%	
	ZEH	0,80%	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	0,66%	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.
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	AEC	1,50%	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.
	AEH	1,45%	
	AKH	1,45%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond (continuación)	ANH	1,45%	
	ASH	1,51%	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	1,45%	
	AUP	1,45%	
	DEC	1,71%	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 y a la significativa variación del VL medio.
	DEH	1,70%	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 y a la significativa variación del VL medio.
	DU	1,65%	
	IEC	0,58%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IEH	0,65%	
	IKH	0,57%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	INH	0,57%	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	0,69%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZGH	0,70%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	0,75%	
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	AEH	1,10%	
	AKH	1,10%	
	AS	1,10%	
	ASC	1,10%	
	ASH	1,10%	
	AU	1,10%	
	AUP	1,10%	
	AVC	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, así como al tamaño pequeño de la clase.
	AVH	1,10%	
	DEH	1,40%	
	IEH	0,50%	
	IGH	0,50%	
	ISH	0,50%	
	IU	0,50%	
	XU	0,10%	
	ZU	0,55%	
	ZUP	0,55%	
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	AE	1,63%	El IGT actual incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	DE	2,38%	El IGT actual incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	AEC	1,65%	
	AEH	1,65%	
	AKH	1,80%	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	1,14%	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	1,72%	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	1,12%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZEC	1,22%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZEH	1,05%	
	ZFH	1,16%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	1,05%	
	ZUP	1,18%	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	1,79%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AEC	1,65%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AEH	1,75%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la reducción de las comisiones aplicadas a esta Clase de Acciones el 1 de agosto de 2022.
	AU	1,75%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AUP	1,64%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,75%	
	IEH	0,70%	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	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities (continuación)	IG	0,75%	
	IU	0,68%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	LE	0,45%	
	LG	0,40%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	XU	0,10%	
	ZE	0,90%	
	ZEC	0,97%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZEH	0,97%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	0,95%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	ZUP	0,98%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - Global Focus	AEH	1,70%	
	AEP	1,70%	
	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 y a la significativa variación del VL medio.
	AU	1,70%	
	AUP	1,70%	
	DEH	2,45%	
	DU	2,45%	
	IE	0,85%	
	IEH	0,85%	
	IU	0,85%	
	IUP	0,85%	
	W	1,72%	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 y a la significativa variación del VL medio.
	XU	0,10%	
	ZE	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.
	ZEH	0,90%	
	ZEP	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.
	ZFH	1,09%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la reducción de las comisiones aplicadas a esta Clase de Acciones el 1 de agosto de 2022 y a la significativa variación del VL medio.
	ZG	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.
	ZU	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 y a la significativa variación del VL medio.
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	AEH	1,70%	
	AU	1,70%	
	DEH	2,50%	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	2,50%	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	0,85%	
	IEH	0,85%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities (continuación)	IU	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 y a la significativa variación del VL medio.
	XU	0,10%	
	ZU	0,95%	
	1E	1,71%	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.
	1U	1,71%	
	2E	1,10%	
	2U	1,10%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	8E	1,23%	
	8U	1,14%	
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	AEC	1,80%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AUP	1,90%	
	DEC	2,39%	
	DUP	2,30%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IU	0,95%	
	TE	0,98%	
	ZU	1,12%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	1E	1,68%	
	1EP	1,68%	
	1SC	1,68%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	1SH	1,68%	
	1ST	1,68%	
	1U	1,68%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	1UP	1,68%	
	1VT	1,68%	
	2E	1,07%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	2EP	1,07%	
	2U	1,07%	
	2UP	1,02%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	3E	0,93%	
	3EP	0,93%	
	3U	0,93%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	3UP	0,93%	
	8E	1,11%	
	8EP	1,11%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	8U	1,11%	
	8UP	1,11%	
	9E	0,95%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9EP	0,89%	
	9U	0,84%	
	9UP	0,89%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IU	0,85%	
	ZU	0,95%	
Threadneedle (Lux) - Global Select	IU	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.
	ZU	0,95%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Select (continuación)	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	0,08%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	XGH	0,08%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	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	1,12%	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%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - American Select	AD	1,85%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AEH	1,80%	
	AN	1,85%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AU	1,80%	
	DEH	2,55%	
	DU	2,55%	
	ID	0,93%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,93%	
	IEH	1,00%	
	IN	0,93%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	W	1,75%	
	ZEH	1,17%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	1,10%	
	1E	1,67%	
	1EH	1,67%	
	1EP	1,67%	
	1U	1,67%	
	2EH	1,06%	
	2U	1,06%	
	3E	0,87%	
	3U	0,87%	
	8EH	1,10%	
	8U	1,10%	
	9E	0,83%	
	9U	0,83%	
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	AEH	1,80%	
	ASH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IE	0,95%	
	IU	0,95%	
	ZU	1,05%	
	1E	1,68%	
	1EP	1,68%	
	1U	1,68%	
	2U	1,07%	
	3EH	0,93%	
	3U	0,93%	
	8U	1,11%	
	9EH	0,84%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	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%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity (continuación)	ASH	1,80%	
	AU	1,91%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	DE	2,55%	
	IF	0,80%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ISH	0,78%	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	1,11%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZEH	1,05%	
	ZF	1,12%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZG	1,11%	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	1,94%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AEH	1,71%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	DE	2,44%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	DEH	2,22%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,95%	
	IU	0,95%	
	ZU	1,05%	
	1E	1,70%	
	1U	1,70%	
	2E	1,09%	
	2U	1,09%	
	3U	0,95%	
	8E	1,13%	
	8U	1,13%	
	9U	0,91%	
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	AEC	1,92%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	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	1,18%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZGH	1,22%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	1,10%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	AE	0,70%	
	AEH	0,57%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AU	0,57%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AUP	0,55%	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	0,40%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IFH	0,40%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IG	0,35%	
	IU	0,35%	
	NE	0,20%	
	NG	0,20%	
	NU	0,20%	
	XG	0,10%	
	ZEH	0,45%	
	ZFH	0,45%	
	ZU	0,45%	
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	AE	1,50%	
	ASH	1,50%	
	AUH	1,50%	
	DE	1,70%	
	IE	0,75%	
	W	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.
	XE	0,10%	
	ZE	0,90%	
	ZUH	0,90%	
	1E	1,53%	
	1EP	1,53%	
	1G	1,53%	
	1GP	1,53%	
	2E	1,08%	
	2G	1,08%	
	2U	1,00%	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	1,03%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9E	0,85%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities (continuación)	9G	0,85%	
	9GP	0,85%	
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	AE	1,80%	
	AEP	1,80%	
	AUP	1,92%	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	1,12%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	ZEP	1,05%	
	1E	1,70%	
	1EP	1,70%	
	1G	1,70%	
	1GP	1,70%	
	2E	1,09%	
	2EP	1,09%	
	2G	1,02%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	2GP	1,09%	
	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	0,86%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	AE	1,85%	
	ASH	1,85%	
	AUH	1,85%	
	DE	2,75%	
	DUH	2,80%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	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%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies (continuación)	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	0,74%	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	0,75%	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	1,75%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	AUH	1,75%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	DUH	2,41%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,95%	
	ZE	1,17%	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%	
	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%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies (continuación)	1EP	1,72%	
	1FH	1,57%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	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	0,89%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	W	2,00%	
	XU	0,15%	
	XUP	0,15%	
	ZG	1,18%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZGH	1,05%	
	ZGP	1,21%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	1,16%	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%	
Threadneedle (Lux) - UK Equities	AE	1,80%	
	AEH	1,80%	
	AFH	1,80%	
	AG	1,80%	
	AGP	1,80%	
	DEH	2,60%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - UK Equities (continuación)	DG	2,40%	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%	
	NEH	0,57%	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	0,57%	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	0,61%	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	0,64%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	TUH	0,59%	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	0,89%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	AE	1,80%	
	AEC	1,80%	
	AEH	1,80%	
	AG	1,80%	
	ASC	1,80%	
	AUC	1,80%	
	DE	2,55%	
	DEC	2,55%	
	DEH	2,55%	
	DG	2,61%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	DGP	2,47%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	IE	0,85%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income (continuación)	IEH	0,85%	
	IG	0,85%	
	IGP	0,85%	
	IU	0,85%	
	IUH	0,85%	
	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	0,84%	
	9G	0,84%	
	9UH	0,84%	
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	1,10%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZEH	1,21%	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	1,12%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,51%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZE	0,70%	
	1E	1,17%	
	1EP	1,17%	
	1GH	1,17%	
	1UH	1,17%	
	2E	0,56%	
	2EP	0,56%	
	2GC	0,47%	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	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities (continuación)	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	1,10%	
	AFH	1,05%	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.
	AKH	1,10%	
	ANH	1,10%	
	AUH	1,10%	
	DE	1,65%	
	IE	0,45%	
	IEP	0,45%	
	IGH	0,45%	
	INH	0,45%	
	IU	0,45%	
	IUH	0,51%	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.
	JE	0,45%	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.
	JGH	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.
	JUH	0,46%	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.
	LE	0,30%	
	LEP	0,15%	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, así como al tamaño pequeño de la clase.
	LGH	0,15%	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, así como al tamaño pequeño de la clase.
	XE	0,10%	
	XGH	0,10%	
	XUH	0,10%	
	YE	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.
	YGH	0,50%	
	YUH	0,50%	
	ZE	0,60%	
	ZFH	0,60%	
	ZGH	0,60%	
	ZUH	0,60%	
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	AE	1,85%	
	AEP	1,85%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha (continuación)	AUH	1,96%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	DE	2,35%	
	IE	0,95%	
	IGH	0,95%	
	LE	0,575%	
	XGH	0,15%	
	ZE	1,05%	
	ZF	1,18%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZFH	1,11%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZGH	1,17%	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	1,16%	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%	
	8U	0,87%	
	9U	0,90%	
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	AEH	1,85%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	AU	1,80%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IU	0,90%	
	ZU	1,22%	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	0,88%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	2U	0,83%	
	8E	0,87%	
	8U	0,87%	
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	AEH	1,20%	
	AFH	1,20%	
	AGH	1,20%	
	ASH	1,26%	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	1,25%	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.

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities (continuación)	DEH	1,45%	
	DU	1,45%	
	IEH	0,90%	
	IG	0,90%	
	IGH	0,90%	
	IU	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 y a la significativa variación del VL medio.
	NG	0,55%	
	XU	0,10%	
	ZEH	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.
	ZFH	0,90%	
	ZGH	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 y a la significativa variación del VL medio.
	ZU	1,01%	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.

22 EVENTOS SUBSECUENTES

Con efecto a partir del 28 de abril de 2023, la Cartera Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return se puso en liquidación.

Con efecto a partir del 13 de julio de 2023, la Cartera Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities y la Cartera Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha se pusieron en liquidación.

23 INFORMACIÓN ADICIONAL

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, como caídas en los mercados regionales y mundiales de valores, volatilidad inusual en los mercados mundiales de materias primas y significativas 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 de un 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 las Carteras.

La información periódica del SFDR relativa a los productos financieros a que se refieren el artículo 8(1) del Reglamento (UE) 2019/2088 y el artículo 6 del Reglamento (UE) 2020/852 se encuentra en el Anexo adjunto sin auditar.

Exposición al riesgo global (sin auditar)

Exposición y apalancamiento global

La exposición global de los OICVM se gestiona mediante un enfoque de compromiso, un enfoque de valor en riesgo absoluto (VaR absoluto) o un enfoque de valor en riesgo relativo (VaR relativo).

La información de exposición al riesgo de mercado global durante el ejercicio cerrado el 31 de marzo de 2023 es la siguiente:

Enfoque de compromiso

Con el fin de controlar y medir la exposición global, todas las Carteras que no están incluidas en el enfoque de VaR utilizan el enfoque de compromiso.

La exposición global de los subfondos se calcula según el enfoque de compromiso con arreglo a la metodología descrita en las directrices 10-788 de la AEVM.

Utilizando el periodo de abril de 2022 a marzo de 2023:

Subfondos utilizando la base VaR	Método de cálculo*	Modelo VaR*	Cartera de referencia	Directrices internas de VaR (%)	Límite legal y contractual de VaR (%)	1 año consecutivo				
						Utilización más baja del límite de VaR	Utilización más alta del límite de VaR	Utilización promedio del límite de VaR	Exposición promedio de compromiso	Suma promedio de nacionales
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	VaR relativo	Covarianza	Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (USD Hedged)	1,5 x bmk VaR	2,0 x bmk VaR	99,08%	112,46%	105,86%	38,22%	89,28%
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	VaR relativo	Covarianza	ICE BofA Custom Index 0-4 Year European Currency High Yield, BB-B, 3% Constrained, Excluding Subordinated Debt (EUR Hedged)	1,5 x bmk VaR	2,0 x bmk VaR	86,04%	115,77%	98,93%	0,46%	25,48%
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	VaR relativo	Covarianza	ICE BofA 1-7 Year All Euro Government Index (20%) ICE BofA 1-10 Year Euro Corporate Index (40%) ICE BofA European Currency High Yield Constrained Index (40%)	1,8 x bmk VaR	2,0 x bmk VaR	80,22%	105,17%	95,86%	90,06%	128,44%
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	VaR relativo	Covarianza	Morgan Asia Credit Index Diversified	1,8 x bmk VaR	2,0 x bmk VaR	95,43%	133,11%	110,60%	6,98%	12,35%
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	VaR relativo	Covarianza	MSCI ACWI Index (45%) ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained Index (USD Hedged) (30%) Bloomberg Global Aggregate Index (USD Hedged) (20%) 30-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR) (5%)	1,8 x bmk VaR	2,0 x bmk VaR	52,50%	125,20%	104,45%	30,22%	76,91%
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	VaR absoluto	Covarianza	N/D	8	20	2,97%	7,49%	5,04%	43,39%	91,56%
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	VaR absoluto	Covarianza	N/D	10	20	4,20%	9,43%	7,13%	51,69%	51,69%
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	VaR absoluto	Covarianza	N/D	3,3	20	1,04%	2,87%	1,89%	199,06%	333,12%

Exposición al riesgo global (sin auditar)

(continuación)

Subfondos utilizando la base VaR	Método de cálculo*	Modelo VaR*	Cartera de referencia	Directrices internas de VaR (%)	Límite legal y contractual de VaR (%)	1 año consecutivo				
						Utilización más baja del límite de VaR	Utilización más alta del límite de VaR	Utilización promedio del límite de VaR	Exposición promedio de compromiso	Suma promedio de nacionales
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	VaR absoluto	Covarianza	N/D	4,7	20	1,07%	2,75%	1,96%	157,55%	220,73%
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	VaR relativo	Covarianza	MSCI ACWI Index	1,6 x bmk VaR	2,0 x bmk VaR	100,74%	127,33%	118,13%	85,20%	91,61%
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	VaR relativo	Covarianza	S&P 500 Index	1,6 x bmk VaR	2,0 x bmk VaR	100,44%	123,67%	108,58%	48,18%	48,54%
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	VaR relativo	Histórico	Bloomberg Commodity Index	1,3 x bmk VaR	1,3 x bmk VaR	92,32%	118,96%	100,80%	8,75%	399,01%

* Método de cálculo. El modelo VaR se basa en un intervalo de confianza del 99% a lo largo de un periodo de participación de 1 mes. El modelo de covarianza utiliza 2 años de datos, ponderados con una semivida de 6 meses, y se actualiza diariamente. El método histórico utiliza 1 año de datos diarios.

Información para los accionistas (sin auditar)

La SICAV es una sociedad de inversión organizada como una «*Société d'Investissement à Capital Variable*» en el Gran Ducado de Luxemburgo en virtud de la Ley 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 sin auditar están disponibles en el domicilio social de la SICAV y en la oficina principal de cada agente de pagos y distribuidor. Las cuentas combinadas de la SICAV se expresan en dólares estadounidenses.

El Valor liquidativo y los precios de oferta y reembolso de las acciones de la SICAV se hacen públicos en el domicilio social de la SICAV.

Este informe no constituye una oferta o una solicitud de una oferta para comprar acciones en la SICAV. Las suscripciones se aceptan según el Folleto y el último informe anual disponible que contiene los estados financieros auditados a 31 de marzo y el último informe semestral disponible a 30 de septiembre, si se publican posteriormente.

Ciertas Carteras y/o Clases de Acciones contenidas en este informe pueden no ser autorizadas u ofrecidas para la venta en todas las jurisdicciones en este momento.

Documento de datos fundamentales para el inversor («KIID») / Documento de datos fundamentales («KID»): requisitos de suscripción

El KIID/KID es un documento precontractual y los inversores deberán confirmar que han leído el último KIID/KID 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/KID en el momento de la solicitud. El último KIID/KID se podrá obtener en www.columbiathreadneedle.com.

Declaraciones de la remuneración

Esta declaración se hace con respecto a la Política de remuneración del Grupo, tal como se aplica a Threadneedle Management Luxembourg S.A. («el Gestor») con respecto a la Directiva sobre Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios («OICVM») y otras normas y directrices aplicables.

La Política de remuneración se aplica a todas las entidades filiales de la Sociedad a las que se aplican los requisitos de las Directivas sobre OICVM, y el Comité de remuneración la aprobó por última vez en junio de 2022.

1. El Comité de remuneración

El Comité de remuneración de UK HoldCo («el Comité») es un subcomité del Consejo de UK HoldCo que asume la responsabilidad de establecer la filosofía y los objetivos que regirán los programas de retribución y beneficios del Grupo; de revisar y aprobar los planes, las políticas y las prácticas de retribución y beneficios; y de supervisar y aprobar la remuneración del Grupo. Se ha determinado que sea independiente de la gestión ejecutiva diaria del Grupo y está formado por Consejeros del Grupo designados por Ameriprise Financial, la sociedad matriz del Grupo.

Los miembros actuales del Comité son D. Walter Berman y D. William Turner. Las juntas normalmente se celebran en enero, marzo, junio, septiembre y diciembre. El Global Head of Reward actúa como Secretario del Comité. El Comité puede invitar a asistir a las juntas a cualquier empleado del Grupo o experto funcional de la sociedad matriz que considere adecuado, a fin de permitirle cumplir con sus responsabilidades, incluido garantizar que la remuneración es coherente con la gestión de riesgos efectiva y no fomentar una asunción de riesgos excesiva.

2. Determinación de mancomunaciones de remuneración de incentivos

El Gestor tomó sus decisiones de Concesión anual de incentivos totales de mancomunaciones independientes que abarcan la actividad Inmobiliaria, la unidad de Distribución, las actividades de Inversión y las funciones de Apoyo, combinadas en definitiva para la gobernanza y la supervisión a nivel regional de EMEA. Tales mancomunaciones se determinan a discreción de la Sociedad, sujetas a la supervisión y a la aprobación finales del Comité de remuneración. Las mancomunaciones para los Planes de incentivos especiales («SIP», por sus siglas en inglés) para el sector Inmobiliario, la Distribución y las Inversiones se determinan con referencia a cuatro factores no ponderados, que son una evaluación «descendente» de los requisitos legales, normativos y de práctica de mercado y cualesquiera otros factores contextuales internos o externos; un cálculo «ascendente» con base en el rendimiento comercial frente al nivel del Plan e incentivo objetivo para la empresa (consulte el apartado «Pago por rendimiento» a continuación); el rendimiento estratégico y financiero general del

Información para los accionistas (sin auditar)

(continuación)

Grupo; y el rendimiento estratégico y financiero de Ameriprise Financial como sociedad matriz y accionista del Grupo. La financiación de las funciones de apoyo forma parte del plan global de «AIA», y la financiación para cada región y actividad se determina mediante una Evaluación integral y equilibrada de las unidades de negocio en el contexto del rendimiento general del grupo Ameriprise Financial. Todas las mancomunaciones se establecen en el contexto del entorno de riesgo y control mantenido durante el ejercicio y pueden ajustarse de forma descendente para reflejar cualquier aspecto sustancial al respecto. El Comité también recibe informes continuos a lo largo del ejercicio de la función de Riesgo relativa a las evaluaciones de riesgos y otros temas o ámbitos de interés relacionados con el control de riesgos o las preocupaciones sobre el comportamiento relacionado con los riesgos.

El Comité tiene todos estos factores en cuenta a fin de tomar una decisión equilibrada sobre la supervisión y aprobación de las mancomunaciones de incentivos totales para el ejercicio en cuestión.

3. Determinación de concesiones individuales de incentivos totales

Las decisiones de remuneración individual en relación con todos los planes de incentivos son discrecionales en su totalidad, aunque están fundamentadas de forma sólida en la evaluación del rendimiento anual y los niveles de remuneración del mercado conocidos para puestos de trabajo equivalentes, así como en la financiación mancomunada disponible. El departamento de Riesgo y cumplimiento proporciona información crítica al ajuste de la calificación de rendimiento final, lo que garantiza que todo riesgo y toda preocupación pertinente sobre el comportamiento se reflejen en las evaluaciones de rendimiento y, posteriormente, en las recomendaciones de remuneración. Los directores de Riesgo y cumplimiento para EMEA también informan directamente al Comité de remuneración del proceso de concesión para garantizar que el Comité reciba un informe directo en el que se base al tomar sus decisiones finales de ajuste de riesgos.

Los salarios base se mantienen a un nivel competitivo de mercado a fin de garantizar que, si procede, sea posible conceder cero incentivos.

Pago por rendimiento

El elemento ascendente del proceso de determinación de la mancomunación de los Planes de incentivos especiales mide el rendimiento empresarial general y por equipos frente a los objetivos comerciales principales para cada ámbito del Grupo, incluido el rendimiento de las inversiones a largo plazo para las divisiones de Inversiones e Inmobiliaria y una combinación de ventas brutas y netas para la división de Distribución. El rendimiento de inversiones se evalúa respecto al índice de referencia de cada fondo y sus perfiles de riesgo. Tales impactos de las evaluaciones en el cálculo ascendente están limitados, y ponderados en mayor medida con los periodos de tiempo más largos, para que los gestores de incentivos no asuman un riesgo excesivo a fin de ofrecer mayores mancomunaciones de incentivos. Si bien los resultados estratégicos y financieros del Grupo y la sociedad matriz son factores importantes en la determinación de la mancomunación, el modelo se establece para garantizar que el logro de los objetivos principales de la actividad comercial, incluida la aportación de rendimiento de inversiones a sus clientes, sea un impulsor explícito y significativo de la determinación de la mancomunación para tales divisiones.

Las concesiones individuales discrecionales de la financiación disponible, en el contexto de niveles de remuneración competitivos de mercado para el puesto de trabajo en cuestión, están impulsadas por cada calificación individual frente a las metas (Objetivos) y las expectativas de la dirección sobre el comportamiento del Grupo (nuestros Valores), cada uno de los cuales está calificado de forma independiente sobre una escala de 5 puntos para garantizar que se otorga la debida importancia a la evaluación del comportamiento. Los objetivos se centran en los resultados clave para la función de ese año, en particular en la obtención de resultados de inversión para los empleados de Inversiones y para la división de Inmuebles: todos los empleados también se gestionan en función de un Objetivo obligatorio de gestión de riesgos. El rendimiento de inversiones, si fuera relevante para la función, se evalúa frente al índice de referencia de cada fondo y sus perfiles de riesgo.

Se verifica la coherencia de las calificaciones en la actividad comercial con la información de los directores de Riesgo y cumplimiento para EMEA según sea necesaria para garantizar el equilibrio y el debido reflejo de la gestión de riesgos. Con respecto a los incentivos de las divisiones de Ventas, Inmobiliaria e Inversiones, no existe ninguna plantilla o fórmula predeterminada sobre las concesiones, que son discrecionales a fin de poder justificar y reflejar todos los factores pertinentes.

Prestación de incentivos totales

El Grupo cree que las concesiones diferidas para los que ganan más y los que asumen riesgos son una cuestión de buenas prácticas y una parte importante de alinear los intereses del personal clave con los intereses a largo plazo de los clientes y accionistas. A tal respecto, las Concesiones de incentivos totales para todos los empleados del Grupo pueden otorgarse en parte en concesiones diferidas a través del programa de Concesión de incentivos a largo plazo de Ameriprise Financial («LTIA», por sus siglas en inglés) y, para aquel Personal de código/Personal identificado de la división de Inversiones, a través de un programa de diferimiento del fondo. Los diferimientos y la prestación de concesiones en instrumentos cumplirán con los requisitos normativos pertinentes en vigor en cada momento.

El personal calificado como Personal de código o Personal identificado y aquellos de un nivel comparable de antigüedad están sujetos a una tasa más alta de diferimiento. El 50% de la concesión de incentivos generales se ingresa en participaciones vinculadas al fondo sujetas a un periodo de participación después de la prestación. Las participaciones vinculadas al fondo están diseñadas para reflejar el rendimiento de una sección de productos y clases de activos dentro de la región.

Información para los accionistas (sin auditar)

(continuación)

4. Personal identificado

El Personal de código o Personal identificado se clasifica como Gestores sénior, personas con un impacto significativo en el perfil de riesgo de los OICVM, personas que ejercen funciones de control y otros empleados cuya remuneración total les sitúa en la misma categoría que la alta dirección y los que asumen riesgos, y cuyas actividades profesionales tienen un impacto significativo en los perfiles de riesgo del Gestor o de los fondos que este gestiona. En la práctica, esto incluirá los denominados Gestores de los Fondos de tales fondos del Gestor.

5. Declaración del pago de la remuneración

El periodo de rendimiento para la remuneración opera sobre la base del año calendario.

La remuneración total pagada por el Grupo a 27 Gestores sénior del Personal de código de remuneración del OICVM V por sus actividades de OICVM en el año de resultados 2022 fue de 2,06 millones de libras esterlinas, de los cuales 0,85 millones fueron remuneraciones fijas y 1,21 millones fueron variables. La remuneración total pagada a otros miembros del Personal de código de remuneración del OICVM cuyas actividades tuvieron un impacto significativo en el perfil de riesgo del Gestor fue de 6,27 millones de libras esterlinas, de los cuales 2,66 millones fueron remuneraciones fijas y 3,61 millones fueron variables. La remuneración total pagada a los gestores delegados de los fondos regulados por los OICVM fue de 0,99 millones de libras esterlinas, de los cuales 0,29 millones fueron remuneraciones fijas y 0,70 millones fueron variables.

Información para inversores en Suiza (sin auditar)

El informe anual y los estados financieros auditados, el informe semestral sin auditar, el informe sobre los cambios en las participaciones de la Cartera correspondiente al ejercicio, los estatutos, el Folleto (versión suiza) y el KIID podrán obtenerse previa solicitud y sin coste alguno en las oficinas del Representante y agente de pagos suizo de la SICAV, RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, Sucursal de Zürich, Bleicherweg 7, 8027 Zürich, Suiza, o en el domicilio social de la SICAV.

El rendimiento histórico no es un indicio del rendimiento actual o futuro, y los datos de rendimiento no tienen en cuenta las comisiones y los costes incurridos en la emisión y el reembolso de acciones.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

			31 de diciembre de 2022	31 de diciembre de 2021	31 de diciembre de 2020			
Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond								
AEC	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-17,59%	-0,79%	-2,48%	8,26%	9,67%
AEH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-17,57%	-0,79%	-2,49%	8,26%	9,71%
AKH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-17,24%	-0,79%	-2,26%	8,26%	9,87%
ANH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-16,49%	-0,79%	-1,75%	8,26%	10,06%
AU	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-15,69%	-0,79%	-1,57%	8,26%	11,36%
AUP	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-15,69%	-0,79%	-1,57%	8,26%	11,36%
DEC	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-18,19%	-0,79%	-3,21%	8,26%	8,90%
DEH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-18,16%	-0,79%	-3,22%	8,26%	8,85%
DU	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-16,31%	-0,79%	-2,30%	8,26%	10,53%
DUP	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-16,32%	-0,79%	-2,30%	8,26%	10,53%
IEC	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-17,41%	-0,79%	-2,29%	8,26%	9,92%
IEH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-17,38%	-0,79%	-2,29%	8,26%	9,86%
IEP	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-9,97%	-0,79%	6,08%	8,26%	2,20%
IGC	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-16,25%	-0,79%	-1,63%	8,26%	10,24%
IGH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-16,23%	-0,79%	-1,61%	8,26%	10,25%
IKH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-17,03%	-0,79%	-1,95%	8,26%	10,10%
INH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-16,27%	-0,79%	-1,47%	8,26%	10,39%
IU	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-15,48%	-0,79%	-1,37%	8,26%	11,58%
IUP	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-15,48%	-0,79%	-1,37%	8,26%	11,61%
NEC	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-17,26%	-0,79%	-2,09%	8,26%	10,16%
NEH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-17,27%	-0,79%	-2,10%	8,26%	10,08%
NGC	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-16,11%	-0,79%	-1,41%	8,26%	10,51%
NGH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-16,09%	-0,79%	-1,41%	8,26%	10,49%
NU	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-15,35%	-0,79%	-1,17%	8,26%	11,80%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

			31 de diciembre de 2022		31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020	
Clase de	Nombre del índice de referencia	Comentarios	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond								
<i>(continuación)</i>								
NUP	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-15,35%	-0,79%	-1,17%	8,26%	11,82%
XEH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)	Rendimiento desde su lanzamiento el 16 de octubre de 2020	-14,11%	-17,05%	-0,79%	-1,80%	2,18%	2,27%
XFH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)	Rendimiento desde su lanzamiento el 16 de octubre de 2020	-14,11%	-17,39%	-0,79%	-2,07%	2,18%	2,21%
XGH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-15,85%	-0,79%	-1,11%	8,26%	10,81%
XU	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)	Rendimiento desde su lanzamiento el 16 de octubre de 2020	-14,11%	-15,09%	-0,79%	-0,87%	2,18%	2,48%
ZEH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-17,38%	-0,79%	-2,23%	8,26%	9,97%
ZFH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)	Rendimiento desde su lanzamiento el 14 de octubre de 2020	-14,11%	-17,80%	-0,79%	-2,66%	2,17%	2,11%
ZGH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-16,22%	-0,79%	-1,55%	8,26%	10,32%
ZU	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11%	-15,48%	-0,79%	-1,32%	8,26%	11,63%
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond								
AE	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17%	-14,74%	-1,08%	-1,81%	2,73%	3,76%
ANH	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17%	-13,72%	-1,08%	-1,20%	2,73%	4,48%
IE	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17%	-14,33%	-1,08%	-1,22%	2,73%	4,39%
IEP	iBoxx EUR Corporate Bond	Rendimiento desde su lanzamiento el 8 de abril de 2021	-14,17%	-14,43%	-0,66%	-0,97%	n/d	n/d
INH	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17%	-13,27%	-1,08%	-0,51%	2,73%	5,04%
XE	iBoxx EUR Corporate Bond	Rendimiento desde su lanzamiento el 16 de octubre de 2020	-14,17%	-14,08%	-1,08%	-0,73%	1,13%	1,53%
XFH	iBoxx EUR Corporate Bond	Rendimiento desde su lanzamiento el 16 de octubre de 2020	-14,17%	-14,50%	-1,08%	-1,05%	1,13%	1,48%
XGH	iBoxx EUR Corporate Bond	Rendimiento desde su lanzamiento el 16 de octubre de 2020	-14,17%	-12,92%	-1,08%	-0,20%	1,13%	1,65%
XUH	iBoxx EUR Corporate Bond	Rendimiento desde su lanzamiento el 16 de octubre de 2020	-14,17%	-12,29%	-1,08%	-0,04%	1,13%	1,72%
ZE	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17%	-14,53%	-1,08%	-1,45%	2,73%	4,29%
ZFH	iBoxx EUR Corporate Bond	Rendimiento desde su lanzamiento el 14 de octubre de 2020	-14,17%	-15,00%	-1,08%	-1,72%	1,27%	1,51%
1E	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17%	-14,87%	-1,08%	-1,80%	2,73%	3,78%
1G	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17%	-10,04%	-1,08%	-7,89%	2,73%	9,62%
2E	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17%	-14,35%	-1,08%	-1,20%	2,73%	4,41%
2G	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17%	-9,59%	-1,08%	-7,36%	2,73%	10,26%
3G	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17%	-9,59%	-1,08%	-7,43%	2,73%	10,18%
4E	iBoxx EUR Corporate Bond	Rendimiento desde su lanzamiento el 8 de abril de 2020	-14,17%	-13,92%	-1,08%	-0,70%	9,46%	10,73%
4G	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17%	-9,04%	-1,08%	-6,86%	2,73%	10,85%
8E	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17%	-14,39%	-1,08%	-1,24%	2,73%	4,37%
8G	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17%	-9,53%	-1,08%	-7,36%	2,73%	10,26%
9G	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17%	-9,62%	-1,08%	-7,46%	2,73%	10,22%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

			31 de diciembre de 2022		31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020	
Clase de	Nombre del índice de referencia	Comentarios	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond								
AE	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)	Rendimiento desde su lanzamiento el 6 de mayo de 2020	-11,75%	-12,21%	3,25%	1,46%	14,26%	11,30%
AKH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-12,00%	3,25%	1,67%	2,82%	2,71%
ANH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-11,18%	3,25%	2,17%	2,82%	2,68%
IE	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-11,55%	3,25%	2,27%	2,82%	3,43%
IEP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-11,55%	3,25%	2,27%	2,82%	3,43%
IKH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-11,23%	3,25%	2,48%	2,82%	3,32%
INH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-10,42%	3,25%	2,93%	2,82%	3,36%
XE	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-11,01%	3,25%	3,00%	2,82%	4,15%
ZE	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-11,61%	3,25%	2,22%	2,82%	3,38%
ZEP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-11,61%	3,25%	2,22%	2,82%	3,36%
1E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-12,09%	3,25%	1,73%	2,82%	2,88%
1EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-12,09%	3,25%	1,73%	2,82%	2,88%
1G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-7,10%	3,25%	-4,58%	2,82%	8,68%
1GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-7,09%	3,25%	-4,56%	2,82%	8,65%
1UT	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-10,24%	3,25%	2,47%	2,82%	4,25%
2E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-11,60%	3,25%	2,30%	2,82%	3,46%
2EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-11,59%	3,25%	2,33%	2,82%	3,50%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de			31 de diciembre de 2022	31 de diciembre de 2021	31 de diciembre de 2020		
Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	Índice de Rendimiento	Índice de Rendimiento	Índice de Rendimiento	Índice de Rendimiento	Índice de Rendimiento
			referencia de la cartera	referencia de la cartera	referencia de la cartera	referencia de la cartera	referencia de la cartera
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond (continuación)							
2FH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-12,03%	3,25%	1,99%	2,82%
2G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-6,65%	3,25%	-4,11%	2,82%
2GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-6,56%	3,25%	-3,99%	2,82%
3E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-11,55%	3,25%	2,35%	2,82%
3EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-11,55%	3,25%	2,35%	2,82%
3FC	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-11,98%	3,25%	2,03%	2,82%
3FH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-11,98%	3,25%	2,04%	2,82%
3G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-6,53%	3,25%	-3,99%	2,82%
3GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-6,52%	3,25%	-3,98%	2,82%
4E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-10,93%	3,25%	3,07%	2,82%
4G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-5,90%	3,25%	-3,32%	2,82%
8E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-11,63%	3,25%	2,26%	2,82%
8EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-11,63%	3,25%	2,26%	2,82%
8FH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-12,06%	3,25%	1,95%	2,82%
8G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-6,62%	3,25%	-4,08%	2,82%
8GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-6,61%	3,25%	-4,06%	2,82%
9E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-11,51%	3,25%	2,40%	2,82%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de			31 de diciembre de 2022	31 de diciembre de 2021	31 de diciembre de 2020		
Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	Índice de Rendimiento referencia de la cartera	Índice de Rendimiento referencia de la cartera	Índice de Rendimiento referencia de la cartera	Índice de Rendimiento referencia de la cartera	Índice de Rendimiento referencia de la cartera
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond (continuación)							
9EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-11,51%	3,25%	2,40%	2,82%
9FC	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-11,86%	3,25%	2,10%	2,82%
9FH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-11,85%	3,25%	2,08%	2,82%
9G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-6,48%	3,25%	-3,87%	2,82%
9GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75%	-6,43%	3,25%	-3,88%	2,82%
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond							
AE	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL		n/d	-4,82%	n/d	1,82%	0,62%
AEP	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL		n/d	-4,83%	n/d	1,82%	0,62%
AKH	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL		n/d	-4,55%	n/d	2,11%	0,62%
ANH	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL		n/d	-3,62%	n/d	2,55%	0,62%
IE	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL		n/d	-4,44%	n/d	2,23%	0,62%
IEP	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL		n/d	-4,44%	n/d	2,22%	0,62%
IGC	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL		n/d	-3,15%	n/d	2,80%	0,62%
IGH	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL		n/d	-3,20%	n/d	2,76%	0,62%
IKH	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL		n/d	-4,18%	n/d	2,49%	0,62%
INH	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL		n/d	-3,30%	n/d	2,92%	0,62%
XE	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL		n/d	-4,06%	n/d	2,64%	0,62%
XGC	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL		n/d	-2,71%	n/d	3,19%	0,62%
XGH	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL		n/d	-2,67%	n/d	3,17%	0,62%
ZE	ÍNDICE DE REFERENCIA NO OFICIAL		n/d	-4,53%	n/d	2,16%	0,62%
Threadneedle (Lux) - European Social Bond							
AE	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de septiembre de 2020	-14,49%	-15,43%	-1,46%	-2,38%	1,52%
AEP	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de septiembre de 2020	-14,49%	-15,43%	-1,46%	-2,38%	1,52%
AFH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	-14,49%	-15,82%	-0,62%	-1,19%	n/d
AKH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 14 de octubre de 2020	-14,49%	-15,00%	-1,46%	-1,93%	1,04%
ANH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 14 de octubre de 2020	-14,49%	-14,14%	-1,46%	-1,46%	1,04%
ASC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	-14,49%	-13,98%	-0,62%	-0,43%	n/d
ASH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	-14,49%	-13,94%	-0,62%	-0,44%	n/d
AUC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	-14,49%	-13,67%	-0,62%	-0,36%	n/d

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

			31 de diciembre de 2022	31 de diciembre de 2021	31 de diciembre de 2020		
Clase de	Nombre del índice de referencia	Comentarios	Índice de Rendimiento	Índice de Rendimiento	Índice de Rendimiento	Índice de Rendimiento	Índice de Rendimiento
Acciones			referencia de la cartera	referencia de la cartera	referencia de la cartera	referencia de la cartera	referencia de la cartera
Threadneedle (Lux) - European Social Bond							
<i>(continuación)</i>							
AUH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	-14,49%	-13,69%	-0,62%	-0,33%	n/d
ID	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49%	-15,31%	-1,46%	-2,31%	2,74%
IE	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49%	-15,30%	-1,46%	-2,23%	2,74%
IEP	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49%	-15,30%	-1,46%	-2,23%	2,74%
IFH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49%	-15,74%	-1,46%	-2,56%	2,74%
IGH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	-14,49%	-14,19%	-0,62%	-0,45%	n/d
IKH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49%	-14,96%	-1,46%	-1,88%	2,74%
INH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49%	-14,09%	-1,46%	-1,41%	2,74%
ISC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	-14,49%	-13,77%	-0,62%	-0,42%	n/d
ISH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	-14,49%	-13,81%	-0,62%	-0,42%	n/d
IUC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	-14,49%	-13,62%	-0,62%	-0,35%	n/d
IUH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	-14,49%	-13,62%	-0,62%	-0,26%	n/d
LE	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49%	-15,30%	-1,46%	-2,24%	2,74%
NEP	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49%	-15,30%	-1,46%	-2,23%	2,74%
ZD	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49%	-15,36%	-1,46%	-2,36%	2,74%
ZE	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49%	-15,34%	-1,46%	-2,28%	2,74%
ZEP	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49%	-15,34%	-1,46%	-2,28%	2,74%
ZFH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49%	-15,79%	-1,46%	-2,60%	2,74%
ZGC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 3 de abril de 2020	-14,49%	-14,27%	-1,46%	-1,75%	7,68%
ZGH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 3 de abril de 2020	-14,49%	-14,25%	-1,46%	-1,75%	7,68%
ZUH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Rendimiento desde su lanzamiento el 12 de junio de 2020	-14,49%	-13,65%	-1,46%	-1,58%	3,50%
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond							
AE	ICE BofA Custom Index		-11,32%	-10,90%	0,86%	-0,63%	2,23%
AEP	ICE BofA Custom Index		-11,32%	-10,90%	0,86%	-0,63%	2,23%
AKH	ICE BofA Custom Index		-11,32%	-10,69%	0,86%	-0,54%	2,23%
ANH	ICE BofA Custom Index		-11,32%	-9,71%	0,86%	-0,13%	2,23%
AUH	ICE BofA Custom Index		-11,32%	-9,17%	0,86%	-0,02%	2,23%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

			31 de diciembre de 2022	31 de diciembre de 2021	31 de diciembre de 2020
Clase de			Índice de	Índice de	Índice de
Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	referencia	referencia	referencia
			de la cartera	de la cartera	de la cartera
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond					
(continuación)					
DE	ICE BofA Custom Index		-11,32%	-11,39%	0,86%
DEP	ICE BofA Custom Index		-11,32%	-11,39%	0,86%
DUH	ICE BofA Custom Index		-11,32%	-9,64%	0,86%
IE	ICE BofA Custom Index		-11,32%	-10,36%	0,86%
INH	ICE BofA Custom Index		-11,32%	-9,13%	0,86%
ZE	ICE BofA Custom Index	Rendimiento desde su lanzamiento el 11 de noviembre de 2021	-11,32%	-10,58%	-0,42%
				-0,40%	n/d
					n/d
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds					
AEC	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26%	-14,53%	0,91%
AEH	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26%	-14,58%	0,91%
AKH	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26%	-14,19%	0,91%
ANH	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26%	-13,33%	0,91%
ASH	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26%	-12,95%	0,91%
AU	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26%	-12,62%	0,91%
AUP	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26%	-12,62%	0,91%
DEC	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26%	-14,62%	0,91%
DEH	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26%	-14,67%	0,91%
DU	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26%	-12,70%	0,91%
IEC	JPM CEMBI Broad Diversified	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2021	-12,26%	-13,82%	n/d
				-1,16%	n/d
					n/d
IEH	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26%	-13,89%	0,91%
IU	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26%	-11,92%	0,91%
W	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26%	-12,31%	0,91%
WEH	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26%	-14,27%	0,91%
XUP	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26%	-11,27%	0,91%
				0,07%	7,13%
ZU	JPM CEMBI Broad Diversified	Rendimiento desde su lanzamiento el 11 de noviembre de 2021	-12,26%	-11,88%	n/d
				0,01%	n/d
					n/d
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt					
AEC	JPM EMBI Global		-16,45%	-18,84%	-1,51%
AEH	JPM EMBI Global		-16,45%	-18,88%	-1,51%
AKH	JPM EMBI Global		-16,45%	-18,75%	-1,51%
ANH	JPM EMBI Global		-16,45%	-17,86%	-1,51%
ASH	JPM EMBI Global		-16,45%	-17,12%	-1,51%
AU	JPM EMBI Global		-16,45%	-16,64%	-1,51%
AUP	JPM EMBI Global		-16,45%	-16,64%	-1,51%
DEH	JPM EMBI Global		-16,45%	-18,94%	-1,51%
DU	JPM EMBI Global		-16,45%	-16,73%	-1,51%
IEH	JPM EMBI Global		-16,45%	-18,21%	-1,51%
IU	JPM EMBI Global		-16,45%	-15,97%	-1,51%
				-2,45%	5,88%
SU	JPM EMBI Global		-16,45%	-16,77%	-1,51%
SUP	JPM EMBI Global		-16,45%	-16,77%	-1,51%
W	JPM EMBI Global		-16,45%	-16,35%	-1,51%
XUP	JPM EMBI Global		-16,45%	-15,45%	-1,51%
				-1,59%	5,88%
ZU	JPM EMBI Global		-16,45%	-16,01%	-1,51%
				-2,34%	5,88%
					8,07%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

			31 de diciembre de 2022	31 de diciembre de 2021	31 de diciembre de 2020			
Clase de			Índice de	Rendimiento	Índice de	Rendimiento	Índice de	Rendimiento
Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	referencia	de la cartera	referencia	de la cartera	referencia	de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds								
AEC	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28%	-12,48%	0,19%	-2,58%	4,79%	2,68%
AEH	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28%	-12,49%	0,19%	-2,59%	4,79%	2,69%
AKH	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28%	-12,37%	0,19%	-2,33%	4,79%	2,65%
ANH	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28%	-11,33%	0,19%	-1,88%	4,79%	2,90%
ASC	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28%	-10,75%	0,19%	-1,70%	4,79%	3,71%
ASH	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28%	-10,77%	0,19%	-1,72%	4,79%	3,70%
AU	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28%	-10,41%	0,19%	-1,65%	4,79%	4,22%
AUP	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28%	-10,41%	0,19%	-1,65%	4,79%	4,22%
DEH	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28%	-12,63%	0,19%	-2,73%	4,79%	2,54%
DU	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28%	-10,54%	0,19%	-1,79%	4,79%	4,07%
IE	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28%	-3,82%	0,19%	6,62%	4,79%	-3,68%
IEH	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28%	-11,84%	0,19%	-1,84%	4,79%	3,45%
XU	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28%	-9,12%	0,19%	-0,21%	4,79%	5,75%
XUP	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28%	-9,12%	0,19%	-0,21%	4,79%	5,75%
ZEH	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28%	-11,86%	0,19%	-1,90%	4,79%	3,38%
ZU	JPM EMBI Global 3-5 Years	Rendimiento desde su lanzamiento el 11 de noviembre de 2021	-10,28%	-9,68%	-1,11%	-0,74%	n/d	n/d
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond								
AEC	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10%	-13,36%	5,27%	2,57%	6,10%	3,32%
AEH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10%	-13,37%	5,27%	2,56%	6,10%	3,33%
AKH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10%	-13,21%	5,27%	2,89%	6,10%	3,11%
ANH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10%	-12,52%	5,27%	3,26%	6,10%	2,96%
ASH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10%	-11,66%	5,27%	3,45%	6,10%	4,30%
AU	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10%	-11,18%	5,27%	3,54%	6,10%	4,99%
AUP	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10%	-11,18%	5,27%	3,54%	6,10%	4,99%
DEC	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10%	-13,52%	5,27%	2,37%	6,10%	3,13%
DEH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10%	-13,55%	5,27%	2,38%	6,10%	3,13%
DU	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10%	-11,36%	5,27%	3,34%	6,10%	4,78%
IEC	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10%	-12,61%	5,27%	3,48%	6,10%	4,30%
IEH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10%	-12,60%	5,27%	3,49%	6,10%	4,22%
IKH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10%	-12,38%	5,27%	3,80%	6,10%	4,08%
INH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10%	-11,63%	5,27%	4,19%	6,10%	3,97%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

			31 de diciembre de 2022		31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020	
Clase de	Nombre del índice de referencia	Comentarios	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond (continuación)								
ISC	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained	Rendimiento desde su lanzamiento el 29 de julio de 2021	-11,10%	-10,88%	1,38%	1,52%	n/d	n/d
IU	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10%	-10,42%	5,27%	4,48%	6,10%	5,94%
TEH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10%	-12,59%	5,27%	3,48%	6,10%	4,22%
XUP	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10%	-9,96%	5,27%	5,06%	6,10%	6,51%
ZFH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10%	-13,06%	5,27%	2,91%	6,10%	3,70%
ZGH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10%	-11,68%	5,27%	3,79%	6,10%	4,13%
ZU	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10%	-10,59%	5,27%	4,22%	6,10%	5,67%
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond								
AEH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41%	-15,70%	-0,61%	-0,82%	5,67%	2,44%
AKH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41%	-15,25%	-0,61%	-0,50%	5,67%	2,68%
AS	JPM Asia Credit Diversified		-11,41%	-14,29%	-0,61%	2,06%	5,67%	2,32%
ASC	JPM Asia Credit Diversified		-11,41%	-14,13%	-0,61%	0,03%	5,67%	3,65%
ASH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41%	-14,15%	-0,61%	0,01%	5,67%	3,61%
AU	JPM Asia Credit Diversified		-11,41%	-13,84%	-0,61%	0,07%	5,67%	4,10%
AUP	JPM Asia Credit Diversified		-11,41%	-13,84%	-0,61%	0,07%	5,67%	4,10%
AVC	JPM Asia Credit Diversified		-11,41%	-14,54%	-0,61%	-0,50%	5,67%	3,16%
AVH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41%	-14,59%	-0,61%	-0,38%	5,67%	3,10%
DEH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41%	-15,95%	-0,61%	-1,14%	5,67%	2,21%
IEH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41%	-15,20%	-0,61%	-0,24%	5,67%	3,15%
IGH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41%	-14,00%	-0,61%	0,41%	5,67%	3,60%
ISH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41%	-13,64%	-0,61%	0,66%	5,67%	4,34%
IU	JPM Asia Credit Diversified		-11,41%	-13,32%	-0,61%	0,67%	5,67%	4,80%
XU	JPM Asia Credit Diversified		-11,41%	-12,97%	-0,61%	1,07%	5,67%	5,46%
ZU	JPM Asia Credit Diversified		-11,41%	-13,39%	-0,61%	0,57%	5,67%	4,70%
ZUP	JPM Asia Credit Diversified		-11,41%	-13,44%	-0,61%	0,55%	5,67%	4,63%
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return								
AE	MUICP (EU CPI)		9,31%	-10,68%	4,76%	6,86%	-0,25%	5,21%
AEP	MUICP (EU CPI)		9,31%	-10,80%	4,76%	6,81%	-0,25%	5,16%
DE	MUICP (EU CPI)		9,31%	-11,35%	4,76%	6,06%	-0,25%	4,43%
IE	MUICP (EU CPI)		9,31%	-10,05%	4,76%	7,61%	-0,25%	5,95%
IEP	MUICP (EU CPI)		9,31%	-9,82%	4,76%	7,61%	-0,25%	5,92%
LE	MUICP (EU CPI)		9,31%	-9,92%	4,76%	7,77%	-0,25%	6,11%
LEP	MUICP (EU CPI)		9,31%	-9,73%	4,76%	7,82%	-0,25%	6,10%
ZE	MUICP (EU CPI)		9,31%	-10,33%	4,76%	7,41%	-0,25%	5,74%
ZEP	MUICP (EU CPI)		9,31%	-10,31%	4,76%	7,42%	-0,25%	5,75%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

			31 de diciembre de 2022		31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020	
Clase de			Índice de	Rendimiento	Índice de	Rendimiento	Índice de	Rendimiento
Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	referencia	de la cartera	referencia	de la cartera	referencia	de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return								
AEC	US CPI		6,42%	-16,15%	7,12%	-0,68%	n/d	9,60%
AEH	US CPI		6,42%	-16,15%	7,12%	-0,67%	n/d	9,60%
AKH	US CPI		6,42%	-16,11%	7,12%	-0,44%	n/d	9,59%
AU	US CPI		6,42%	-13,80%	7,12%	0,32%	n/d	11,46%
AUP	US CPI		6,42%	-13,80%	7,12%	0,32%	n/d	11,46%
DEH	US CPI		6,42%	-16,69%	7,12%	-1,32%	n/d	8,89%
DU	US CPI		6,42%	-14,36%	7,12%	-0,33%	n/d	10,74%
IEH	US CPI		6,42%	-15,48%	7,12%	-0,09%	n/d	10,26%
IGH	US CPI		6,42%	-14,49%	7,12%	0,66%	n/d	10,78%
IU	US CPI		6,42%	-13,19%	7,12%	1,03%	n/d	12,24%
W	US CPI		6,42%	-13,89%	7,12%	0,22%	n/d	11,35%
ZU	US CPI	Rendimiento desde su lanzamiento el 11 de noviembre de 2021	6,42%	-13,38%	0,99%	-1,89%	n/d	n/d
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income								
AE	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-5,86%	1,03%	15,61%	0,66%	-6,12%
AEC	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-13,92%	1,03%	6,43%	0,66%	0,64%
AEH	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-13,90%	1,03%	6,35%	0,66%	0,61%
AEP	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-5,87%	1,03%	15,61%	0,66%	-6,12%
AS	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-12,32%	1,03%	9,39%	0,66%	0,33%
ASC	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-12,17%	1,03%	7,33%	0,66%	1,53%
ASH	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-12,17%	1,03%	7,27%	0,66%	1,46%
ASP	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-12,11%	1,03%	9,60%	0,66%	0,57%
AU	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-11,65%	1,03%	7,45%	0,66%	2,33%
AUM	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-11,65%	1,03%	7,45%	0,66%	2,32%
AUP	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-11,65%	1,03%	7,45%	0,66%	2,33%
DEC	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-14,56%	1,03%	5,63%	0,66%	-0,14%
DEH	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-14,54%	1,03%	5,55%	0,66%	-0,14%
DEP	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-6,57%	1,03%	14,74%	0,66%	-6,82%
DU	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-12,31%	1,03%	6,65%	0,66%	1,56%
DUP	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-12,31%	1,03%	6,65%	0,66%	1,56%
ZE	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-5,50%	1,03%	16,17%	0,66%	-5,65%
ZEC	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-13,64%	1,03%	6,93%	0,66%	1,08%
ZEH	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-13,43%	1,03%	6,91%	0,66%	1,11%
ZFH	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-13,93%	1,03%	6,59%	0,66%	0,89%
ZU	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-11,20%	1,03%	7,98%	0,66%	2,84%
ZUP	Índice de referencia compuesto		-12,89%	-11,31%	1,03%	7,90%	0,66%	2,72%
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities								
AE	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-19,74%	-28,89%	-2,22%	-2,97%	20,31%	24,15%
AEC	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-19,74%	-35,44%	-2,22%	-10,90%	20,31%	29,65%
AEH	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-19,74%	-35,45%	-2,22%	-10,94%	20,31%	29,65%
AU	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-19,74%	-33,26%	-2,22%	-9,83%	20,31%	30,12%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	31 de diciembre de 2022 Índice de Rendimiento referencia de la cartera	31 de diciembre de 2021 Índice de Rendimiento referencia de la cartera	31 de diciembre de 2020 Índice de Rendimiento referencia de la cartera
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities (continuación)					
AUP	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-19,74%	-33,24%	-2,22%
IE	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-19,74%	-28,17%	-2,22%
IEH	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-19,74%	-34,77%	-2,22%
IG	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-19,74%	-24,11%	-2,22%
IU	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-19,74%	-32,55%	-2,22%
LE	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-19,74%	-27,98%	-2,22%
LG	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-19,74%	-23,85%	-2,22%
XU	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-19,74%	-32,14%	-2,22%
ZE	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-19,74%	-28,31%	-2,22%
ZEC	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-19,74%	-34,99%	-2,22%
ZEH	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-19,74%	-34,98%	-2,22%
ZU	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-19,74%	-32,75%	-2,22%
ZUP	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 24 de septiembre de 2020	-19,74%	-32,76%	-2,22%
Threadneedle (Lux) - Global Focus					
AEH	MSCI AC World		-17,96%	-29,05%	19,04%
AEP	MSCI AC World		-17,96%	-21,68%	19,04%
ASH	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 27 de abril de 2022	-6,07%	-8,11%	n/d
AU	MSCI AC World		-17,96%	-26,50%	19,04%
AUP	MSCI AC World		-17,96%	-26,50%	19,04%
DEH	MSCI AC World		-17,96%	-29,57%	19,04%
DU	MSCI AC World		-17,96%	-27,05%	19,04%
IE	MSCI AC World		-17,96%	-21,01%	19,04%
IEH	MSCI AC World		-17,96%	-28,45%	19,04%
IU	MSCI AC World		-17,96%	-25,87%	19,04%
IUP	MSCI AC World		-17,96%	-25,87%	19,04%
W	MSCI AC World		-17,96%	-26,45%	19,04%
XU	MSCI AC World		-17,96%	-25,33%	19,04%
ZE	MSCI AC World		-17,96%	-21,07%	19,04%
ZEH	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 16 de septiembre de 2020	-17,96%	-28,46%	19,04%
ZEP	MSCI AC World		-17,96%	-21,08%	19,04%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

			31 de diciembre de 2022		31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020	
Clase de	Nombre del índice de referencia	Comentarios	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Focus								
<i>(continuación)</i>								
ZFH	MSCI AC World	Rendimiento desde su lanzamiento el 16 de septiembre de 2020	-17,96%	-28,49%	19,04%	21,76%	12,83%	9,80%
ZG	MSCI AC World		-17,96%	-16,60%	19,04%	24,54%	16,82%	23,79%
ZU	MSCI AC World		-17,96%	-25,93%	19,04%	23,40%	16,82%	27,74%
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities								
AEH	MSCI Emerging Markets		-19,74%	-36,61%	-2,22%	-10,32%	18,69%	31,52%
AU	MSCI Emerging Markets		-19,74%	-34,37%	-2,22%	-9,25%	18,69%	33,80%
DEH	MSCI Emerging Markets		-19,74%	-37,08%	-2,22%	-10,97%	18,69%	30,51%
DU	MSCI Emerging Markets		-19,74%	-34,86%	-2,22%	-9,93%	18,69%	32,80%
IE	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 6 de mayo de 2020	-19,74%	-29,48%	-2,22%	-1,53%	46,87%	47,45%
IEH	MSCI Emerging Markets		-19,74%	-36,03%	-2,22%	-9,54%	18,69%	32,58%
IU	MSCI Emerging Markets		-19,74%	-33,81%	-2,22%	-8,48%	18,69%	34,94%
XU	MSCI Emerging Markets	Rendimiento desde su lanzamiento el 17 de marzo de 2022	-8,81%	-14,47%	n/d	n/d	n/d	n/d
ZU	MSCI Emerging Markets		-19,74%	-33,87%	-2,22%	-8,57%	18,69%	34,80%
1E	MSCI Emerging Markets		-19,74%	-30,04%	-2,22%	-2,27%	18,69%	22,86%
1U	MSCI Emerging Markets		-19,74%	-34,34%	-2,22%	-9,17%	18,69%	33,92%
2E	MSCI Emerging Markets		-19,74%	-29,61%	-2,22%	-1,68%	18,69%	23,61%
2U	MSCI Emerging Markets		-19,74%	-33,94%	-2,22%	-8,60%	18,69%	34,80%
8E	MSCI Emerging Markets		-19,74%	-29,66%	-2,22%	-1,71%	18,69%	23,56%
8U	MSCI Emerging Markets		-19,74%	-33,97%	-2,22%	-8,65%	18,69%	34,69%
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income								
AEC	MSCI AC World		-17,96%	-15,94%	19,04%	14,84%	16,82%	1,52%
AUP	MSCI AC World		-17,96%	-13,10%	19,04%	16,13%	16,82%	3,23%
DEC	MSCI AC World		-17,96%	-16,44%	19,04%	14,27%	16,82%	0,97%
DUP	MSCI AC World		-17,96%	-13,48%	19,04%	15,58%	16,82%	2,71%
IU	MSCI AC World		-17,96%	-12,30%	19,04%	17,04%	16,82%	4,09%
TE	MSCI AC World		-17,96%	-6,62%	19,04%	25,75%	16,82%	-4,66%
ZU	MSCI AC World		-17,96%	-12,43%	19,04%	16,99%	16,82%	4,02%
1E	MSCI AC World		-17,96%	-7,23%	19,04%	25,12%	16,82%	-5,14%
1EP	MSCI AC World		-17,96%	-7,24%	19,04%	25,12%	16,82%	-5,14%
1SC	MSCI AC World		-17,96%	-13,77%	19,04%	15,95%	16,82%	2,22%
1SH	MSCI AC World		-17,96%	-13,79%	19,04%	15,95%	16,82%	2,18%
1ST	MSCI AC World		-17,96%	-13,79%	19,04%	15,98%	16,82%	2,19%
1U	MSCI AC World		-17,96%	-12,94%	19,04%	16,29%	16,82%	3,40%
1UP	MSCI AC World		-17,96%	-12,94%	19,04%	16,29%	16,82%	3,40%
1VT	MSCI AC World		-17,96%	-14,93%	19,04%	15,25%	16,82%	0,40%
2E	MSCI AC World		-17,96%	-6,67%	19,04%	25,88%	16,82%	-4,56%
2EP	MSCI AC World		-17,96%	-6,63%	19,04%	25,84%	16,82%	-4,53%
2U	MSCI AC World		-17,96%	-12,41%	19,04%	17,00%	16,82%	4,04%
2UP	MSCI AC World		-17,96%	-12,37%	19,04%	17,03%	16,82%	4,03%
3E	MSCI AC World		-17,96%	-6,54%	19,04%	26,06%	16,82%	-4,43%
3EP	MSCI AC World		-17,96%	-6,55%	19,04%	26,06%	16,82%	-4,42%
3U	MSCI AC World		-17,96%	-12,29%	19,04%	17,16%	16,82%	4,18%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

			31 de diciembre de 2022	31 de diciembre de 2021	31 de diciembre de 2020			
Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income								
(continuación)								
3UP	MSCI AC World		-17,96%	-12,28%	19,04%	17,16%	16,82%	4,18%
8E	MSCI AC World		-17,96%	-6,70%	19,04%	25,83%	16,82%	-4,60%
8EP	MSCI AC World		-17,96%	-6,74%	19,04%	25,83%	16,82%	-4,63%
8U	MSCI AC World		-17,96%	-12,44%	19,04%	16,95%	16,82%	3,99%
8UP	MSCI AC World		-17,96%	-12,44%	19,04%	16,95%	16,82%	3,99%
9E	MSCI AC World		-17,96%	-6,47%	19,04%	26,09%	16,82%	-4,33%
9EP	MSCI AC World		-17,96%	-6,46%	19,04%	26,10%	16,82%	-4,31%
9U	MSCI AC World		-17,96%	-12,21%	19,04%	17,22%	16,82%	4,33%
9UP	MSCI AC World		-17,96%	-12,19%	19,04%	17,31%	16,82%	4,27%
Threadneedle (Lux) - Global Select								
IU	MSCI AC World		-17,96%	-25,08%	19,04%	13,86%	16,82%	21,20%
ZU	MSCI AC World		-17,96%	-25,14%	19,04%	13,80%	16,82%	21,08%
1E	MSCI AC World		-17,96%	-20,79%	19,04%	21,61%	16,82%	10,40%
1U	MSCI AC World		-17,96%	-25,66%	19,04%	13,03%	16,82%	20,34%
2E	MSCI AC World		-17,96%	-20,26%	19,04%	22,39%	16,82%	11,10%
2U	MSCI AC World		-17,96%	-25,20%	19,04%	13,72%	16,82%	21,07%
3U	MSCI AC World		-17,96%	-25,08%	19,04%	13,91%	16,82%	21,28%
8E	MSCI AC World		-17,96%	-20,33%	19,04%	22,31%	16,82%	11,03%
8U	MSCI AC World		-17,96%	-25,23%	19,04%	13,67%	16,82%	21,03%
9U	MSCI AC World		-17,96%	-25,04%	19,04%	13,96%	16,82%	21,33%
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies								
AE	MSCI World Small Cap		-13,02%	-30,73%	25,00%	22,14%	6,85%	27,53%
AEP	MSCI World Small Cap		-13,02%	-30,73%	25,00%	22,14%	6,85%	27,53%
AK	MSCI World Small Cap	Rendimiento desde su lanzamiento el 10 de enero de 2020	-13,02%	-25,18%	25,00%	25,15%	5,98%	19,04%
AUP	MSCI World Small Cap		-13,02%	-34,99%	25,00%	13,53%	6,85%	39,00%
DE	MSCI World Small Cap		-13,02%	-31,07%	25,00%	21,53%	6,85%	26,89%
IE	MSCI World Small Cap		-13,02%	-30,14%	25,00%	23,19%	6,85%	28,62%
IEP	MSCI World Small Cap	Rendimiento desde su lanzamiento el 29 de julio de 2020	-13,02%	-30,14%	25,00%	23,19%	22,69%	25,47%
NE	MSCI World Small Cap		-13,02%	-30,00%	25,00%	23,43%	6,85%	28,88%
XE	MSCI World Small Cap		-13,02%	-29,58%	25,00%	24,17%	6,85%	29,65%
XFH	MSCI World Small Cap	Rendimiento desde su lanzamiento el 11 de noviembre de 2020	-13,02%	-29,72%	25,00%	23,86%	8,50%	9,06%
XG	MSCI World Small Cap		-13,02%	-25,51%	25,00%	16,50%	6,85%	36,89%
XGH	MSCI World Small Cap		-13,02%	-28,82%	25,00%	24,53%	6,85%	28,85%
XU	MSCI World Small Cap	Rendimiento desde su lanzamiento el 11 de noviembre de 2020	-13,02%	-33,91%	25,00%	15,41%	8,50%	12,89%
ZE	MSCI World Small Cap		-13,02%	-30,21%	25,00%	23,06%	6,85%	28,49%
ZFH	MSCI World Small Cap		-13,02%	-30,44%	25,00%	22,60%	6,85%	28,16%
ZG	MSCI World Small Cap		-13,02%	-26,25%	25,00%	15,43%	6,85%	35,73%
ZGH	MSCI World Small Cap		-13,02%	-29,52%	25,00%	23,29%	6,85%	27,70%
ZU	MSCI World Small Cap		-13,02%	-34,50%	25,00%	14,38%	6,85%	40,06%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

			31 de diciembre de 2022	31 de diciembre de 2021	31 de diciembre de 2020			
Clase de			Índice de	Rendimiento	Índice de	Rendimiento	Índice de	Rendimiento
Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	referencia	de la cartera	referencia	de la cartera	referencia	de la cartera
Threadneedle (Lux) - American								
AEH	S&P 500		-18,11%	-23,95%	28,71%	23,73%	18,40%	18,60%
AU	S&P 500		-18,11%	-21,30%	28,71%	24,99%	18,40%	20,51%
DEH	S&P 500		-18,11%	-24,26%	28,71%	23,30%	18,40%	18,17%
DU	S&P 500		-18,11%	-21,58%	28,71%	24,56%	18,40%	20,08%
IEH	S&P 500		-18,11%	-23,32%	28,71%	24,85%	18,40%	19,66%
IU	S&P 500		-18,11%	-20,59%	28,71%	26,12%	18,40%	21,59%
W	S&P 500		-18,11%	-21,07%	28,71%	25,37%	18,40%	20,87%
ZE	S&P 500		-18,11%	-15,51%	28,71%	35,57%	18,40%	11,43%
ZEH	S&P 500		-18,11%	-23,37%	28,71%	24,73%	18,40%	19,56%
ZU	S&P 500		-18,11%	-20,75%	28,71%	26,02%	18,40%	21,42%
1E	S&P 500		-18,11%	-16,04%	28,71%	34,66%	18,40%	10,70%
1EH	S&P 500		-18,11%	-23,87%	28,71%	23,90%	18,40%	18,71%
1EP	S&P 500		-18,11%	-16,04%	28,71%	34,65%	18,40%	10,70%
1U	S&P 500		-18,11%	-21,20%	28,71%	25,15%	18,40%	20,66%
2E	S&P 500		-18,11%	-15,52%	28,71%	35,48%	18,40%	11,37%
2U	S&P 500		-18,11%	-20,72%	28,71%	25,92%	18,40%	21,40%
3EH	S&P 500		-18,11%	-23,29%	28,71%	24,90%	18,40%	19,63%
3U	S&P 500		-18,11%	-20,58%	28,71%	26,15%	18,40%	21,62%
8E	S&P 500		-18,11%	-15,56%	28,71%	35,43%	18,40%	11,33%
8U	S&P 500		-18,11%	-20,75%	28,71%	25,87%	18,40%	21,35%
9EH	S&P 500		-18,11%	-23,27%	28,71%	24,99%	18,40%	19,78%
9U	S&P 500		-18,11%	-20,54%	28,71%	26,20%	18,40%	21,67%
Threadneedle (Lux) - American Select								
AD	S&P 500		-18,11%	-19,29%	28,71%	29,73%	18,40%	13,52%
AEH	S&P 500		-18,11%	-26,87%	28,71%	19,50%	18,40%	22,24%
AN	S&P 500		-18,11%	-15,37%	28,71%	24,30%	18,40%	21,04%
AU	S&P 500		-18,11%	-24,19%	28,71%	20,68%	18,40%	24,22%
DEH	S&P 500		-18,11%	-27,38%	28,71%	18,57%	18,40%	21,33%
DU	S&P 500		-18,11%	-24,76%	28,71%	19,78%	18,40%	23,29%
ID	S&P 500		-18,11%	-18,57%	28,71%	30,76%	18,40%	14,42%
IE	S&P 500		-18,11%	-18,58%	28,71%	30,84%	18,40%	14,82%
IEH	S&P 500		-18,11%	-26,26%	28,71%	20,45%	18,40%	23,20%
IN	S&P 500		-18,11%	-14,62%	28,71%	25,26%	18,40%	21,96%
W	S&P 500		-18,11%	-24,15%	28,71%	20,74%	18,40%	24,28%
ZEH	S&P 500		-18,11%	-26,40%	28,71%	20,30%	18,40%	23,14%
ZU	S&P 500		-18,11%	-23,66%	28,71%	21,52%	18,40%	25,09%
1E	S&P 500		-18,11%	-19,12%	28,71%	30,01%	18,40%	14,11%
1EH	S&P 500		-18,11%	-26,76%	28,71%	19,66%	18,40%	22,39%
1EP	S&P 500		-18,11%	-19,12%	28,71%	30,00%	18,40%	14,11%
1U	S&P 500		-18,11%	-24,09%	28,71%	20,83%	18,40%	24,38%
2EH	S&P 500		-18,11%	-26,31%	28,71%	20,44%	18,40%	23,19%
2U	S&P 500		-18,11%	-23,63%	28,71%	21,59%	18,40%	25,16%
3E	S&P 500		-18,11%	-18,47%	28,71%	31,05%	18,40%	15,02%
3U	S&P 500		-18,11%	-23,48%	28,71%	21,80%	18,40%	25,37%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

			31 de diciembre de 2022	31 de diciembre de 2021	31 de diciembre de 2020			
Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - American Select								
(continuación)								
8EH	S&P 500		-18,11%	-26,33%	28,71%	20,29%	18,40%	23,12%
8U	S&P 500		-18,11%	-23,66%	28,71%	21,52%	18,40%	25,09%
9E	S&P 500		-18,11%	-18,46%	28,71%	31,17%	18,40%	15,12%
9U	S&P 500		-18,11%	-23,45%	28,71%	21,87%	18,40%	25,46%
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies								
AEH	Russell 2500		-18,37%	-20,84%	18,18%	22,12%	19,99%	28,44%
ASH	Russell 2500	Rendimiento desde su lanzamiento el 27 de abril de 2022	-6,16%	-7,59%	n/d	n/d	n/d	n/d
AU	Russell 2500		-18,37%	-18,04%	18,18%	23,60%	19,99%	30,64%
DEH	Russell 2500		-18,37%	-21,28%	18,18%	21,51%	19,99%	27,81%
DU	Russell 2500		-18,37%	-18,45%	18,18%	22,99%	19,99%	30,06%
IE	Russell 2500		-18,37%	-11,93%	18,18%	34,11%	19,99%	20,86%
IU	Russell 2500		-18,37%	-17,35%	18,18%	24,66%	19,99%	31,79%
ZU	Russell 2500		-18,37%	-17,43%	18,18%	24,54%	19,99%	31,71%
1E	Russell 2500		-18,37%	-12,57%	18,18%	33,15%	19,99%	20,05%
1EP	Russell 2500		-18,37%	-12,57%	18,18%	33,14%	19,99%	20,06%
1U	Russell 2500		-18,37%	-17,95%	18,18%	23,75%	19,99%	30,86%
2U	Russell 2500		-18,37%	-17,44%	18,18%	24,51%	19,99%	31,66%
3EH	Russell 2500		-18,37%	-19,99%	18,18%	23,19%	19,99%	29,63%
3U	Russell 2500		-18,37%	-17,33%	18,18%	24,68%	19,99%	31,84%
8U	Russell 2500		-18,37%	-17,48%	18,18%	24,46%	19,99%	31,61%
9EH	Russell 2500		-18,37%	-20,13%	18,18%	23,20%	19,99%	29,69%
9U	Russell 2500		-18,37%	-17,30%	18,18%	24,73%	19,99%	31,89%
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity								
AE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-19,96%	-2,65%	-0,40%	22,75%	13,91%
AF	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-23,81%	-2,65%	-4,62%	22,75%	13,34%
AS	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-25,26%	-2,65%	-5,58%	22,75%	21,97%
ASH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-25,75%	-2,65%	-7,80%	22,75%	22,68%
AU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-24,88%	-2,65%	-7,43%	22,75%	24,14%
DE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-20,55%	-2,65%	-1,14%	22,75%	13,04%
IF	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-22,96%	-2,65%	-3,76%	22,75%	14,26%
ISH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-25,04%	-2,65%	-7,00%	22,75%	23,72%
IU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-24,23%	-2,65%	-6,64%	22,75%	25,20%
XU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-23,63%	-2,65%	-5,89%	22,75%	26,21%
XUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-23,63%	-2,65%	-5,89%	22,75%	26,21%
ZE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-19,40%	-2,65%	0,35%	22,75%	14,75%
ZEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-26,72%	-2,65%	-7,83%	22,75%	22,88%
ZF	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-23,20%	-2,65%	-3,87%	22,75%	14,21%
ZG	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-14,83%	-2,65%	-5,85%	22,75%	21,19%
ZU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-24,31%	-2,65%	-6,73%	22,75%	25,08%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

			31 de diciembre de 2022	31 de diciembre de 2021	31 de diciembre de 2020			
Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - Asia Equities								
AE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 10 de junio de 2021	-17,19%	-19,62%	-8,64%	-3,78%	n/d	n/d
AEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 10 de junio de 2021	-17,19%	-26,93%	-8,64%	-10,74%	n/d	n/d
DE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 10 de junio de 2021	-17,19%	-20,00%	-8,64%	-4,02%	n/d	n/d
DEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 10 de junio de 2021	-17,19%	-27,28%	-8,64%	-10,98%	n/d	n/d
IE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-18,82%	-2,65%	2,96%	22,75%	17,53%
IU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-23,81%	-2,65%	-4,31%	22,75%	28,11%
ZU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-23,89%	-2,65%	-4,40%	22,75%	27,99%
1E	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-19,43%	-2,65%	2,19%	22,75%	16,65%
1U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-24,38%	-2,65%	-5,02%	22,75%	27,15%
2E	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-18,89%	-2,65%	2,82%	22,75%	17,36%
2U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-23,92%	-2,65%	-4,44%	22,75%	27,93%
3U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-23,81%	-2,65%	-4,31%	22,75%	28,11%
8E	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-18,97%	-2,65%	2,78%	22,75%	17,25%
8U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-23,95%	-2,65%	-4,48%	22,75%	27,88%
9U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-23,78%	-2,65%	-4,27%	22,75%	28,16%
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities								
AEC	S&P 500		-18,11%	-22,47%	28,71%	20,75%	18,40%	18,72%
AEH	S&P 500		-18,11%	-22,43%	28,71%	20,75%	18,40%	18,55%
AU	S&P 500		-18,11%	-19,79%	28,71%	22,01%	18,40%	20,48%
AUP	S&P 500		-18,11%	-19,79%	28,71%	22,01%	18,40%	20,48%
DU	S&P 500		-18,11%	-20,19%	28,71%	21,40%	18,40%	19,88%
IU	S&P 500		-18,11%	-19,15%	28,71%	22,99%	18,40%	21,45%
XS	S&P 500		-18,11%	-18,79%	28,71%	26,59%	18,40%	20,54%
XSH	S&P 500		-18,11%	-19,24%	28,71%	23,81%	18,40%	21,24%
ZEH	S&P 500		-18,11%	-21,85%	28,71%	21,65%	18,40%	19,39%
ZFH	S&P 500		-18,11%	-21,90%	28,71%	21,29%	18,40%	19,27%
ZGH	S&P 500		-18,11%	-21,03%	28,71%	22,11%	18,40%	18,83%
ZU	S&P 500		-18,11%	-19,19%	28,71%	22,93%	18,40%	21,39%
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities								
AE	S&P 500		-18,11%	-14,00%	28,71%	43,84%	18,40%	-0,94%
AEH	S&P 500		-18,11%	-21,86%	28,71%	32,34%	18,40%	6,15%
AU	S&P 500		-18,11%	-19,23%	28,71%	33,69%	18,40%	7,97%
AUP	S&P 500		-18,11%	-19,21%	28,71%	33,70%	18,40%	7,97%
DE	S&P 500		-18,11%	-14,17%	28,71%	43,55%	18,40%	-1,14%
DEH	S&P 500		-18,11%	-22,02%	28,71%	32,08%	18,40%	5,98%
DU	S&P 500		-18,11%	-19,45%	28,71%	33,42%	18,40%	7,76%
IE	S&P 500		-18,11%	-13,73%	28,71%	44,35%	18,40%	-0,64%
IEC	S&P 500		-18,11%	-21,68%	28,71%	32,81%	18,40%	6,54%
IEH	S&P 500		-18,11%	-21,69%	28,71%	32,84%	18,40%	6,50%
IFH	S&P 500		-18,11%	-21,68%	28,71%	32,50%	18,40%	6,38%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de			31 de diciembre de 2022	31 de diciembre de 2021	31 de diciembre de 2020		
Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	Índice de Rendimiento referencia de la cartera	Índice de Rendimiento referencia de la cartera	Índice de Rendimiento referencia de la cartera	Índice de Rendimiento referencia de la cartera	Índice de Rendimiento referencia de la cartera
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities							
<i>(continuación)</i>							
IG	S&P 500		-18,11%	-8,80%	28,71%	35,45%	18,40%
IU	S&P 500		-18,11%	-19,03%	28,71%	34,19%	18,40%
NE	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de septiembre de 2020	-18,11%	-13,50%	28,71%	44,70%	12,39%
NG	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de septiembre de 2020	-18,11%	-8,67%	28,71%	35,62%	12,39%
NU	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 18 de septiembre de 2020	-18,11%	-18,88%	28,71%	34,41%	12,39%
XG	S&P 500	Rendimiento desde su lanzamiento el 20 de mayo de 2020	-18,11%	-8,56%	28,71%	35,73%	29,86%
ZEH	S&P 500		-18,11%	-21,75%	28,71%	32,69%	18,40%
ZFH	S&P 500		-18,11%	-21,69%	28,71%	32,38%	18,40%
ZU	S&P 500		-18,11%	-19,09%	28,71%	34,02%	18,40%
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities							
AE	MSCI Europe		-8,92%	-18,93%	25,85%	28,58%	-2,82%
ASH	MSCI Europe		-8,92%	-17,14%	25,85%	29,32%	-2,82%
AUH	MSCI Europe		-8,92%	-16,35%	25,85%	29,60%	-2,82%
DE	MSCI Europe		-8,92%	-19,09%	25,85%	28,32%	-2,82%
IE	MSCI Europe		-8,92%	-18,32%	25,85%	29,55%	-2,82%
W	MSCI Europe		-8,92%	-19,06%	25,85%	28,32%	-2,82%
XE	MSCI Europe		-8,92%	-17,75%	25,85%	30,39%	-2,82%
ZE	MSCI Europe	Rendimiento desde su lanzamiento el 15 de julio de 2021	-8,92%	-18,50%	6,81%	9,50%	n/d
ZUH	MSCI Europe		-8,92%	-15,90%	25,85%	30,33%	-2,82%
1E	MSCI Europe		-8,92%	-18,93%	25,85%	28,61%	-2,82%
1EP	MSCI Europe		-8,92%	-18,94%	25,85%	28,57%	-2,82%
1G	MSCI Europe		-8,92%	-14,34%	25,85%	20,63%	-2,82%
1GP	MSCI Europe		-8,92%	-14,30%	25,85%	20,59%	-2,82%
2E	MSCI Europe		-8,92%	-18,57%	25,85%	29,19%	-2,82%
2G	MSCI Europe		-8,92%	-13,95%	25,85%	21,18%	-2,82%
2U	MSCI Europe		-8,92%	-23,52%	25,85%	20,14%	-2,82%
3E	MSCI Europe		-8,92%	-18,45%	25,85%	29,36%	-2,82%
3G	MSCI Europe		-8,92%	-13,83%	25,85%	21,35%	-2,82%
3GP	MSCI Europe		-8,92%	-13,81%	25,85%	21,38%	-2,82%
4E	MSCI Europe		-8,92%	-17,75%	25,85%	30,48%	-2,82%
4G	MSCI Europe		-8,92%	-13,06%	25,85%	22,45%	-2,82%
8E	MSCI Europe		-8,92%	-18,60%	25,85%	29,13%	-2,82%
8G	MSCI Europe		-8,92%	-13,98%	25,85%	21,13%	-2,82%
8U	MSCI Europe		-8,92%	-23,55%	25,85%	20,13%	-2,82%
9E	MSCI Europe		-8,92%	-18,40%	25,85%	29,42%	-2,82%
9G	MSCI Europe		-8,92%	-13,79%	25,85%	21,38%	-2,82%
9GP	MSCI Europe		-8,92%	-13,75%	25,85%	21,39%	-2,82%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

			31 de diciembre de 2022	31 de diciembre de 2021	31 de diciembre de 2020			
Clase de			Índice de	Rendimiento	Índice de	Rendimiento	Índice de	Rendimiento
Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	referencia	de la cartera	referencia	de la cartera	referencia	de la cartera
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend								
AE	MSCI Europe		-8,92%	-16,35%	25,85%	20,28%	-2,82%	0,02%
AEP	MSCI Europe		-8,92%	-16,35%	25,85%	20,27%	-2,82%	0,05%
AUP	MSCI Europe		-8,92%	-21,57%	25,85%	11,75%	-2,82%	8,99%
DE	MSCI Europe		-8,92%	-16,65%	25,85%	19,85%	-2,82%	-0,35%
DEP	MSCI Europe		-8,92%	-16,65%	25,85%	19,85%	-2,82%	-0,32%
IE	MSCI Europe		-8,92%	-15,39%	25,85%	21,42%	-2,82%	0,86%
IEP	MSCI Europe		-8,92%	-15,39%	25,85%	21,42%	-2,82%	0,89%
ZE	MSCI Europe		-8,92%	-15,81%	25,85%	21,18%	-2,82%	0,80%
ZEP	MSCI Europe		-8,92%	-15,72%	25,85%	21,18%	-2,82%	0,76%
1E	MSCI Europe		-8,92%	-16,27%	25,85%	20,39%	-2,82%	0,15%
1EP	MSCI Europe		-8,92%	-16,27%	25,85%	20,38%	-2,82%	0,15%
1G	MSCI Europe		-8,92%	-11,52%	25,85%	12,93%	-2,82%	5,79%
1GP	MSCI Europe		-8,92%	-11,53%	25,85%	12,92%	-2,82%	5,78%
2E	MSCI Europe		-8,92%	-15,76%	25,85%	21,13%	-2,82%	0,76%
2EP	MSCI Europe		-8,92%	-15,71%	25,85%	21,24%	-2,82%	0,78%
2G	MSCI Europe		-8,92%	-10,94%	25,85%	13,71%	-2,82%	6,50%
2GP	MSCI Europe		-8,92%	-10,94%	25,85%	13,72%	-2,82%	6,48%
3EP	MSCI Europe		-8,92%	-15,64%	25,85%	21,30%	-2,82%	0,90%
3G	MSCI Europe		-8,92%	-10,85%	25,85%	13,77%	-2,82%	6,59%
3GP	MSCI Europe		-8,92%	-10,87%	25,85%	13,78%	-2,82%	6,58%
4GP	MSCI Europe		-8,92%	-10,10%	25,85%	14,76%	-2,82%	7,50%
8E	MSCI Europe		-8,92%	-15,79%	25,85%	21,08%	-2,82%	0,72%
8EP	MSCI Europe		-8,92%	-15,80%	25,85%	21,08%	-2,82%	0,71%
8G	MSCI Europe		-8,92%	-11,02%	25,85%	13,57%	-2,82%	6,40%
8GP	MSCI Europe		-8,92%	-11,02%	25,85%	13,57%	-2,82%	6,38%
9EP	MSCI Europe		-8,92%	-15,54%	25,85%	21,37%	-2,82%	1,04%
9G	MSCI Europe		-8,92%	-10,81%	25,85%	13,83%	-2,82%	6,65%
9GP	MSCI Europe		-8,92%	-10,78%	25,85%	13,78%	-2,82%	6,69%
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities								
AE	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-35,76%	23,41%	22,58%	7,78%	13,08%
ASH	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-34,25%	23,41%	23,34%	7,78%	13,61%
AUH	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-33,53%	23,41%	23,69%	7,78%	14,73%
DE	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-36,33%	23,41%	21,48%	7,78%	12,07%
DUH	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-34,16%	23,41%	22,60%	7,78%	13,74%
IE	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-35,27%	23,41%	23,50%	7,78%	13,93%
W	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-35,79%	23,41%	22,52%	7,78%	13,03%
XE	EMIX Smaller European Companies	Rendimiento desde su lanzamiento el 25 de febrero de 2022.	-10,26%	-14,98%	n/d	n/d	n/d	n/d
ZE	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-35,27%	23,41%	23,50%	7,78%	13,93%
ZFH	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-35,41%	23,41%	23,07%	7,78%	13,72%
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies								
IE	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-34,00%	23,41%	20,83%	7,78%	9,80%
ZE	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-34,10%	23,41%	20,65%	7,78%	9,63%
1E	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-34,51%	23,41%	19,91%	7,78%	8,96%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

			31 de diciembre de 2022	31 de diciembre de 2021	31 de diciembre de 2020			
Clase de			Índice de	Índice de	Índice de			
Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	referencia de la cartera	referencia de la cartera	referencia de la cartera			
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies (continuación)								
1EP	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-34,51%	23,41%	19,91%	7,78%	8,96%
1FH	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-34,62%	23,41%	19,48%	7,78%	8,77%
1G	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-30,79%	23,41%	12,47%	7,78%	15,10%
1UH	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-32,25%	23,41%	20,95%	7,78%	10,56%
2E	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-34,08%	23,41%	20,69%	7,78%	9,67%
2G	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-30,36%	23,41%	13,25%	7,78%	15,91%
3E	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-33,97%	23,41%	20,88%	7,78%	9,84%
3EP	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-33,97%	23,41%	20,88%	7,78%	9,84%
3FH	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-34,09%	23,41%	20,44%	7,78%	9,65%
3G	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-30,23%	23,41%	13,39%	7,78%	16,03%
3GP	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-30,23%	23,41%	13,39%	7,78%	16,02%
3UH	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-31,70%	23,41%	21,93%	7,78%	11,45%
4E	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-33,42%	23,41%	21,90%	7,78%	10,77%
4G	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-29,64%	23,41%	14,34%	7,78%	17,01%
8E	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-34,11%	23,41%	20,64%	7,78%	9,62%
8G	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-30,37%	23,41%	13,16%	7,78%	15,80%
9E	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-33,95%	23,41%	20,93%	7,78%	9,89%
9EP	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-33,88%	23,41%	20,99%	7,78%	9,99%
9FH	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-34,06%	23,41%	20,47%	7,78%	9,72%
9G	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-30,20%	23,41%	13,43%	7,78%	16,08%
9GP	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-30,11%	23,41%	13,48%	7,78%	16,16%
9UH	EMIX Smaller European Companies		-22,89%	-31,67%	23,41%	21,99%	7,78%	11,48%
Threadneedle (Lux) - European Select								
AE	FTSE World Europe ex UK		-11,97%	-22,44%	25,16%	25,17%	2,83%	8,47%
AGH	FTSE World Europe ex UK		-11,97%	-21,55%	25,16%	25,60%	2,83%	8,30%
AUH	FTSE World Europe ex UK		-11,97%	-19,94%	25,16%	26,16%	2,83%	9,89%
DUH	FTSE World Europe ex UK		-11,97%	-20,38%	25,16%	25,49%	2,83%	9,28%
IE	FTSE World Europe ex UK		-11,97%	-21,78%	25,16%	26,23%	2,83%	9,40%
ZE	FTSE World Europe ex UK	Rendimiento desde su lanzamiento el 14 de octubre de 2021	-11,97%	-21,93%	6,24%	5,96%	n/d	n/d
ZG	FTSE World Europe ex UK		-11,97%	-17,42%	25,16%	18,29%	2,83%	15,45%
ZGH	FTSE World Europe ex UK		-11,97%	-20,94%	25,16%	26,53%	2,83%	9,08%
1E	FTSE World Europe ex UK		-11,97%	-22,32%	25,16%	25,35%	2,83%	8,63%
1EP	FTSE World Europe ex UK		-11,97%	-22,32%	25,16%	25,35%	2,83%	8,63%
1SH	FTSE World Europe ex UK		-11,97%	-20,58%	25,16%	26,12%	2,83%	9,20%
1U	FTSE World Europe ex UK		-11,97%	-27,10%	25,16%	16,51%	2,83%	18,41%
1UH	FTSE World Europe ex UK		-11,97%	-19,79%	25,16%	26,35%	2,83%	10,09%
2E	FTSE World Europe ex UK		-11,97%	-21,86%	25,16%	26,09%	2,83%	9,28%
2EP	FTSE World Europe ex UK		-11,97%	-21,84%	25,16%	26,12%	2,83%	9,35%
3E	FTSE World Europe ex UK		-11,97%	-21,72%	25,16%	26,32%	2,83%	9,47%
3U	FTSE World Europe ex UK		-11,97%	-26,54%	25,16%	17,41%	2,83%	19,33%
8E	FTSE World Europe ex UK		-11,97%	-21,89%	25,16%	26,04%	2,83%	9,23%
8EP	FTSE World Europe ex UK		-11,97%	-21,89%	25,16%	26,04%	2,83%	9,23%
9E	FTSE World Europe ex UK		-11,97%	-21,69%	25,16%	26,37%	2,83%	9,52%
9U	FTSE World Europe ex UK		-11,97%	-26,50%	25,16%	17,50%	2,83%	19,47%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

			31 de diciembre de 2022	31 de diciembre de 2021	31 de diciembre de 2020			
Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies								
IE	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57%	-29,90%	23,02%	22,87%	12,55%	14,97%
ZE	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57%	-30,00%	23,02%	22,69%	12,55%	14,80%
1E	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57%	-30,44%	23,02%	21,93%	12,55%	14,09%
1EP	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57%	-30,44%	23,02%	21,93%	12,55%	14,09%
1FH	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57%	-30,53%	23,02%	21,45%	12,55%	13,84%
2E	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57%	-29,98%	23,02%	22,73%	12,55%	14,83%
3E	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57%	-29,88%	23,02%	22,90%	12,55%	14,99%
3EP	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57%	-29,88%	23,02%	22,90%	12,55%	14,99%
3FH	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57%	-30,03%	23,02%	22,41%	12,55%	14,74%
8E	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57%	-30,01%	23,02%	22,68%	12,55%	14,78%
9E	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57%	-29,86%	23,02%	22,95%	12,55%	15,04%
9EP	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57%	-29,86%	23,02%	22,95%	12,55%	15,04%
9FH	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57%	-30,02%	23,02%	22,45%	12,55%	14,77%
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income								
AEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-19,13%	-2,65%	0,42%	22,75%	21,55%
AU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-16,48%	-2,65%	1,49%	22,75%	23,68%
AUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-16,48%	-2,65%	1,49%	22,75%	23,68%
DEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-19,69%	-2,65%	-0,34%	22,75%	20,64%
DU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-17,10%	-2,65%	0,74%	22,75%	22,76%
DUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-17,10%	-2,65%	0,74%	22,75%	22,76%
IEP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-10,26%	-2,65%	10,12%	22,75%	14,36%
IU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-15,73%	-2,65%	2,29%	22,75%	24,68%
W	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-16,65%	-2,65%	1,29%	22,75%	23,43%
XU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-15,09%	-2,65%	3,18%	22,75%	25,74%
XUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-15,09%	-2,65%	3,18%	22,75%	25,74%
ZG	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-5,37%	-2,65%	3,16%	22,75%	20,82%
ZGH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-17,58%	-2,65%	1,50%	22,75%	21,94%
ZGP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-5,39%	-2,65%	3,16%	22,75%	20,76%
ZU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Rendimiento desde su lanzamiento el 11 de noviembre de 2021	-17,19%	-15,93%	-2,63%	1,62%	n/d	n/d
ZUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19%	-15,85%	-2,65%	2,26%	22,75%	24,61%
Threadneedle (Lux) - Global Technology								
AEH	MSCI World Information Technology		-30,60%	-34,58%	30,15%	36,06%	44,26%	40,63%
AS	MSCI World Information Technology		-30,60%	-32,40%	30,15%	40,24%	44,26%	40,53%
AU	MSCI World Information Technology		-30,60%	-32,05%	30,15%	37,48%	44,26%	42,98%
AUP	MSCI World Information Technology		-30,60%	-32,05%	30,15%	37,48%	44,26%	42,98%
BU	MSCI World Information Technology		-30,60%	-32,32%	30,15%	36,93%	44,26%	42,41%
DEH	MSCI World Information Technology		-30,60%	-34,77%	30,15%	35,58%	44,26%	40,18%
DU	MSCI World Information Technology		-30,60%	-32,28%	30,15%	37,00%	44,26%	42,48%
IE	MSCI World Information Technology	Rendimiento desde su lanzamiento el 10 de enero de 2020	-30,60%	-26,94%	30,15%	49,26%	40,01%	27,46%
IEH	MSCI World Information Technology		-30,60%	-34,00%	30,15%	37,27%	44,26%	41,91%
IG	MSCI World Information Technology		-30,60%	-22,79%	30,15%	40,01%	44,26%	39,81%
IU	MSCI World Information Technology	Rendimiento desde su lanzamiento el 10 de enero de 2020	-30,60%	-31,43%	30,15%	38,72%	40,01%	40,48%
ZEH	MSCI World Information Technology		-30,60%	-34,05%	30,15%	37,14%	44,26%	41,73%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

			31 de diciembre de 2022	31 de diciembre de 2021	31 de diciembre de 2020			
Clase de Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Technology								
(continuación)								
ZFH	MSCI World Information Technology		-30,60%	-33,94%	30,15%	36,74%	44,26%	41,68%
ZG	MSCI World Information Technology		-30,60%	-22,87%	30,15%	39,88%	44,26%	39,67%
ZU	MSCI World Information Technology		-30,60%	-31,50%	30,15%	38,58%	44,26%	44,12%
Threadneedle (Lux) - UK Equities								
AE	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 12 de febrero de 2020	0,34%	-11,85%	18,32%	16,67%	-9,32%	-15,31%
AEH	FTSE All Share		0,34%	-8,20%	18,32%	8,76%	-9,82%	-11,08%
AFH	FTSE All Share		0,34%	-8,21%	18,32%	8,55%	-9,82%	-11,06%
AG	FTSE All Share		0,34%	-6,85%	18,32%	9,44%	-9,82%	-11,26%
AGP	FTSE All Share		0,34%	-6,85%	18,32%	9,44%	-9,82%	-11,26%
DEH	FTSE All Share		0,34%	-8,90%	18,32%	7,90%	-9,82%	-11,77%
DG	FTSE All Share		0,34%	-7,59%	18,32%	8,56%	-9,82%	-11,97%
IE	FTSE All Share		0,34%	-11,01%	18,32%	17,84%	-9,82%	-15,11%
IEH	FTSE All Share		0,34%	-7,32%	18,32%	9,79%	-9,82%	-10,24%
IG	FTSE All Share		0,34%	-5,96%	18,32%	10,48%	-9,82%	-10,41%
IGP	FTSE All Share		0,34%	-5,96%	18,32%	10,48%	-9,82%	-10,41%
NEH	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de octubre de 2020	0,34%	-7,06%	18,32%	10,02%	14,13%	18,52%
NFH	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de octubre de 2020	0,34%	-7,10%	18,32%	9,83%	14,13%	18,55%
NG	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de octubre de 2020	0,34%	-5,80%	18,32%	10,72%	14,13%	18,66%
NGP	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de octubre de 2020	0,34%	-5,71%	18,32%	10,75%	14,13%	18,66%
NUH	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de octubre de 2020	0,34%	-4,31%	18,32%	11,11%	14,13%	18,86%
TEH	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de octubre de 2020	0,34%	-7,10%	18,32%	9,99%	14,13%	18,52%
TFH	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de octubre de 2020	0,34%	-7,14%	18,32%	9,77%	14,13%	18,55%
TG	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de octubre de 2020	0,34%	-5,76%	18,32%	10,72%	14,13%	18,66%
TGP	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de octubre de 2020	0,34%	-5,77%	18,32%	10,72%	14,13%	18,66%
TUH	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 28 de octubre de 2020	0,34%	-4,32%	18,32%	11,08%	14,13%	18,86%
ZE	FTSE All Share	Rendimiento desde su lanzamiento el 12 de febrero de 2020	0,34%	-11,21%	18,32%	17,53%	-9,32%	-14,76%
ZEH	FTSE All Share		0,34%	-7,52%	18,32%	9,58%	-9,82%	-10,44%
ZFH	FTSE All Share		0,34%	-7,53%	18,32%	9,39%	-9,82%	-10,43%
ZG	FTSE All Share		0,34%	-6,15%	18,32%	10,26%	-9,82%	-10,59%
ZGP	FTSE All Share		0,34%	-6,15%	18,32%	10,26%	-9,82%	-10,59%
ZUH	FTSE All Share	Estuvo inactivo del 24 de septiembre de 2020 al 20 de noviembre de 2020	0,34%	-4,70%	18,32%	10,65%	2,92%	4,04%
3EH	FTSE All Share		0,34%	-7,35%	18,32%	9,78%	-9,82%	-10,25%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

			31 de diciembre de 2022	31 de diciembre de 2021	31 de diciembre de 2020			
Clase de			Índice de	Rendimiento	Índice de	Rendimiento	Índice de	Rendimiento
Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	referencia	de la cartera	referencia	de la cartera	referencia	de la cartera
Threadneedle (Lux) - UK Equities								
(continuación)								
3FH	FTSE All Share	Rendimiento desde el 24 de noviembre de 2020	0,34%	-7,37%	18,32%	9,60%	2,80%	4,44%
3UH	FTSE All Share		0,34%	-4,58%	18,32%	10,85%	-9,82%	-8,79%
9EH	FTSE All Share		0,34%	-7,24%	18,32%	9,80%	-9,82%	-10,27%
9EP	FTSE All Share		0,34%	-10,99%	18,32%	17,80%	-9,82%	-15,17%
9FH	FTSE All Share		0,34%	-7,33%	18,32%	9,64%	-9,82%	-10,23%
9G	FTSE All Share		0,34%	-5,94%	18,32%	10,50%	-9,82%	-10,40%
9UH	FTSE All Share		0,34%	-4,63%	18,32%	10,89%	-9,82%	-8,85%
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income								
AE	FTSE All Share		0,34%	-8,75%	18,32%	25,96%	-9,82%	-12,97%
AEC	FTSE All Share		0,34%	-4,98%	18,32%	17,40%	-9,82%	-8,16%
AEH	FTSE All Share		0,34%	-4,99%	18,32%	17,39%	-9,82%	-8,19%
AG	FTSE All Share		0,34%	-3,58%	18,32%	18,15%	-9,82%	-8,07%
ASC	FTSE All Share		0,34%	-3,02%	18,32%	18,24%	-9,82%	-7,63%
AUC	FTSE All Share		0,34%	-2,35%	18,32%	18,42%	-9,82%	-6,82%
DE	FTSE All Share		0,34%	-9,43%	18,32%	25,02%	-9,82%	-13,62%
DEC	FTSE All Share		0,34%	-5,68%	18,32%	16,41%	-9,82%	-8,95%
DEH	FTSE All Share		0,34%	-5,69%	18,32%	16,49%	-9,82%	-8,86%
DG	FTSE All Share		0,34%	-4,30%	18,32%	17,27%	-9,82%	-8,76%
DGP	FTSE All Share		0,34%	-4,32%	18,32%	17,15%	-9,82%	-8,79%
IE	FTSE All Share		0,34%	-7,88%	18,32%	27,16%	-9,82%	-12,14%
IEH	FTSE All Share		0,34%	-4,18%	18,32%	18,49%	-9,82%	-7,33%
IG	FTSE All Share		0,34%	-2,66%	18,32%	19,27%	-9,82%	-7,19%
IGP	FTSE All Share		0,34%	-2,66%	18,32%	19,28%	-9,82%	-7,19%
IU	FTSE All Share		0,34%	-13,55%	18,32%	18,18%	-9,82%	-4,23%
IUH	FTSE All Share		0,34%	-1,30%	18,32%	19,70%	-9,82%	-5,72%
LG	FTSE All Share		0,34%	-2,51%	18,32%	19,45%	-9,82%	-7,05%
LGP	FTSE All Share		0,34%	-2,51%	18,32%	19,45%	-9,82%	-7,05%
ZE	FTSE All Share		0,34%	-8,07%	18,32%	26,90%	-9,82%	-12,32%
ZEH	FTSE All Share		0,34%	-4,34%	18,32%	18,22%	-9,82%	-7,49%
ZFH	FTSE All Share		0,34%	-4,41%	18,32%	17,97%	-9,82%	-7,62%
ZG	FTSE All Share		0,34%	-2,85%	18,32%	19,04%	-9,82%	-7,38%
ZGP	FTSE All Share		0,34%	-2,85%	18,32%	19,04%	-9,82%	-7,38%
ZUH	FTSE All Share		0,34%	-1,63%	18,32%	19,33%	-9,82%	-6,85%
1EH	FTSE All Share		0,34%	-4,86%	18,32%	17,55%	-9,82%	-8,07%
1FH	FTSE All Share		0,34%	-4,97%	18,32%	17,27%	-9,82%	-8,17%
1UH	FTSE All Share		0,34%	-2,17%	18,32%	18,62%	-9,82%	-6,65%
3EH	FTSE All Share		0,34%	-4,18%	18,32%	18,43%	-9,82%	-7,32%
3FH	FTSE All Share		0,34%	-4,31%	18,32%	18,17%	-9,82%	-7,46%
3UH	FTSE All Share		0,34%	-1,43%	18,32%	19,53%	-9,82%	-5,91%
9EH	FTSE All Share		0,34%	-4,12%	18,32%	18,50%	-9,82%	-7,29%
9FH	FTSE All Share		0,34%	-4,27%	18,32%	18,14%	-9,82%	-7,44%
9G	FTSE All Share		0,34%	-2,65%	18,32%	19,29%	-9,82%	-7,18%
9UH	FTSE All Share		0,34%	-1,40%	18,32%	19,57%	-9,82%	-5,90%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

			31 de diciembre de 2022		31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020	
Clase de	Nombre del índice de referencia	Comentarios	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity								
IU	MSCI EFM Africa ex-ZA 10/40		n/d	-5,78%	11,30%	0,43%	0,95%	-7,63%
ZU	MSCI EFM Africa ex-ZA 10/40		n/d	-5,78%	11,30%	0,43%	0,95%	-7,63%
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha								
AEH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15%	-10,05%	0,13%	1,63%	0,66%	-1,27%
AFH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15%	-10,30%	0,13%	1,36%	0,66%	-1,50%
AGH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15%	-8,84%	0,13%	2,32%	0,66%	-0,78%
AU	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15%	-8,04%	0,13%	2,61%	0,66%	0,00%
DEH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15%	-10,56%	0,13%	1,13%	0,66%	-1,74%
DU	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15%	-8,50%	0,13%	2,10%	0,66%	-0,51%
IEH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15%	-9,33%	0,13%	2,51%	0,66%	-0,41%
IGH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15%	-8,08%	0,13%	2,92%	0,66%	0,01%
IU	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15%	-7,26%	0,13%	3,23%	0,66%	0,85%
XGH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15%	-7,32%	0,13%	4,04%	0,66%	0,79%
ZE	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15%	-1,30%	0,13%	11,23%	0,66%	-7,50%
ZEH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15%	-9,58%	0,13%	2,40%	0,66%	-0,47%
ZGH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15%	-8,15%	0,13%	3,14%	0,66%	-0,07%
ZU	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15%	-7,36%	0,13%	3,03%	0,66%	0,76%
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities								
AE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor	Rendimiento desde su lanzamiento el 5 de agosto de 2021	-0,11%	-4,47%	-0,24%	-1,02%	n/d	n/d
IE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor	Rendimiento desde su lanzamiento el 5 de agosto de 2021	-0,11%	-3,96%	-0,24%	-0,82%	n/d	n/d
ZE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-4,03%	-0,65%	-0,48%	-0,62%	0,72%
1E	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-4,48%	-0,65%	-0,88%	-0,62%	0,35%
1EP	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-4,48%	-0,65%	-0,88%	-0,62%	0,35%
1GH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-2,99%	-0,65%	-0,36%	-0,62%	0,84%
1UH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-2,78%	-0,65%	-0,17%	-0,62%	1,55%
2E	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-3,90%	-0,65%	-0,27%	-0,62%	0,96%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

Clase de		31 de diciembre de 2022	31 de diciembre de 2021	31 de diciembre de 2020				
Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	Índice de Rendimiento referencia de la cartera	Índice de Rendimiento referencia de la cartera	Índice de Rendimiento referencia de la cartera	Índice de Rendimiento referencia de la cartera		
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities <i>(continuación)</i>								
2EP	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-3,90%	-0,65%	-0,18%	-0,62%	1,05%
2GC	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-2,35%	-0,65%	0,28%	-0,62%	1,55%
2GH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-2,39%	-0,65%	0,26%	-0,62%	1,47%
4GH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-1,91%	-0,65%	0,75%	-0,62%	1,99%
8E	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-3,94%	-0,65%	-0,31%	-0,62%	0,92%
8EP	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-3,94%	-0,65%	-0,31%	-0,62%	0,92%
8GC	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-2,42%	-0,65%	0,25%	-0,62%	1,44%
8GH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-2,41%	-0,65%	0,22%	-0,62%	1,45%
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities								
AE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-4,74%	-0,65%	-1,41%	-0,62%	1,24%
AFH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-5,23%	-0,65%	-1,58%	-0,62%	0,93%
AKH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-4,28%	-0,65%	-1,14%	-0,62%	1,45%
ANH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-3,28%	-0,65%	-0,78%	-0,62%	1,75%
AUH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-3,12%	-0,65%	-0,69%	-0,62%	2,47%
DE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-5,27%	-0,65%	-1,88%	-0,62%	0,67%
IE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-4,13%	-0,65%	-0,70%	-0,62%	1,89%
IEP	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-4,14%	-0,65%	-0,76%	-0,62%	1,68%
IGH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-2,61%	-0,65%	-0,11%	-0,62%	2,38%
INH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-2,52%	-0,65%	-0,09%	-0,62%	2,28%
IU	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-9,97%	-0,65%	-7,81%	-0,62%	11,08%
IUH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-2,48%	-0,65%	-0,05%	-0,62%	3,16%
JE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-4,06%	-0,65%	-0,73%	-0,62%	1,69%
JGH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-2,57%	-0,65%	-0,01%	-0,62%	2,33%
JUH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-2,42%	-0,65%	0,01%	-0,62%	2,97%
LE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-3,99%	-0,65%	-0,57%	-0,62%	2,04%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

			31 de diciembre de 2022	31 de diciembre de 2021	31 de diciembre de 2020		
Clase de			Índice de Rendimiento	Índice de Rendimiento	Índice de Rendimiento		
Acciones	Nombre del índice de referencia	Comentarios	referencia de la cartera	referencia de la cartera	referencia de la cartera		
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities							
<i>(continuación)</i>							
LEP	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-3,82%	-0,65%	-0,56%	-0,62%
LGH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-2,28%	-0,65%	0,12%	-0,62%
XE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor	Rendimiento desde su lanzamiento el 8 de abril de 2020	-0,11%	-3,77%	-0,65%	-0,30%	-0,46%
XGH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-2,25%	-0,65%	0,22%	-0,62%
XUH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor	Rendimiento desde su lanzamiento el 8 de abril de 2020	-0,11%	-2,04%	-0,65%	0,51%	-0,46%
YE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-4,24%	-0,65%	-0,87%	-0,62%
YGH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-2,74%	-0,65%	-0,24%	-0,62%
YUH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-2,58%	-0,65%	-0,21%	-0,62%
ZE	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-4,35%	-0,65%	-0,94%	-0,62%
ZFH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-4,77%	-0,65%	-1,13%	-0,62%
ZGH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-2,83%	-0,65%	-0,31%	-0,62%
ZUH	Compounded euro short-term rate (€STR) average rate, 1 month tenor		-0,11%	-2,59%	-0,65%	-0,24%	-0,62%
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha							
AE	EURIBOR 3M		0,34%	-8,70%	-0,55%	7,41%	-0,43%
AEP	EURIBOR 3M		0,34%	-8,70%	-0,55%	6,49%	-0,43%
AUH	EURIBOR 3M		0,34%	-6,21%	-0,55%	7,97%	-0,43%
DE	EURIBOR 3M		0,34%	-9,16%	-0,55%	6,00%	-0,43%
IE	EURIBOR 3M		0,34%	-7,88%	-0,55%	6,83%	-0,43%
IGH	EURIBOR 3M		0,34%	-6,62%	-0,55%	7,42%	-0,43%
LE	EURIBOR 3M		0,34%	-7,53%	-0,55%	7,00%	-0,43%
XGH	EURIBOR 3M		0,34%	-5,92%	-0,55%	9,16%	-0,43%
ZE	EURIBOR 3M		0,34%	-7,97%	-0,55%	7,37%	-0,43%
ZF	EURIBOR 3M		0,34%	-12,42%	-0,55%	3,39%	-0,43%
ZFH	EURIBOR 3M		0,34%	-8,19%	-0,55%	6,53%	-0,43%
ZGH	EURIBOR 3M		0,34%	-6,84%	-0,55%	8,94%	-0,43%
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha							
AEH	S&P 500		-18,11%	-29,77%	28,71%	23,64%	18,40%
AU	S&P 500		-18,11%	-27,31%	28,71%	24,80%	18,40%
DEH	S&P 500		-18,11%	-30,13%	28,71%	22,95%	18,40%
DU	S&P 500		-18,11%	-27,67%	28,71%	24,18%	18,40%
IU	S&P 500		-18,11%	-26,65%	28,71%	25,93%	18,40%
ZU	S&P 500		-18,11%	-26,83%	28,71%	25,84%	18,40%
1E	S&P 500		-18,11%	-22,46%	28,71%	34,43%	18,40%
1EH	S&P 500		-18,11%	-29,71%	28,71%	23,74%	18,40%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Rendimiento de la clase de acciones (sin auditar)

(continuación)

			31 de diciembre de 2022		31 de diciembre de 2021		31 de diciembre de 2020	
Clase de	Nombre del índice de referencia	Comentarios	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera	Índice de referencia	Rendimiento de la cartera
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha								
<i>(continuación)</i>								
1U	S&P 500		-18,11%	-27,23%	28,71%	24,94%	18,40%	23,52%
2E	S&P 500		-18,11%	-21,79%	28,71%	35,61%	18,40%	14,30%
2U	S&P 500		-18,11%	-26,61%	28,71%	26,14%	18,40%	24,65%
3U	S&P 500		-18,11%	-26,68%	28,71%	25,88%	18,40%	24,45%
8E	S&P 500		-18,11%	-21,82%	28,71%	35,53%	18,40%	14,25%
8U	S&P 500		-18,11%	-26,63%	28,71%	25,97%	18,40%	24,53%
9U	S&P 500		-18,11%	-26,62%	28,71%	26,03%	18,40%	24,48%
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha								
AEH	MSCI AC World		-17,96%	-28,37%	19,04%	7,85%	16,82%	21,19%
AU	MSCI AC World		-17,96%	-25,81%	19,04%	9,02%	16,82%	23,11%
DEH	MSCI AC World		-17,96%	-28,87%	19,04%	7,35%	16,82%	20,47%
DU	MSCI AC World		-17,96%	-26,18%	19,04%	8,48%	16,82%	22,56%
IU	MSCI AC World		-17,96%	-25,14%	19,04%	10,00%	16,82%	24,22%
ZU	MSCI AC World		-17,96%	-25,28%	19,04%	9,92%	16,82%	24,08%
1E	MSCI AC World		-17,96%	-20,86%	19,04%	17,43%	16,82%	13,07%
1U	MSCI AC World		-17,96%	-25,73%	19,04%	9,14%	16,82%	23,25%
2E	MSCI AC World		-17,96%	-20,18%	19,04%	18,52%	16,82%	14,04%
2U	MSCI AC World		-17,96%	-25,09%	19,04%	10,08%	16,82%	24,31%
8E	MSCI AC World		-17,96%	-20,21%	19,04%	18,39%	16,82%	13,99%
8U	MSCI AC World		-17,96%	-25,12%	19,04%	10,04%	16,82%	24,26%
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities								
AEH	Bloomberg Commodity Index		16,09%	14,13%	27,11%	22,67%	-3,12%	-3,93%
AFH	Bloomberg Commodity Index		16,09%	13,46%	27,11%	22,48%	-3,12%	-4,10%
AGH	Bloomberg Commodity Index		16,09%	15,29%	27,11%	23,16%	-3,12%	-3,80%
ASH	Bloomberg Commodity Index		16,09%	16,09%	27,11%	23,70%	-3,12%	-3,11%
AU	Bloomberg Commodity Index		16,09%	16,83%	27,11%	24,03%	-3,12%	-2,37%
DEH	Bloomberg Commodity Index		16,09%	13,85%	27,11%	22,07%	-3,12%	-4,41%
DU	Bloomberg Commodity Index		16,09%	16,54%	27,11%	23,44%	-3,12%	-2,85%
IEH	Bloomberg Commodity Index		16,09%	14,46%	27,11%	23,89%	-3,12%	-2,91%
IG	Bloomberg Commodity Index		16,09%	31,81%	27,11%	26,34%	-3,12%	-4,55%
IGH	Bloomberg Commodity Index		16,09%	15,64%	27,11%	24,40%	-3,12%	-2,79%
IU	Bloomberg Commodity Index		16,09%	17,18%	27,11%	25,26%	-3,12%	-1,34%
NG	Bloomberg Commodity Index		16,09%	32,40%	27,11%	26,86%	-3,12%	-4,05%
XU	Bloomberg Commodity Index		16,09%	18,12%	27,11%	26,32%	-3,12%	-0,49%
ZEH	Bloomberg Commodity Index		16,09%	14,45%	27,11%	23,83%	-3,12%	-2,96%
ZFH	Bloomberg Commodity Index		16,09%	13,72%	27,11%	23,58%	-3,12%	-3,15%
ZGH	Bloomberg Commodity Index		16,09%	15,60%	27,11%	24,31%	-3,12%	-2,85%
ZU	Bloomberg Commodity Index		16,09%	17,14%	27,11%	25,19%	-3,12%	-1,38%

Notas: El rendimiento total es histórico y no es una garantía de resultados futuros. El Valor liquidativo de las Clases de Acciones puede aumentar o disminuir. El rendimiento es el neto de todos los cargos aplicables, así como de las distribuciones realizadas durante el año calendario terminado el 31 de diciembre de 2022 (pero no refleja un cargo por ventas como se indica en la Nota 5 de los estados financieros). El rendimiento es diferente entre las distintas Clases de Acciones en función de las comisiones aplicables por gestión de activos y servicios a los accionistas, tal y como se indica en la Nota 5 de los estados financieros. Además, las fluctuaciones monetarias también pueden afectar al rendimiento en función de la divisa de denominación de la Clase de Acciones y de la divisa base de la Cartera. Los rendimientos se expresan en la divisa en la que están denominadas las Carteras.

Reglamento de operaciones de financiación de valores (sin auditar)

El Reglamento (UE) 2015/2365 del Parlamento Europeo y del Consejo sobre transparencia de las operaciones de financiación de valores y de reutilización («SFTR», por sus siglas en inglés) presenta los requisitos de información de operaciones de financiación de valores («SFT», por sus siglas en inglés) y de swaps de rentabilidad total. Una SFT viene definida en el artículo 3(11) del SFTR como:

- un acuerdo de recompra/recompra inversa;
- préstamos de valores o materias primas y empréstitos de valores o materias primas;
- una operación de compra con pacto de reventa o una operación de venta con pacto de recompra; o
- una operación de préstamo de márgenes.

A 31 de marzo de 2023, 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	263.301	1,34
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	SRT	1.838.347	2,36
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	SRT	570.509	0,64
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	SRT	1.632.152	2,01
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	SRT	2.142.039	1,07

Datos sobre la reutilización de garantías

No hubo reutilización de garantías durante el ejercicio cerrado a 31 de marzo de 2023.

Datos de concentración

Todas las garantías recibidas con respecto a SRT a 31 de marzo de 2023 son garantías en efectivo. Por consiguiente, no se aplica la disposición sobre los diez mayores emisores.

La siguiente tabla proporciona detalles de las diez principales contrapartes (basadas en el volumen bruto de transacciones pendientes) con respecto a SRT mantenidas por cada Cartera a 31 de marzo de 2023:

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	221.525
		Bank of America Merrill Lynch	41.776
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	SRT	UBS	1.817.025
		Goldman Sachs	21.322
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	SRT	UBS	549.776
		Bank of America Merrill Lynch	20.733
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	SRT	UBS	1.632.152
		Goldman Sachs	1.086.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	SRT	Macquarie	532.045
		JPMorgan	523.994

Custodia de las garantías recibidas

La garantía en efectivo se recibe en la cuenta de efectivo de cada Cartera en Citibank Europe plc, Sucursal de Luxemburgo.

La siguiente tabla muestra los depósitos a plazo que mantiene la SICAV a 31 de marzo de 2023:

Nombre de la Cartera	Tipo de garantía	Contraparte	Divisa de garantía	Importe de garantía
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Efectivo	UBS	EUR	530.000
		Total	EUR	530.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Efectivo	Bank of America Merrill Lynch	USD	50.000
		Total	USD	50.000
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Efectivo	UBS	USD	830.000
		Total	USD	830.000

Reglamento de operaciones de financiación de valores (sin auditar)

(continuación)

Nombre de la Cartera	Tipo de garantía	Contraparte	Divisa de garantía	Importe de garantía
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Efectivo	Goldman Sachs	USD	1.920.000
		Macquarie	USD	1.070.000
		JPMorgan	USD	2.750.000*
		Total	USD	5.740.000

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

Datos generales de operaciones

Nombre de la Cartera	Tipo de garantía	Plazo de vencimiento (garantía)	Divisa de garantía	Plazo de vencimiento (SFT/SRT)	País de establecimiento (contraparte)	Liquidación y compensación	Calidad de la garantía
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Efectivo	Vencimiento abierto	USD	De 1 día a 1 mes / De 1 mes a 3 meses	Reino Unido	Bilateral	N/D – Efectivo
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Efectivo	Vencimiento abierto	EUR	De 3 meses a 1 año / Más de 1 año	Reino Unido	Bilateral	N/D – Efectivo
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Efectivo	Vencimiento abierto	USD	De 1 día a 1 mes/ De 1 mes a 3 meses	Reino Unido	Bilateral	N/D – Efectivo
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Efectivo	Vencimiento abierto	USD	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

Custodia de las garantías otorgadas

Las garantías en efectivo y en valores pagadas a las contrapartes se ingresan en cuentas separadas de la contraparte.

El importe de la garantía concedida por SRT a 31 de marzo de 2023 es el siguiente:

Nombre de la Cartera	Tipo de garantía	Contraparte	Divisa de garantía	Importe de garantía	% de garantías mantenidas a final de año por categoría
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Efectivo	UBS	USD	170.000	0,87
		Total	USD	170.000	0,87
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Efectivo	UBS	USD	450.000	0,51
		Total	USD	450.000	0,51

Rendimiento/Costes

El rendimiento y los costes operativos de SRT a 31 de marzo de 2023 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».

Plantilla de información periódica de los productos financieros a que se refiere el artículo 8, apartados 1, 2 y 2 bis, del Reglamento (UE) 2019/2088 y el artículo 6, párrafo primero, del Reglamento (UE) 2020/852

Nombre del producto: Threadneedle (Lux) European High Yield Bond Fund

Identificador de entidad jurídica: 54930067E3IWWWEY1X181

Características medioambientales o sociales

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?	
☒ ☐ Sí	☒ ☐ No
☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental: ____% ☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ Promovió características medioambientales o sociales y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del ____% de inversiones sostenibles ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo social
☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo social: ____%	☒ Promovió características medioambientales o sociales, pero no realizó ninguna inversión sostenible



¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

El producto financiero promovió características medioambientales y sociales mediante la integración de las siguientes medidas de inversión responsable en el proceso de toma de decisiones de inversión:

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo medioambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

- Compararse favorablemente con el índice en criterios ESG importantes, medidos por el modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle, durante periodos consecutivos de 12 meses.
- Mantener al menos el 50 % de las participaciones de la cartera en empresas con una calificación de 1-3 de materialidad ESG de Columbia Threadneedle. Cuando sea necesario, asesorar a las empresas que no estén cubiertas por el Modelo de calificación de materialidad ESG a través de un análisis fundamental, o implicarse con empresas con una calificación de materialidad ESG baja para fomentar su mejora, con el fin de lograr este compromiso mínimo del 50 %.
- Excluir a los emisores que infrinjan las normas y principios internacionales aceptados, como el Pacto Mundial de las Naciones Unidas y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos.
- Excluir a los emisores con participación en armas controvertidas, de conformidad con la Política sobre armas controvertidas de Columbia Threadneedle, y a los emisores con participación directa en armas nucleares.
- Con el fin de apoyar la promoción de las características medioambientales y sociales, establecer un compromiso con las empresas para influir en los equipos de dirección y mejorar sus prácticas, por ejemplo, en cuestiones relacionadas con las emisiones de carbono.

● ***¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?***

El producto financiero tiene los siguientes indicadores de sostenibilidad:

- El indicador principal es la calificación media ponderada positiva de la materialidad ESG de la cartera frente al ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained Index, que se evalúa durante periodos consecutivos de 12 meses. Nuestros sistemas de cumplimiento supervisaron diariamente la calificación positiva de materialidad ESG en relación con el índice. La cartera mantuvo una mejor calificación de materialidad ESG que el índice de referencia durante todo el periodo.
El 31 de marzo de 2023, la calificación de la cartera era 2,51 y la del índice de referencia era 2,74 (en una escala del 1 al 5, en la que la calificación más baja es la mejor).
- Invertimos al menos el 50 % de la cartera en empresas con una calificación de materialidad ESG alta. Cuando sea necesario, podremos asesorar a las empresas que no estén cubiertas por su Modelo de calificación de materialidad ESG a través de un análisis fundamental, o implicarnos con empresas con una calificación de materialidad ESG baja para fomentar su mejora, con el fin de lograr este compromiso mínimo del 50 %. El producto financiero mantuvo más del 50 % de sus participaciones en emisores con una calificación de 1-3 durante el periodo.
- Excluimos empresas que determinamos que incumplían las normas internacionales aceptadas, por ejemplo, los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas. La política de exclusión se respetó con la aplicación de estrictas restricciones previas a la negociación y se realizó un seguimiento continuo.
- También cumplimos nuestra política sobre armas controvertidas y excluimos a emisores con participación directa en armas nucleares.

Dado que estos indicadores constituyen la base de las características medioambientales o sociales promovidas por el producto financiero, también son los elementos vinculantes de la estrategia ESG de la cartera.

● **¿...y en comparación con períodos anteriores?**

En el próximo informe incluiremos una comparación de los indicadores de sostenibilidad con un período anterior.

● **¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

● **¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— **¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— **¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

La taxonomía de la UE establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la Unión.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente ningún objetivo medioambiental o social.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.



¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a tener en cuenta las principales incidencias adversas de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad.



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

Nombre del emisor	Ponderación media	sector	país
Ford	2,87 %	automóviles	Estados Unidos
Electricite de France	2,64 %	servicios públicos	Francia
Telefónica	2,36 %	telecomunicaciones	España
Telecom Italia	2,08 %	telecomunicaciones	Italia
Cellnex	1,99 %	telecomunicaciones	España
Virgin Media	1,88 %	telecomunicaciones	Reino Unido
SFR	1,86 %	telecomunicaciones	Francia
Vodafone	1,85 %	telecomunicaciones	Reino Unido
Iliad	1,83 %	telecomunicaciones	Francia
Faurecia	1,77 %	automóviles	Francia
Deutsche Lufthansa	1,75 %	transporte	Alemania
Repsol	1,50 %	energía	España
Iqvia	1,46 %	atención sanitaria	Estados Unidos
Teva	1,40 %	productos farmacéuticos	Israel
Autostrade per L'Italia	1,33 %	transporte	Italia

La lista incluye las inversiones que constituyen la **mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es:



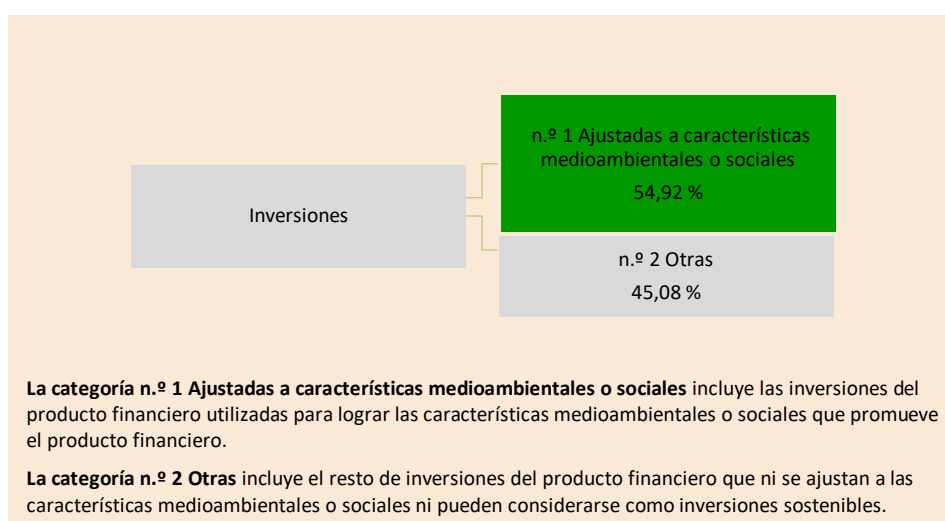
¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

● ¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 54,92 % del producto financiero se invirtió en emisores con una calificación de materialidad ESG de 1-3, por lo que se ajustaban a las características medioambientales y sociales.

El 45,08 % del producto financiero se invirtió en: (1) emisores con una calificación de materialidad ESG de 4 o 5 que, por lo tanto, no se ajustaban a las características medioambientales y sociales, (2) emisores no cubiertos por el modelo de materialidad ESG, y (3) efectivo y derivados.



● ¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Sector	Ponderación media
Telecomunicaciones	16,05 %
Automoción	11,21 %
Servicios	7,94 %
Atención sanitaria	7,90 %
Industria básica	6,56 %
Ocio	5,91 %
Servicios públicos	5,14 %
Transporte	4,81 %
Servicios financieros	4,42 %
Medios de comunicación	3,91 %
Minorista	3,59 %
Banca	3,48 %
Bienes de capital	3,45 %
Energía	3,34 %
Propiedades inmobiliarias	2,84 %
Tecnología y electrónica	2,43 %
Productos de consumo	1,98 %

Para cumplir la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos.

Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental.

Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:

- El **volumen de negocios**, que refleja el porcentaje de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo (CapEx)**, que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación (OpEx)**, que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.



¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

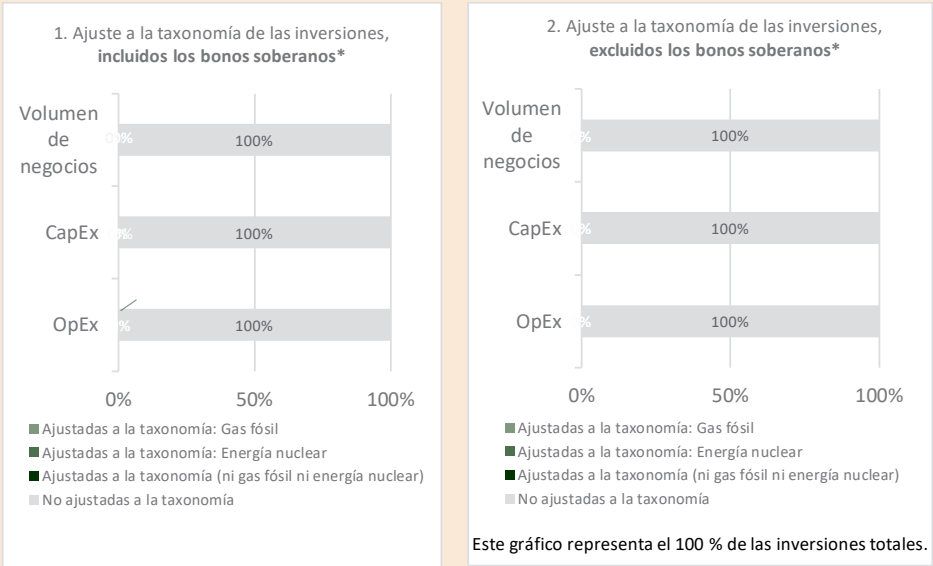
El fondo no se compromete a cumplir los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles, tal como se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplieran la taxonomía de la UE¹?



Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos*, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.



* A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas.

¹Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

● **¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transición y facilitadoras?**

El 0 % de las inversiones realizadas por el fondo se realizan en actividades de transición y facilitadoras, según se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

● **¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?**

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE. El fondo aún no ha comunicado ninguna adaptación al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

No es aplicable: el fondo no tiene el compromiso de invertir en inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que no se ajusten al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

No es aplicable: el fondo no se compromete a invertir en inversiones sostenibles con un objetivo social



¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

Las participaciones clasificadas como «Otras» incluyen (i) activos líquidos auxiliares (a saber, depósitos bancarios a la vista) que se mantienen con fines de gestión de la liquidez; (ii) depósitos bancarios, instrumentos del mercado monetario o fondos del mercado monetario mantenidos con fines de tesorería; (iii) derivados con fines de cobertura; (iv) empresas con una calificación de materialidad ESG de 4 o 5; o (v) empresas no cubiertas por el modelo de materialidad ESG.

Estas inversiones no se utilizan para lograr las características medioambientales y sociales de la cartera. El objetivo de estos valores es proporcionar una cartera diversificada que pueda alcanzar el objetivo financiero.

Las garantías medioambientales o sociales mínimas se aseguran mediante la realización de un análisis de exclusión a todas las participaciones en empresas participadas. En el caso de las posiciones en efectivo y derivados, las consideraciones ESG se integran en la evaluación del riesgo de contraparte.

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.



¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

Hemos colaborado con distintas empresas con el objetivo de influir en su enfoque de los riesgos y las prácticas ESG. Por ejemplo, durante el periodo nos implicamos con la empresa automovilística Ford, con la que hablamos sobre estrategia climática, cadenas de suministro y abastecimiento de materias primas. La empresa se mostró abierta a nuestros comentarios y promovimos unos objetivos de reducción de carbono de Alcance 3 más ambiciosos y la elaboración de informes sobre taxonomía de la UE como áreas clave de mejora, así como la importancia de esforzarse por mejorar las calificaciones ESG de terceros.



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

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo difiere el índice de referencia de un índice general de mercado?*

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo se ha comportado este producto financiero con respecto a los indicadores de sostenibilidad para determinar la conformidad del índice de referencia con las características medioambientales o sociales que promueve?*

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

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

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice general de mercado?*

Durante el periodo, el producto financiero mantuvo un perfil ESG superior al del ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained Index, según las mediciones del modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Plantilla de información periódica de los productos financieros a que se refiere el artículo 8, apartados 1, 2 y 2 bis, del Reglamento (UE) 2019/2088 y el artículo 6, párrafo primero, del Reglamento (UE) 2020/852

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo medioambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

Nombre del producto: Threadneedle (Lux) European Social Bond

Identificador de entidad jurídica: 549300071NVI9LFDKW96

Características medioambientales o sociales

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?	
☒ ☐ ☐ Sí	☒ ☐ ☒ No
☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental : ____% ☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo social : ____%	☐ Promovió características medioambientales o sociales y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del ____% de inversiones sostenibles ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo social ☒ Promovió características medioambientales o sociales , pero no realizó ninguna inversión sostenible



Los indicadores de sostenibilidad miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

El producto financiero promovió características sociales mediante la integración de las siguientes medidas de inversión responsable en el proceso de toma de decisiones de inversión:

- Invertir en títulos de deuda que se considera que apoyan o financian un desarrollo y unas actividades que benefician a la sociedad.

- Excluir a los emisores que, según nuestro criterio, incumplen las normas y los principios de gobernanza internacionales aceptados.
- Excluir emisores que obtienen ingresos de sectores o actividades que superan determinados umbrales (como, entre otros, el tabaco, el alcohol, el entretenimiento para adultos y los juegos de azar, el carbón térmico y las armas nucleares o convencionales).

Todos los bonos mantenidos dentro de la cartera cumplieron los criterios anteriores durante el periodo analizado.

● ¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

La cartera emplea los siguientes indicadores de sostenibilidad:

- Inversión en títulos de deuda que respaldan o financian actividades y avances beneficiosos desde el punto de vista social, evaluados según nuestra Metodología de Calificación Social. Según la metodología, cada inversión se analizará en un proceso de dos flujos que:
 - i) evalúa la intencionalidad social asociada al uso de los ingresos de un bono, para clasificarlo como una inversión de impacto, una inversión con impacto o una financiación para el desarrollo; de lo contrario, la inversión se evalúa como financiación general y se excluye del universo social apto para la inversión;
 - ii) evalúa la intensidad social general aplicando un modelo de tres etapas. El modelo examina nueve aspectos de los resultados sociales atribuibles a un bono para obtener una puntuación numérica sobre 31. Se requiere una puntuación mínima de 5 para que un bono se considere apto. Los bonos con una puntuación numérica apta se dividen en los siguientes cuartiles de intensidad social: menor, moderado, bueno o fuerte (con una calificación de 1 a 4). Aunque no se establecen objetivos formales para el fondo, el objetivo es maximizar el impacto social, lo que se puede observar a través de la calificación social media de la cartera a lo largo del tiempo.

En conjunto, el proceso genera una puntuación específica en materia social (de A1 a C4), que se utiliza para comparar bonos que satisfacen diferentes necesidades sociales y hacer un seguimiento del grado de intensidad social de la cartera a lo largo del tiempo.

Puntuaciones de las calificaciones sociales, % de la cartera

	1: Fuerte	2: Buena	3: Moderada	4: Menor
A	37,0%	1,9%	–	–
B	6,3%	17,6%	13,8%	0,7%
C	7,0%	4,0%	5,5%	5,1%

El socio del fondo en materia social elabora un informe anual sobre el impacto social, en el que se facilita la evaluación de las características sociales promovidas por el fondo.

A fin de promover de forma positiva los resultados sociales y las características de impacto, el fondo mantuvo y siguió los siguientes criterios:

- La exclusión de emisores que obtienen ingresos de sectores o actividades que superan determinados umbrales cuando dichos sectores, actividades o emisores ofrecen beneficios sociales o de sostenibilidad mínimos o que representan un alto riesgo de impactos adversos.
Las exclusiones basadas en umbrales de ingresos se supervisan de forma continua para garantizar que la cartera sigue cumpliendo las normas.
- La exclusión de emisores que incumplan los principios y normas internacionales aceptadas, por ejemplo, los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas.
Durante el período, la política de exclusión se respetó con la aplicación de estrictas restricciones previas a la negociación y un seguimiento continuo. También cumplimos con nuestra Política sobre armas controvertidas y no invertimos en emisores con una participación directa en armas nucleares.

● **¿...y en comparación con períodos anteriores?**

En el próximo informe incluiremos una comparación de los indicadores de sostenibilidad con un período anterior.

● **¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?**

No es aplicable: a efectos del SFDR, el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

Las principales incidencias adversas son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

● **¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— **¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— **¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.



¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a tener en cuenta las principales incidencias adversas de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad.



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen la mayor parte de las inversiones del producto financiero durante el período de referencia, que es:

Inversiones más importantes	Sector	Ponderación media	País
Credit Agricole	Banca	2,84 %	Francia
Consejo de Europa	Supranacional	2,75 %	Supranacional
Wellcome Trust	Servicios financieros	2,29 %	Reino Unido
Unión Europea	Supranacional	1,99 %	Supranacional
UNEDIC	Agencia soberana	1,88 %	Francia
BPCE	Banca	1,65 %	Francia
Vonovia	Propiedades inmobiliarias	1,64 %	Alemania
NatWest	Banca	1,62 %	Reino Unido
Instituto de Credito Oficial	Agencia soberana	1,56 %	España
International Finance Facility	Supranacional	1,52 %	Supranacional
Cassa Depositi E Prestiti	Agencia soberana	1,51 %	Italia
E.ON	Servicios públicos	1,51 %	Alemania
Caisse Amortissement De La Dette	Agencia soberana	1,49 %	Francia
ING	Banca	1,40 %	Países Bajos
Orange	Telecomunicaciones	1,40 %	Francia



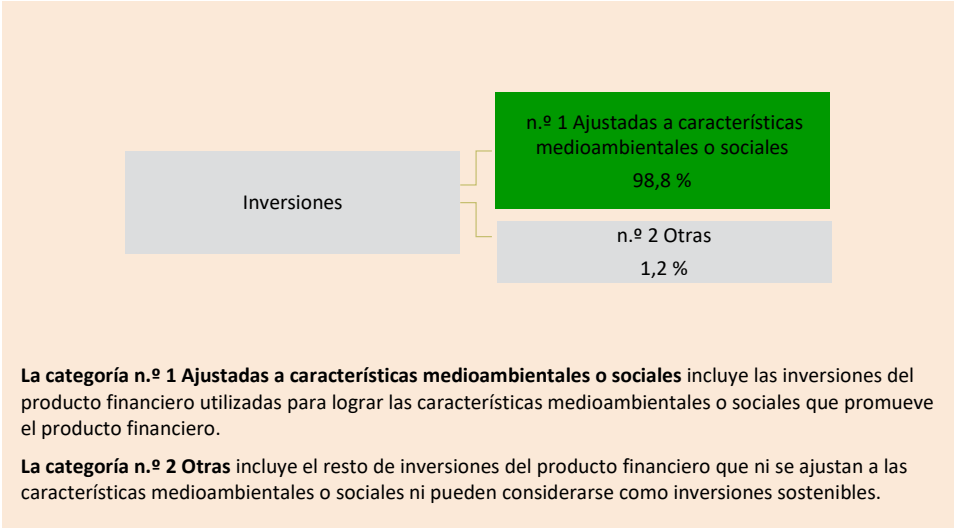
¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

● ¿Cuál ha sido la asignación de activos?

La asignación de activos describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

El 98,8 % del producto financiero se invirtió en títulos de deuda, sujetos a la aplicación de la Metodología de Calificación Social y los criterios de exclusión.

El 1,2 % del producto financiero se invirtió en efectivo o equivalentes de efectivo.



● **¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?**

Sector	Ponderación media
Subsoberanos	26,66 %
Bancos	24,81 %
Servicios públicos	12,73 %
Propiedades inmobiliarias	6,13 %
Telecomunicaciones	5,39 %
Seguros	4,55 %
Productos de consumo	3,66 %



¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El fondo no se compromete a cumplir los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles, tal como se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE.

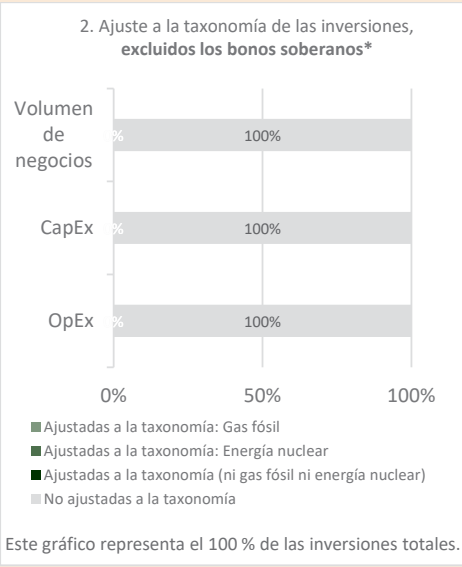
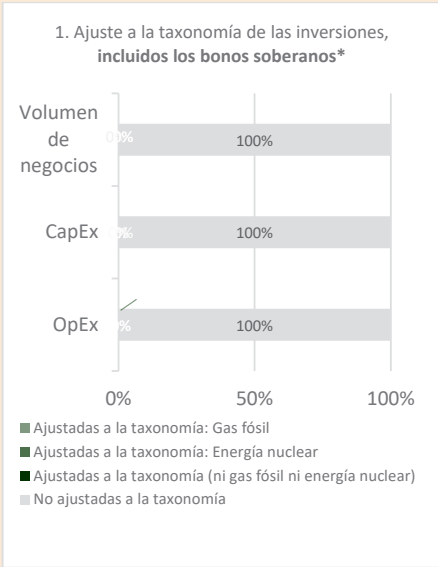
● ¿Invertió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplieran la taxonomía de la UE¹?

☐ Sí:
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear
☒ No

Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:

- El **volumen de negocios**, que refleja el porcentaje de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo (CapEx)**, que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación (OpEx)**, que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos*, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.



Este gráfico representa el 100 % de las inversiones totales.

* A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas.

● ¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transición y facilitadoras?

El 0 % de las inversiones realizadas por el fondo se realizan en actividades de transición y facilitadoras, según se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

¹Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

● **¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?**

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE. El fondo aún no ha comunicado ninguna adaptación al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

No es aplicable: el fondo no tiene el compromiso de invertir en inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que no se ajusten al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

No es aplicable: el fondo no se compromete a invertir en inversiones sostenibles con un objetivo social



¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

«Otras» inversiones incluyen (i) activos líquidos auxiliares (a saber, depósitos bancarios a la vista) que se mantienen con fines de gestión de la liquidez; (ii) depósitos bancarios, instrumentos del mercado monetario o fondos del mercado monetario mantenidos con fines de tesorería; y (iii) derivados con fines de cobertura.

Estas inversiones no se utilizan para lograr las características medioambientales y sociales de la cartera.

Se ofrecen garantías medioambientales o sociales mínimas para las posiciones de efectivo y derivados integrando consideraciones ESG en la evaluación del riesgo de la contraparte.



¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

Como titular de bonos, buscamos activamente oportunidades de implicación con los emisores con el fin de comprender mejor su valor social e influir positivamente en ellos. Además, nos implicamos con los emisores para desarrollar el mercado para la emisión de títulos de uso específico, incluida la exposición de prácticas recomendadas, la estructura de bonos y la comunicación de información de impacto.

Pretendemos garantizar que se minimicen los impactos sociales negativos de la transición y hacer frente a estos retos mediante la implicación activa con los emisores a este respecto para promover el crecimiento inclusivo.

A fin de promover las características sociales en las que se centra el producto, durante el periodo analizado se incluyeron, entre otros, los siguientes temas de implicación: el cambio climático, las normas medioambientales, los derechos humanos, las normas laborales y la gobernanza corporativa. Un ejemplo de implicación con el emisor incluye la empresa portuguesa de servicios públicos EDP. En mayo de 2022, nos pusimos en contacto con EDP en relación con su emisión actual de bonos verdes y para preguntarles cómo enfocaban la transición justa. Hablamos sobre las emisiones futuras y las posibles estructuras. EDP estaba pensando sacar un bono vinculado a la sostenibilidad. Les dijimos que nosotros preferimos utilizar específicamente los ingresos en lugar de bonos vinculados a la sostenibilidad debido a una mayor adicionalidad e intencionalidad, y a que los objetivos de KPI normalmente no suponen un reto. Sugerimos que integrasen los KPI en una estructura de sostenibilidad/bonos verdes y que valorasen el uso de KPI sociales. Convencimos a EDP para que continuara con la emisión de títulos de uso específico y, desde esa reunión, hemos comprado su nueva emisión de bonos verdes.



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

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No es aplicable: el producto financiero no utiliza ningún índice de referencia designado para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● ¿Cómo difiere el índice de referencia de un índice general de mercado?

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● ¿Cómo se ha comportado este producto financiero con respecto a los indicadores de sostenibilidad para determinar la conformidad del índice de referencia con las características medioambientales o sociales que promueve?

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

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

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● ¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice general de mercado?

No es aplicable: el índice de mercado solo se utiliza con el fin de comparar la rentabilidad financiera.

Plantilla de información periódica de los productos financieros a que se refiere el artículo 8, apartados 1, 2 y 2 bis, del Reglamento (UE) 2019/2088 y el artículo 6, párrafo primero, del Reglamento (UE) 2020/852

Nombre del producto: Threadneedle (Lux) Emerging Market ESG Equities

Identificador de entidad jurídica: 5493003JWKERJYXOI785

Características medioambientales o sociales

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?	
☒ ☐ ☐ Sí	☒ ☐ ☒ No
☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental: ____% ☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo social: ____%	☐ Promovió características medioambientales o sociales y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del ____% de inversiones sostenibles ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo social ☒ Promovió características medioambientales o sociales, pero no realizó ninguna inversión sostenible



¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

Los indicadores de sostenibilidad miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

El producto financiero promovió características medioambientales y sociales mediante la integración de las siguientes medidas de inversión responsable en el proceso de toma de decisiones de inversión:

- Compararse favorablemente con el índice en criterios ESG importantes, medidos por el modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle, durante periodos consecutivos de 12 meses.
- Invertimos al menos el 80 % de la cartera en empresas con características ESG sólidas o en proceso de mejora, medidas mediante una combinación de la calificación de materialidad ESG y el análisis fundamental de las empresas de la cartera. La cartera tratará de priorizar a las empresas que obtengan una puntuación alta en la calificación de la materialidad ESG de Columbia Threadneedle, dando así a la cartera una inclinación positiva hacia las características ESG en comparación con las del MSCI Europe Index, durante periodos consecutivos de 12 meses. Se considera que todas las empresas con una calificación alta se ajustan a las características medioambientales o sociales promovidas por la cartera. Sin embargo, la cartera puede invertir en empresas con una calificación inferior que también se considere que se ajustan a las características medioambientales o sociales promovidas por la cartera, con arreglo a que, a pesar de dicha calificación (i) el Subasesor determine, a través del análisis fundamental, que estos valores ya demuestran prácticas ESG sólidas o (ii) que disponen de margen para mejorar sus prácticas ESG. El Subasesor trata de fomentar dichas mejoras mediante la aplicación de su política de participación.
- Excluir a las empresas que infrinjan las normas y principios internacionales aceptados, como el Pacto Mundial de las Naciones Unidas y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos.
- Excluir a las empresas con participación en armas controvertidas, de conformidad con la Política sobre armas controvertidas de Columbia Threadneedle, y a las empresas con participación directa en armas nucleares.
- Con el fin de apoyar la promoción de las características medioambientales y sociales, establecer un compromiso con las empresas para influir en los equipos de dirección y mejorar sus prácticas, por ejemplo, en cuestiones relacionadas con las emisiones de carbono.

● **¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?**

El producto financiero tiene los siguientes indicadores de sostenibilidad:

- El indicador principal es la calificación media ponderada positiva de la materialidad ESG de la cartera frente al MSCI Emerging Markets Index, que se evalúa durante periodos consecutivos de 12 meses. Nuestros sistemas de cumplimiento supervisaron diariamente la calificación positiva de materialidad ESG en relación con el índice. La cartera mantuvo una mejor calificación de materialidad ESG que el índice de referencia durante todo el periodo. El 31 de marzo de 2023, la calificación de la cartera era 2,00 y la del índice de referencia era 2,34 (en una escala del 1 al 5, en la que la calificación más baja es la mejor).
- Invertimos al menos el 80 % de la cartera en empresas con características ESG sólidas o en proceso de mejora, medidas mediante una combinación de la calificación de materialidad ESG y el análisis fundamental de las empresas de la cartera.
- Excluimos empresas que determinamos que incumplían las normas internacionales aceptadas, por ejemplo, los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas. La política de exclusión se respetó con la aplicación de estrictas restricciones previas a la negociación y se realizó un seguimiento continuo.

- También cumplimos nuestra política sobre armas controvertidas y excluimos a empresas con participación directa en armas nucleares.

Dado que estos indicadores constituyen la base de las características medioambientales o sociales promovidas por el producto financiero, también son los elementos vinculantes de la estrategia ESG de la cartera.

● **¿...y en comparación con períodos anteriores?**

En el próximo informe incluiremos una comparación de los indicadores de sostenibilidad con un período anterior.

● **¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

● **¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— **¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— **¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

Las principales incidencias adversas

son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.



¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a tener en cuenta las principales incidencias adversas de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad.



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen la **mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia.

Inversiones más importantes	Sector	Ponderación media	País
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	Tecnologías de la información	7,77 %	Taiwán
TENCENT HOLDINGS LTD	Servicios de comunicación	5,73 %	China
SAMSUNG ELECTRONICS LTD	Tecnologías de la información	5,56 %	Corea del Sur
JD.COM	Consumo discrecional	4,77 %	China
MEITUAN	Consumo discrecional	4,36 %	China
BANK RAKYAT INDONESIA	Servicios financieros	4,28 %	Indonesia
BANK CENTRAL ASIA	Servicios financieros	2,90 %	Indonesia
HDFC BANK	Servicios financieros	2,55 %	India
ICICI BANK	Servicios financieros	2,50 %	India
LOCALIZA RENT A CAR	Productos industriales	2,40 %	Brasil
ITAU UNIBANCO HOLDING	Servicios financieros	1,95 %	Brasil
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS	Atención sanitaria	1,93 %	China
MERCADOLIBRE INC	Consumo discrecional	1,90 %	Argentina
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	Atención sanitaria	1,84 %	India
INFOSYS ADR REPRESENTING ONE LTD	Tecnologías de la información	1,78 %	India



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

● ¿Cuál ha sido la asignación de activos?

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

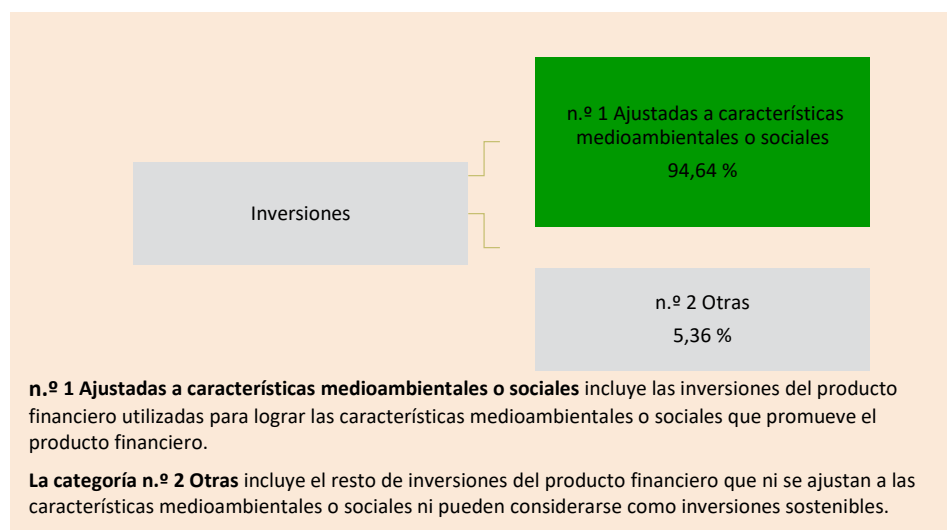
94,64 %: Invertimos al menos el 80 % de la cartera en empresas con características ESG sólidas o en proceso de mejora, medidas mediante una combinación de la calificación de materialidad ESG y el análisis fundamental de las empresas de la cartera.

5,36 %: Incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse inversiones sostenibles.

Para cumplir la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos.

Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental.

Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.



● ¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Sector	Ponderación media
Servicios financieros	30,81 %
Tecnologías de la información	24,94 %
Consumo discrecional	15,73 %
Atención sanitaria	7,16 %
Servicios de comunicación	6,74 %
Productos industriales	5,68 %
Bienes de consumo básicos	3,34 %
Energía	1,64 %
Propiedades inmobiliarias	0,69 %



¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El fondo no se compromete a cumplir los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles, tal como se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE.

Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:

- El **volumen de negocios**, que refleja el porcentaje de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo (CapEx)**, que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación (OpEx)**, que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

● **¿Invertió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplieran la taxonomía de la UE¹?**

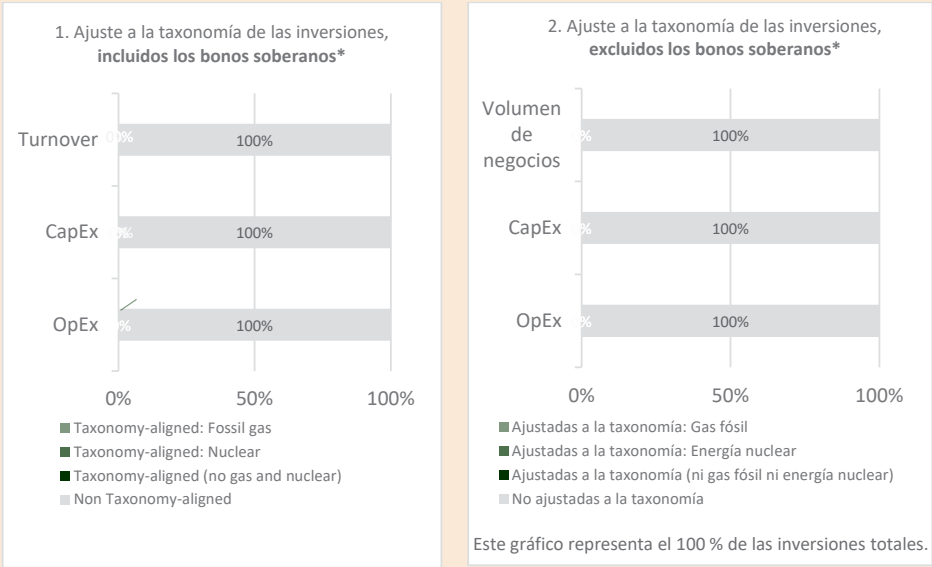
☐ Sí:

En el gas fósil

En la energía nuclear

☒ No

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos*, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.



* A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas.

● **¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transición y facilitadoras?**

El 0 % de las inversiones realizadas por el fondo se realizan en actividades de transición y facilitadoras, según se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

¹Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

● **¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?**

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE. El fondo aún no ha comunicado ninguna adaptación al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

No es aplicable: el fondo no tiene el compromiso de invertir en inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que no se ajusten a la taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

No es aplicable: el fondo no se compromete a invertir en inversiones sostenibles con un objetivo social.



¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

Las participaciones clasificadas como «Otras» incluyen (i) activos líquidos auxiliares (a saber, depósitos bancarios a la vista) que se mantienen con fines de gestión de la liquidez; (ii) depósitos bancarios, instrumentos del mercado monetario o fondos del mercado monetario mantenidos con fines de tesorería; o (iii) derivados con fines de cobertura.

Las garantías medioambientales o sociales mínimas para las posiciones de efectivo y los derivados están integradas en la evaluación de riesgos de contraparte de ESG.



¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

Hemos colaborado con distintas empresas con el objetivo de influir en su enfoque de los riesgos y las prácticas ESG. Por ejemplo, durante el periodo, colaboramos con las siguientes entidades: Bank Central, para analizar su estrategia de financiación sostenible y de inclusión financiera; Bank Rakyat Indonesia, en materia de finanzas sostenibles; Tencent, al respecto de la eficacia del consejo y otros temas ESG; HDFC Bank, sobre su encuesta de materialidad, con un enfoque centrado en la divulgación de información sobre el clima; y WEG, para definir las prioridades de gestión en materia laboral, del clima y de la circularidad.



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

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo difiere el índice de referencia de un índice general de mercado?*

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo se ha comportado este producto financiero con respecto a los indicadores de sostenibilidad para determinar la conformidad del índice de referencia con las características medioambientales o sociales que promueve?*

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

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

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice general de mercado?*

Durante el periodo, el producto financiero mantuvo un perfil ESG superior al MSCI Emerging Markets Index, según las mediciones del modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Plantilla de información periódica de los productos financieros a que se refiere el artículo 8, apartados 1, 2 y 2 bis, del Reglamento (UE) 2019/2088 y el artículo 6, párrafo primero, del Reglamento (UE) 2020/852

Nombre del producto: Threadneedle (Lux) Global Focus

Identificador de entidad jurídica: 549300N6B2IZVI8Z4Q40

Características medioambientales o sociales

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible? [marcar y rellenar según proceda; la cifra porcentual representa inversiones sostenibles]

☒ ☒ ☐ Sí ☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental: ____% ☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo social: ____%	☒ ☐ ☒ No ☐ Promovió características medioambientales o sociales y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del ____% de inversiones sostenibles ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo social ☒ Promovió características medioambientales o sociales, pero no realizó ninguna inversión sostenible
---	---



¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

Los indicadores de sostenibilidad miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

El producto financiero promovió características medioambientales y sociales mediante la integración de las siguientes medidas de inversión responsable en el proceso de toma de decisiones de inversión:

- Compararse favorablemente con el índice en criterios ESG importantes, medidos por el modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle, durante periodos consecutivos de 12 meses.
- Mantener al menos el 50 % de las participaciones de la cartera en empresas con una calificación de 1-3 de materialidad ESG de Columbia Threadneedle. Cuando sea necesario, asesorar a las empresas que no estén cubiertas por el Modelo de calificación de materialidad ESG a través de un análisis fundamental, o implicarse con empresas con una calificación de materialidad ESG baja para fomentar su mejora, con el fin de lograr este compromiso mínimo del 50 %.
- Excluir a las empresas que infrinjan las normas y principios internacionales aceptados, como el Pacto Mundial de las Naciones Unidas y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos.
- Excluir a las empresas con participación en armas controvertidas, de conformidad con la Política sobre armas controvertidas de Columbia Threadneedle, y a las empresas con participación directa en armas nucleares.
- Con el fin de apoyar la promoción de las características medioambientales y sociales, establecer un compromiso con las empresas para influir en los equipos de dirección y mejorar sus prácticas, por ejemplo, en cuestiones relacionadas con las emisiones de carbono.

● ***¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?***

El producto financiero tiene los siguientes indicadores de sostenibilidad:

- El indicador principal es la calificación media ponderada positiva de la materialidad ESG de la cartera frente al MSCI All Countries World Index, que se evalúa durante periodos consecutivos de 12 meses. Nuestros sistemas de cumplimiento supervisaron diariamente la calificación positiva de materialidad ESG en relación con el índice. La cartera mantuvo una mejor calificación de materialidad ESG que el índice de referencia durante todo el periodo. El 31 de marzo de 2023, la calificación de la cartera era 2,44 y la del índice de referencia era 2,78 (en una escala del 1 al 5, en la que la calificación más baja es la mejor).
- Invertimos al menos el 50 % de la cartera en empresas con una calificación de materialidad ESG alta. Cuando sea necesario, podremos asesorar a las empresas que no estén cubiertas por su Modelo de calificación de materialidad ESG a través de un análisis fundamental, o implicarnos con empresas con una calificación de materialidad ESG baja para fomentar su mejora, con el fin de lograr este compromiso mínimo del 50 %. El producto financiero mantuvo más del 50 % de sus participaciones en empresas con una calificación de 1-3 durante el periodo.
- Excluimos empresas que determinamos que incumplían las normas internacionales aceptadas, por ejemplo, los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas. La política de exclusión se respetó con la aplicación de estrictas restricciones previas a la negociación y se realizó un seguimiento continuo.
- También cumplimos nuestra política sobre armas controvertidas y excluimos a empresas con participación directa en armas nucleares.

Dado que estos indicadores constituyen la base de las características medioambientales o sociales promovidas por el producto financiero, también son los elementos vinculantes de la estrategia ESG de la cartera.

● **¿...y en comparación con períodos anteriores?**

En el próximo informe incluiremos una comparación de los indicadores de sostenibilidad con un período anterior.

● **¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

● **¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

La taxonomía de la UE establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la Unión.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente ningún objetivo medioambiental o social.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.



¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a tener en cuenta las principales incidencias adversas de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad.



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

Inversiones más importantes	Sector	Ponderación media	País
MICROSOFT CORP	Tecnologías de la información	7,98 %	Estados Unidos
MASTERCARD INC CLASS A	Servicios financieros	5,41 %	Estados Unidos
INTUIT INC	Tecnologías de la información	4,24 %	Estados Unidos
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Atención sanitaria	3,98 %	Estados Unidos
ALPHABET INC CLASS A	Servicios de comunicación	3,98 %	Estados Unidos
LINDE PLC	Materiales	3,12 %	Reino Unido
LAM RESEARCH CORP	Tecnologías de la información	3,06 %	Estados Unidos
KEYENCE CORP	Tecnologías de la información	2,56 %	Japón
LONZA GROUP AG	Atención sanitaria	2,53 %	Suiza
LVMH	Consumo discrecional	2,47 %	Francia
AMAZON COM INC	Consumo discrecional	2,34 %	Estados Unidos
CONOCOPHILLIPS	Energía	2,32 %	Estados Unidos
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	Tecnologías de la información	2,25 %	Taiwán (República de China)
ELEVANCE HEALTH INC	Atención sanitaria	2,24 %	Estados Unidos
RECRUIT HOLDINGS LTD	Productos industriales	2,14 %	Japón

La lista incluye las inversiones que constituyen la mayor parte de las inversiones del producto financiero durante el período de referencia.



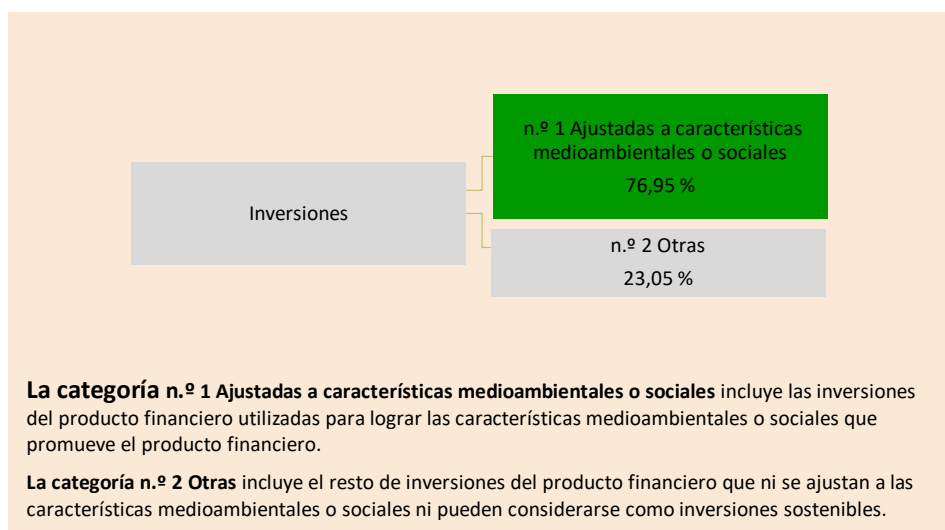
¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

● ¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 76,95 % del producto financiero se invirtió en empresas con una calificación de materialidad ESG de 1-3, por lo que se ajustaban a las características medioambientales y sociales.

El 23,05 % del producto financiero se invirtió en: (1) empresas con una calificación de materialidad ESG de 4 o 5 que, por lo tanto, no se ajustaban a las características medioambientales y sociales, (2) empresas no cubiertas por el modelo de materialidad ESG, y (3) efectivo y derivados.

La asignación de activos describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.



● **¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?**

Sector	Ponderación media
Tecnologías de la información	26,13 %
Atención sanitaria	17,48 %
Servicios financieros	15,99 %
Productos industriales	9,51 %
Bienes de consumo básicos	8,01 %
Consumo discrecional	7,08 %
Servicios de comunicación	6,21 %
Materiales	4,81 %
Energía	2,59 %
Servicios públicos	0,63 %
Efectivo	1,58 %

Para cumplir la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos.

Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental.

Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:

- El **volumen de negocios**, que refleja el porcentaje de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo (CapEx)**, que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación (OpEx)**, que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

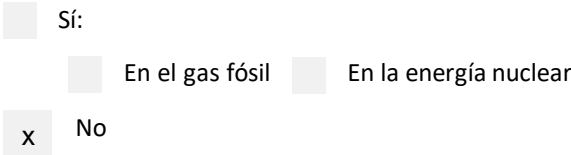


¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

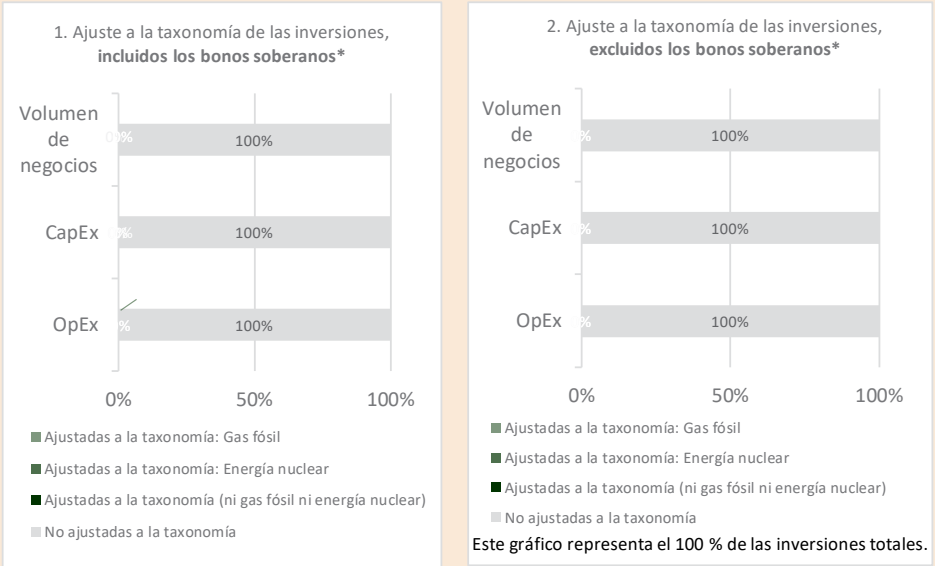
El fondo no se compromete a cumplir los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles, tal como se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplieran la taxonomía de la UE¹?



Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos*, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.



* A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas.

¹Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

● **¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transición y facilitadoras?**

El 0 % de las inversiones realizadas por el fondo se realizan en actividades de transición y facilitadoras, según se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

● **¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?**

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE. El fondo aún no ha comunicado ninguna adaptación al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

No es aplicable: el fondo no tiene el compromiso de invertir en inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que no se ajusten al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

No es aplicable: el fondo no se compromete a invertir en inversiones sostenibles con un objetivo social



¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

Las participaciones clasificadas como «Otras» incluyen (i) activos líquidos auxiliares (a saber, depósitos bancarios a la vista) que se mantienen con fines de gestión de la liquidez; (ii) depósitos bancarios, instrumentos del mercado monetario o fondos del mercado monetario mantenidos con fines de tesorería; (iii) derivados con fines de cobertura; (iv) empresas con una calificación de materialidad ESG de 4 o 5; o (v) empresas no cubiertas por el modelo de materialidad ESG.

Estas inversiones no se utilizan para lograr las características medioambientales y sociales de la cartera. El objetivo de estos valores es proporcionar una cartera diversificada que pueda alcanzar el objetivo financiero.

Las garantías medioambientales o sociales mínimas se aseguran mediante la realización de un análisis de exclusión a todas las participaciones en empresas participadas. En el caso de las posiciones en efectivo y derivados, las consideraciones ESG se integran en la evaluación del riesgo de contraparte.



son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.



¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

Hemos colaborado con distintas empresas con el objetivo de influir en su enfoque de los riesgos y las prácticas ESG. Por ejemplo, durante el periodo, participamos en posiciones de la cartera con distintos temas. Incluimos, entre otras, la implicación con: un banco de mercados emergentes para comprender mejor su enfoque en materia de sostenibilidad, gobernanza y gestión de riesgos climáticos; una empresa de atención sanitaria en el tema del marketing ético y el uso no aprobado de uno de sus medicamentos.



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

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo difiere el índice de referencia de un índice general de mercado?*

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo se ha comportado este producto financiero con respecto a los indicadores de sostenibilidad para determinar la conformidad del índice de referencia con las características medioambientales o sociales que promueve?*

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

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

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice general de mercado?*

Durante el periodo, el producto financiero mantuvo un perfil ESG superior al del MSCI All Countries World Index, según las mediciones del modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Plantilla de información periódica de los productos financieros a que se refiere el artículo 8, apartados 1, 2 y 2 bis, del Reglamento (UE) 2019/2088 y el artículo 6, párrafo primero, del Reglamento (UE) 2020/852

Nombre del producto: Threadneedle (Lux) Global Equity Income

Identificador de entidad jurídica: 549300WX6ZDL2WOHJS77

Características medioambientales o sociales

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?	
☒ ☐ Sí	☒ ☐ No
☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental: ____% ☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ Promovió características medioambientales o sociales y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del ____% de inversiones sostenibles ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo social
☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo social: ____%	☒ Promovió características medioambientales o sociales, pero no realizó ninguna inversión sostenible



¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

Los indicadores de sostenibilidad miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

El producto financiero promovió características medioambientales y sociales mediante la integración de las siguientes medidas de inversión responsable en el proceso de toma de decisiones de inversión:

- Compararse favorablemente con el índice en criterios ESG importantes, medidos por el modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle, durante periodos consecutivos de 12 meses.
- Mantener al menos el 50 % de las participaciones de la cartera en empresas con una calificación de 1-3 de materialidad ESG de Columbia Threadneedle. Cuando sea necesario, asesorar a las empresas que no estén cubiertas por el Modelo de calificación de materialidad ESG a través de un análisis fundamental, o implicarse con empresas con una calificación de materialidad ESG baja para fomentar su mejora, con el fin de lograr este compromiso mínimo del 50 %.
- Excluir a las empresas que infrinjan las normas y principios internacionales aceptados, como el Pacto Mundial de las Naciones Unidas y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos.
- Excluir a las empresas con participación en armas controvertidas, de conformidad con la Política sobre armas controvertidas de Columbia Threadneedle, y a las empresas con participación directa en armas nucleares.
- Con el fin de apoyar la promoción de las características medioambientales y sociales, establecer un compromiso con las empresas para influir en los equipos de dirección y mejorar sus prácticas, por ejemplo, en cuestiones relacionadas con las emisiones de carbono.

● ***¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?***

El producto financiero tiene los siguientes indicadores de sostenibilidad:

- El indicador principal es la calificación media ponderada positiva de la materialidad ESG de la cartera frente al MSCI All Countries World Index, que se evalúa durante periodos consecutivos de 12 meses. Nuestros sistemas de cumplimiento supervisaron diariamente la calificación positiva de materialidad ESG en relación con el índice. La cartera mantuvo una mejor calificación de materialidad ESG que el índice de referencia durante todo el periodo. El 31 de marzo de 2023, la calificación de la cartera era 2,38 y la del índice de referencia era 2,78 (en una escala del 1 al 5, en la que la calificación más baja es la mejor).
- Invertimos al menos el 50 % de la cartera en empresas con una calificación de materialidad ESG alta. Cuando sea necesario, podremos asesorar a las empresas que no estén cubiertas por su Modelo de calificación de materialidad ESG a través de un análisis fundamental, o implicarnos con empresas con una calificación de materialidad ESG baja para fomentar su mejora, con el fin de lograr este compromiso mínimo del 50 %. El producto financiero mantuvo más del 50 % de sus participaciones en empresas con una calificación de 1-3 durante el periodo.
- Excluimos empresas que determinamos que incumplían las normas internacionales aceptadas, por ejemplo, los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas. La política de exclusión se respetó con la aplicación de estrictas restricciones previas a la negociación y se realizó un seguimiento continuo.
- También cumplimos nuestra política sobre armas controvertidas y excluimos a empresas con participación directa en armas nucleares.

Dado que estos indicadores constituyen la base de las características medioambientales o sociales promovidas por el producto financiero, también son los elementos vinculantes de la estrategia ESG de la cartera.

● **¿...y en comparación con períodos anteriores?**

En el próximo informe incluiremos una comparación de los indicadores de sostenibilidad con un período anterior.

● **¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

● **¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— ¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— ¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

La taxonomía de la UE establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la Unión.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente ningún objetivo medioambiental o social.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.



¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a tener en cuenta las principales incidencias adversas de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad.



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen la **mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia.

Inversiones más importantes	Ponderación media	Sector	País
MICROSOFT CORP	3,67 %	Tecnologías de la información	Estados Unidos
SAMSUNG ELECTRONICS LTD	2,43 %	Tecnologías de la información	Corea del Sur, República de
SIEMENS N AG	2,31 %	Productos industriales	Alemania
STATE STREET CORP	2,22 %	Servicios financieros	Estados Unidos
ANGLO AMERICAN PLC	2,17 %	Materiales	Sudáfrica
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	2,08 %	Servicios financieros	Estados Unidos
TOTALENERGIES	2,05 %	Energía	Francia
BRISTOL MYERS SQUIBB	1,96 %	Atención sanitaria	Estados Unidos
ELI LILLY	1,93 %	Atención sanitaria	Estados Unidos
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	1,91 %	Tecnologías de la información	Taiwán (República de China)
XCEL ENERGY INC	1,89 %	Servicios públicos	Estados Unidos
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,89 %	Bienes de consumo básicos	Reino Unido
EXPERIAN PLC	1,86 %	Productos industriales	Reino Unido
ELEVANCE HEALTH INC	1,86 %	Atención sanitaria	Estados Unidos
DEUTSCHE TELEKOM AG	1,84 %	Servicios de comunicación	Alemania



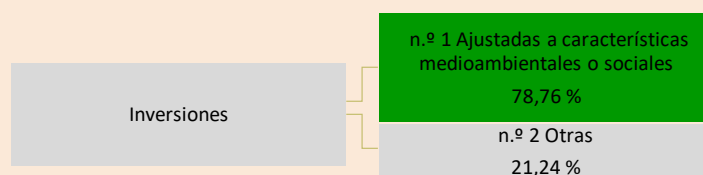
¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

● ¿Cuál ha sido la asignación de activos?

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

El 78,76 % del producto financiero se invirtió en empresas con una calificación de materialidad ESG de 1-3, por lo que se ajustaban a las características medioambientales y sociales.

El 21,24 % del producto financiero se invirtió en: (1) empresas con una calificación de materialidad ESG de 4 o 5 que, por lo tanto, no se ajustaban a las características medioambientales y sociales, (2) empresas no cubiertas por el modelo de materialidad ESG, y (3) efectivo y derivados.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

● ¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Sector	Ponderación media
Servicios financieros	16,90 %
Tecnologías de la información	14,91 %
Atención sanitaria	12,32 %
Productos industriales	11,76 %
Bienes de consumo básicos	9,04 %
Consumo discrecional	7,25 %
Materiales	6,78 %

Energía	6,20 %
Servicios de comunicación	6,03 %
Servicios públicos	4,80 %
Propiedades inmobiliarias	2,02 %
Efectivo	2,00 %



¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El fondo no se compromete a cumplir los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles, tal como se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE.

● ¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplieran la taxonomía de la UE¹?

☐ Sí:

☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

Para cumplir la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos.

Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental.

Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

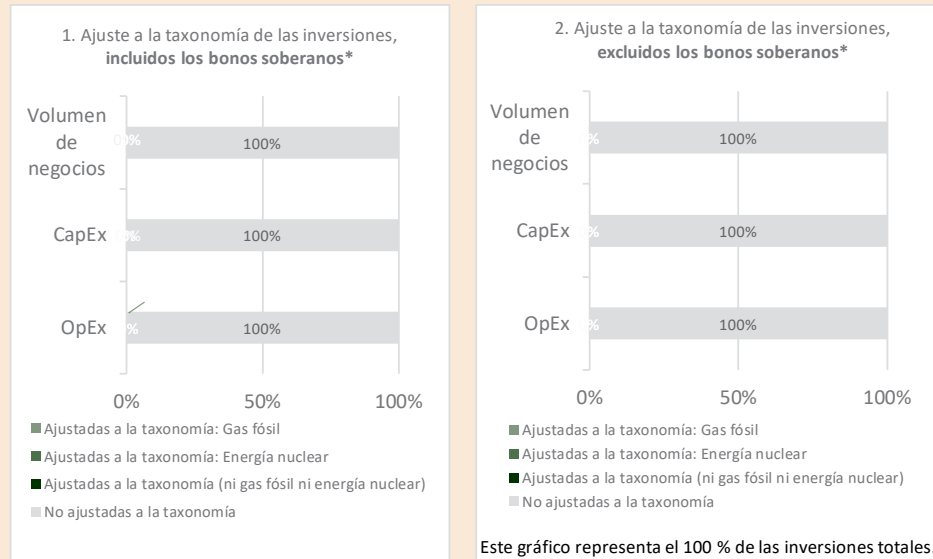
¹Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:

- El **volumen de negocios**, que refleja el porcentaje de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo (CapEx)**, que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.

- Los **gastos de explotación (OpEx)**, que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos*, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.



* A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas.

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transición y facilitadoras?

El 0 % de las inversiones realizadas por el fondo se realizan en actividades de transición y facilitadoras, según se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE. El fondo aún no ha comunicado ninguna adaptación al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

No es aplicable: el fondo no tiene el compromiso de invertir en inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que no se ajusten al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

No es aplicable: el fondo no se compromete a invertir en inversiones sostenibles con un objetivo social



¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

Las participaciones clasificadas como «Otras» incluyen (i) activos líquidos auxiliares (a saber, depósitos bancarios a la vista) que se mantienen con fines de gestión de la liquidez; (ii) depósitos bancarios, instrumentos del mercado monetario o fondos del mercado monetario mantenidos con fines de tesorería; (iii) derivados con fines de cobertura; (iv) empresas con una calificación de materialidad ESG de 4 o 5; o (v) empresas no cubiertas por el modelo de materialidad ESG.

Estas inversiones no se utilizan para lograr las características medioambientales y sociales de la cartera. El objetivo de estos valores es proporcionar una cartera diversificada que pueda alcanzar el objetivo financiero.

Las garantías medioambientales o sociales mínimas se aseguran mediante la realización de un análisis de exclusión a todas las participaciones en empresas participadas. En el caso de las posiciones en efectivo y derivados, las consideraciones ESG se integran en la evaluación del riesgo de contraparte.



¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

Hemos colaborado con distintas empresas con el objetivo de influir en su enfoque de los riesgos y las prácticas ESG. Por ejemplo, durante el periodo, participamos en posiciones de la cartera con distintos temas. Incluimos, entre otras, la implicación con una empresa de atención sanitaria en el tema del marketing ético y el uso no aprobado de uno de sus medicamentos.



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

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

● ***¿Cómo difiere el índice de referencia de un índice general de mercado?***

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● ***¿Cómo se ha comportado este producto financiero con respecto a los indicadores de sostenibilidad para determinar la conformidad del índice de referencia con las características medioambientales o sociales que promueve?***

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

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

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● ***¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice general de mercado?***

Durante el periodo, el producto financiero mantuvo un perfil ESG superior al del MSCI All Countries World Index, según las mediciones del modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Plantilla de información periódica de los productos financieros a que se refiere el artículo 8, apartados 1, 2 y 2 bis, del Reglamento (UE) 2019/2088 y el artículo 6, párrafo primero, del Reglamento (UE) 2020/852

Nombre del producto: Threadneedle (Lux) Global Select

Identificador de entidad jurídica: 5493004VNS7Y85HXL113

Características medioambientales o sociales

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☒ ☐ ☐ Sí	☒ ☐ ☒ No
☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental: ____%	☐ Promovió características medioambientales o sociales y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del ____% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo social: ____%	☐ con un objetivo social
	☒ Promovió características medioambientales o sociales, pero no realizó ninguna inversión sostenible



¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

El producto financiero promovió características medioambientales y sociales mediante la integración de las siguientes medidas de inversión responsable en el proceso de toma de decisiones de inversión:

- Compararse favorablemente con el índice en criterios ESG importantes, medidos por el modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle, durante periodos consecutivos de 12 meses.
- Mantener al menos el 50 % de las participaciones de la cartera en empresas con una calificación de 1-3 de materialidad ESG de Columbia Threadneedle. Cuando sea necesario, asesorar a las empresas que no estén cubiertas por el Modelo de calificación de materialidad ESG a través de un análisis fundamental, o implicarse con empresas con una calificación de materialidad ESG baja para fomentar su mejora, con el fin de lograr este compromiso mínimo del 50 %.
- Excluir a las empresas que infrinjan las normas y principios internacionales aceptados, como el Pacto Mundial de las Naciones Unidas y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos.
- Excluir a las empresas con participación en armas controvertidas, de conformidad con la Política sobre armas controvertidas de Columbia Threadneedle, y a las empresas con participación directa en armas nucleares.
- Con el fin de apoyar la promoción de las características medioambientales y sociales, establecer un compromiso con las empresas para influir en los equipos de dirección y mejorar sus prácticas, por ejemplo, en cuestiones relacionadas con las emisiones de carbono.

● **¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?**

El producto financiero tiene los siguientes indicadores de sostenibilidad:

- El indicador principal es la calificación media ponderada positiva de la materialidad ESG de la cartera frente al MSCI All Countries World Index, que se evalúa durante periodos consecutivos de 12 meses. Nuestros sistemas de cumplimiento supervisaron diariamente la calificación positiva de materialidad ESG en relación con el índice. La cartera mantuvo una mejor calificación de materialidad ESG que el índice de referencia durante todo el periodo. El 31 de marzo de 2023, la calificación de la cartera era 2,54 y la del índice de referencia era 2,78 (en una escala del 1 al 5, en la que la calificación más baja es la mejor).
- Invertimos al menos el 50 % de la cartera en empresas con una calificación de materialidad ESG alta. Cuando sea necesario, podremos asesorar a las empresas que no estén cubiertas por su Modelo de calificación de materialidad ESG a través de un análisis fundamental, o implicarnos con empresas con una calificación de materialidad ESG baja para fomentar su mejora, con el fin de lograr este compromiso mínimo del 50 %. El producto financiero mantuvo más del 50 % de sus participaciones en empresas con una calificación de 1-3 durante el periodo.
- Excluimos empresas que determinamos que incumplían las normas internacionales aceptadas, por ejemplo, los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas. La política de exclusión se respetó con la aplicación de estrictas restricciones previas a la negociación y se realizó un seguimiento continuo.
- También cumplimos nuestra política sobre armas controvertidas y excluimos a empresas con participación directa en armas nucleares.

Dado que estos indicadores constituyen la base de las características medioambientales o sociales promovidas por el producto financiero, también son los elementos vinculantes de la estrategia ESG de la cartera.

● **¿...y en comparación con períodos anteriores?**

En el próximo informe incluiremos una comparación de los indicadores de sostenibilidad con un período anterior.

● **¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

● **¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— **¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— **¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

La taxonomía de la UE establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la Unión.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente ningún objetivo medioambiental o social.

Las principales incidencias adversas son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.



¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a tener en cuenta las principales incidencias adversas de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad.



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen la **mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia.

Inversiones más importantes	Sector	Ponderación media	País
MICROSOFT CORP	5,84 %	Tecnologías de la información	Estados Unidos
ALPHABET INC CLASS A	4,21 %	Servicios de comunicación	Estados Unidos
AMAZON COM INC	3,97 %	Consumo discrecional	Estados Unidos
MASTERCARD INC CLASS A	3,21 %	Servicios financieros	Estados Unidos
T MOBILE US INC	2,80 %	Servicios de comunicación	Estados Unidos
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2,64 %	Tecnologías de la información	Taiwán (República de China)
TOTALENERGIES	2,14 %	Energía	Francia
JPMORGAN CHASE	2,09 %	Servicios financieros	Estados Unidos
INTUIT INC	1,93 %	Tecnologías de la información	Estados Unidos
HDFC BANK LTD	1,92 %	Servicios financieros	India
NESTLE SA	1,85 %	Bienes de consumo básicos	Suiza
SCHNEIDER ELECTRIC	1,77 %	Productos industriales	Francia
NOVO NORDISK CLASS B	1,72 %	Atención sanitaria	Dinamarca
QUALCOMM INC	1,71 %	Tecnologías de la información	Estados Unidos
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,64 %	Atención sanitaria	Estados Unidos



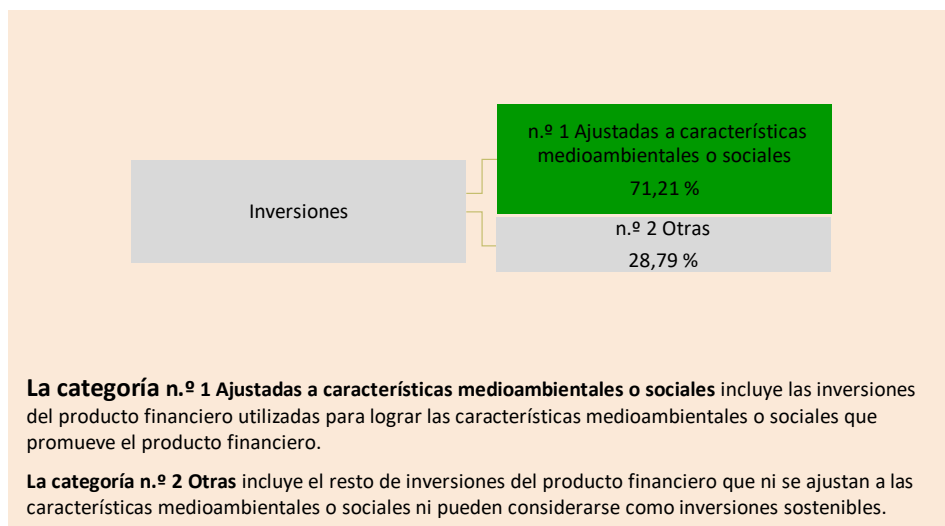
¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

● ¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 71,21 % del producto financiero se invirtió en empresas con una calificación de materialidad ESG de 1-3, por lo que se ajustaban a las características medioambientales y sociales.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

El 28,79 % del producto financiero se invirtió en: (1) empresas con una calificación de materialidad ESG de 4 o 5 que, por lo tanto, no se ajustaban a las características medioambientales y sociales, (2) empresas no cubiertas por el modelo de materialidad ESG, y (3) efectivo y derivados.



● ¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Sector	Ponderación media
Tecnologías de la información	23,24 %
Servicios financieros	16,50 %
Atención sanitaria	12,84 %
Servicios de comunicación	10,32 %
Productos industriales	7,99 %
Consumo discrecional	7,54 %
Materiales	5,57 %
Bienes de consumo básicos	4,30 %
Energía	4,17 %
Servicios públicos	3,11 %
Propiedades inmobiliarias	2,22 %
Ninguna	2,19 %

Para cumplir la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos.

Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental.

Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:

- El **volumen de negocios**, que refleja el porcentaje de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo (CapEx)**, que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación (OpEx)**, que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

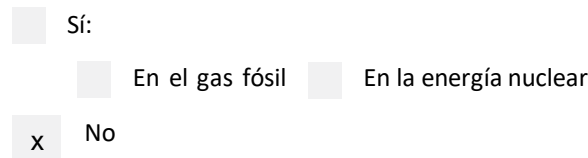


¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

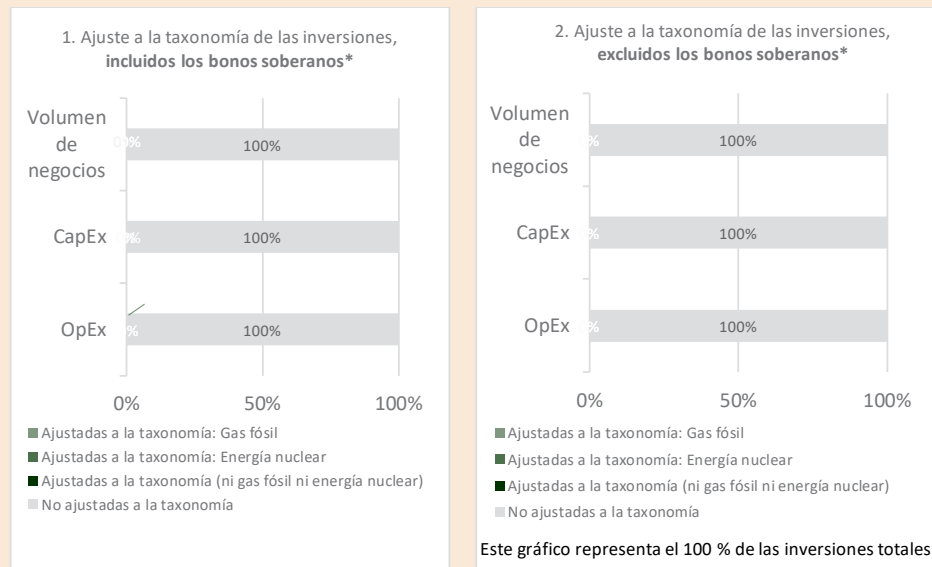
El fondo no se compromete a cumplir los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles, tal como se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplieran la taxonomía de la UE¹?



Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos*, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.



* A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas.

¹Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

● **¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transición y facilitadoras?**

El 0 % de las inversiones realizadas por el fondo se realizan en actividades de transición y facilitadoras, según se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

● **¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?**

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE. El fondo aún no ha comunicado ninguna adaptación al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



son

inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

No es aplicable: el fondo no tiene el compromiso de invertir en inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que no se ajusten al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

No es aplicable: el fondo no se compromete a invertir en inversiones sostenibles con un objetivo social



¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

Las participaciones clasificadas como «Otras» incluyen (i) activos líquidos auxiliares (a saber, depósitos bancarios a la vista) que se mantienen con fines de gestión de la liquidez; (ii) depósitos bancarios, instrumentos del mercado monetario o fondos del mercado monetario mantenidos con fines de tesorería; (iii) derivados con fines de cobertura; (iv) empresas con una calificación de materialidad ESG de 4 o 5; o (v) empresas no cubiertas por el modelo de materialidad ESG.

Estas inversiones no se utilizan para lograr las características medioambientales y sociales de la cartera. El objetivo de estos valores es proporcionar una cartera diversificada que pueda alcanzar el objetivo financiero.

Las garantías medioambientales o sociales mínimas se aseguran mediante la realización de un análisis de exclusión a todas las participaciones en empresas participadas. En el caso de las posiciones en efectivo y derivados, las consideraciones ESG se integran en la evaluación del riesgo de contraparte.



¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

Hemos colaborado con distintas empresas con el objetivo de influir en su enfoque de los riesgos y las prácticas ESG. Por ejemplo, durante el periodo, participamos en posiciones de la cartera con distintos temas. Incluimos, entre otros, la implicación con: una empresa inmobiliaria para comprender mejor sus acciones de mitigación de las emisiones y de reducción del uso del agua; una empresa de atención sanitaria sobre el tema del marketing ético y el uso no aprobado de uno de sus medicamentos.



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

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo difiere el índice de referencia de un índice general de mercado?*

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo se ha comportado este producto financiero con respecto a los indicadores de sostenibilidad para determinar la conformidad del índice de referencia con las características medioambientales o sociales que promueve?*

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

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

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice general de mercado?*

Durante el periodo, el producto financiero mantuvo un perfil ESG superior al del MSCI All Countries World Index, según las mediciones del modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

Plantilla de información periódica de los productos financieros a que se refiere el artículo 8, apartados 1, 2 y 2 bis, del Reglamento (UE) 2019/2088 y el artículo 6, párrafo primero, del Reglamento (UE) 2020/852

Nombre del producto: Threadneedle (Lux) Global Smaller Companies

Identificador de entidad jurídica: 549300U3LV1YG52NP397

Características medioambientales o sociales

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?	
☒ ☐ Sí	☒ ☐ No
☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental: ____% ☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ Promovió características medioambientales o sociales y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del ____% de inversiones sostenibles ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo social
☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo social: ____%	☒ Promovió características medioambientales o sociales, pero no realizó ninguna inversión sostenible



¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

Los indicadores de sostenibilidad miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

El producto financiero promovió características medioambientales y sociales mediante la integración de las siguientes medidas de inversión responsable en el proceso de toma de decisiones de inversión:

- Compararse favorablemente con el índice en criterios ESG importantes, medidos por el modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle, durante periodos consecutivos de 12 meses.
- Mantener al menos el 50 % de las participaciones de la cartera en empresas con una calificación de 1-3 de materialidad ESG de Columbia Threadneedle. Cuando sea necesario, asesorar a las empresas que no estén cubiertas por el Modelo de calificación de materialidad ESG a través de un análisis fundamental, o implicarse con empresas con una calificación de materialidad ESG baja para fomentar su mejora, con el fin de lograr este compromiso mínimo del 50 %.
- Excluir a las empresas que infrinjan las normas y principios internacionales aceptados, como el Pacto Mundial de las Naciones Unidas y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos.
- Excluir a las empresas con participación en armas controvertidas, de conformidad con la Política sobre armas controvertidas de Columbia Threadneedle, y a las empresas con participación directa en armas nucleares.
- Con el fin de apoyar la promoción de las características medioambientales y sociales, establecer un compromiso con las empresas para influir en los equipos de dirección y mejorar sus prácticas, por ejemplo, en cuestiones relacionadas con las emisiones de carbono.

● **¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?**

El producto financiero tiene los siguientes indicadores de sostenibilidad:

- El indicador principal es la calificación media ponderada positiva de la materialidad ESG de la cartera frente al MSCI World Small Cap Index, que se evalúa durante periodos consecutivos de 12 meses. Nuestros sistemas de cumplimiento supervisaron diariamente la calificación positiva de materialidad ESG en relación con el índice. La cartera mantuvo una mejor calificación de materialidad ESG que el índice de referencia durante todo el periodo. El 31 de marzo de 2023, la calificación de la cartera era 2,70 y la del índice de referencia era 2,99 (en una escala del 1 al 5, en la que la calificación más baja es la mejor).
- Invertimos al menos el 50 % de la cartera en empresas con una calificación de materialidad ESG alta. Cuando sea necesario, podremos asesorar a las empresas que no estén cubiertas por su Modelo de calificación de materialidad ESG a través de un análisis fundamental, o implicarnos con empresas con una calificación de materialidad ESG baja para fomentar su mejora, con el fin de lograr este compromiso mínimo del 50 %. El producto financiero mantuvo más del 50 % de sus participaciones en empresas con una calificación de 1-3 durante el periodo.
- Excluimos empresas que determinamos que incumplían las normas internacionales aceptadas, por ejemplo, los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas. La política de exclusión se respetó con la aplicación de estrictas restricciones previas a la negociación y se realizó un seguimiento continuo.
- También cumplimos nuestra política sobre armas controvertidas y excluimos a empresas con participación directa en armas nucleares.

Dado que estos indicadores constituyen la base de las características medioambientales o sociales promovidas por el producto financiero, también son los elementos vinculantes de la estrategia ESG de la cartera.

● **¿...y en comparación con períodos anteriores?**

En el próximo informe incluiremos una comparación de los indicadores de sostenibilidad con un período anterior.

● **¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

● **¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— ¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— ¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

La taxonomía de la UE establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la Unión.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente ningún objetivo medioambiental o social.

Las principales incidencias adversas son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.



¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a tener en cuenta las principales incidencias adversas de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad.



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen la mayor parte de las inversiones del producto financiero durante el período de referencia.

Inversiones más importantes	Sector	Ponderación media	País
KADANT INC	2,05 %	Productos industriales	Estados Unidos
WILLSCOT MOBILE MINI HOLDINGS CORP	2,02 %	Productos industriales	Estados Unidos
ALTAIR ENGINEERING INC CLASS A	1,98 %	Tecnologías de la información	Estados Unidos
CONMED CORP	1,79 %	Atención sanitaria	Estados Unidos
MSA SAFETY INC	1,74 %	Productos industriales	Estados Unidos
ARMSTRONG WORLD INDUSTRIES INC	1,73 %	Productos industriales	Estados Unidos
WORKIVA INC CLASS A	1,65 %	Tecnologías de la información	Estados Unidos
AAON INC	1,55 %	Productos industriales	Estados Unidos
SIMPSON MANUFACTURING INC	1,54 %	Productos industriales	Estados Unidos
CARGOJET INC	1,53 %	Productos industriales	Canadá
SIG GROUP N AG	1,50 %	Materiales	Suiza
GAMES WORKSHOP GROUP PLC	1,49 %	Consumo discrecional	Reino Unido
LESLIES INC	1,48 %	Consumo discrecional	Estados Unidos
SQUARE ENIX HLDG LTD	1,47 %	Servicios de comunicación	Japón
ADVANCED DRAINAGE SYSTEMS INC	1,44 %	Productos industriales	Estados Unidos



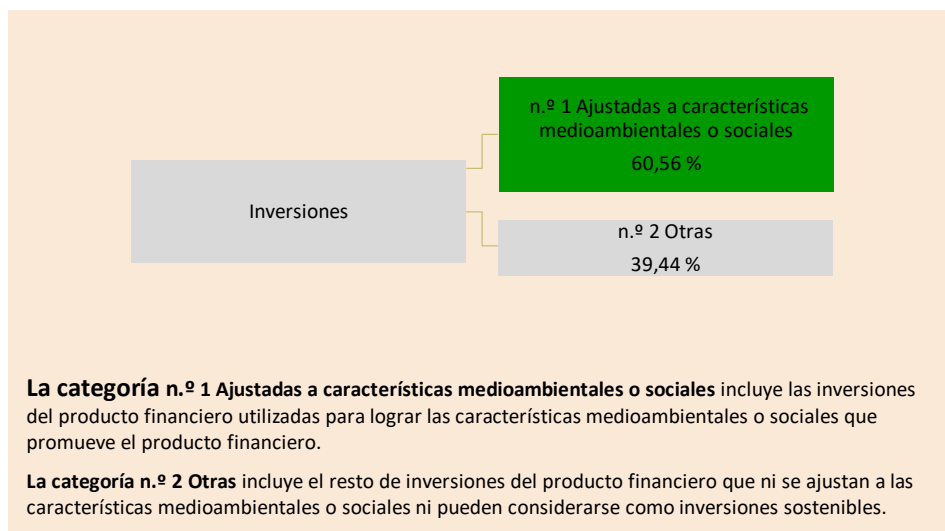
¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

● ¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 60,56 % del producto financiero se invirtió en empresas con una calificación de materialidad ESG de 1-3, por lo que se ajustaban a las características medioambientales y sociales.

La asignación de activos describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

El 39,44 % del producto financiero se invirtió en: (1) empresas con una calificación de materialidad ESG de 4 o 5 que, por lo tanto, no se ajustaban a las características medioambientales y sociales, (2) empresas no cubiertas por el modelo de materialidad ESG, y (3) efectivo y derivados.



● **¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?**

Sector	Ponderación media
Productos industriales	30,21 %
Tecnologías de la información	18,71 %
Atención sanitaria	15,27 %
Consumo discrecional	13,50 %
Servicios financieros	6,74 %
Servicios de comunicación	6,58 %
Bienes de consumo básicos	3,42 %
Materiales	2,82 %
Propiedades inmobiliarias	0,65 %
Efectivo	2,09 %

Para cumplir la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos.

Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental.

Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:

- El **volumen de negocios**, que refleja el porcentaje de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.

- La **inversión en activo fijo (CapEx)**, que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.

- Los **gastos de explotación (OpEx)**, que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

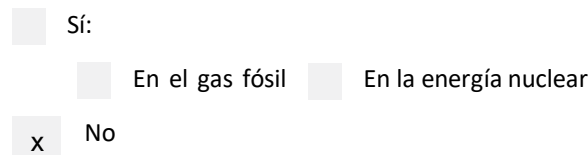


¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

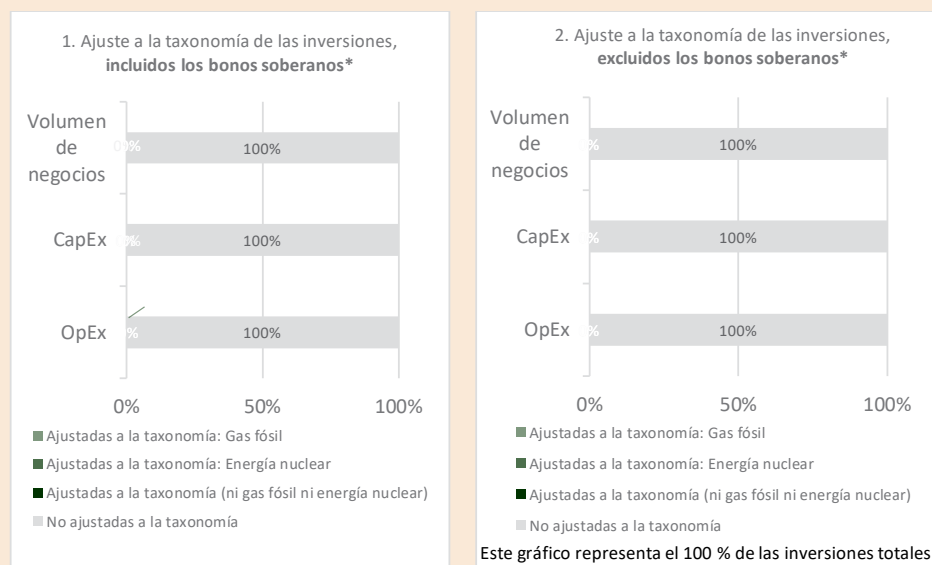
El fondo no se compromete a cumplir los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles, tal como se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE.

● ¿Invertió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplieran la taxonomía de la UE¹?



Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos*, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.



* A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas.

¹ Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

● **¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transición y facilitadoras?**

El 0 % de las inversiones realizadas por el fondo se realizan en actividades de transición y facilitadoras, según se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

● **¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?**

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE. El fondo aún no ha comunicado ninguna adaptación al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

No es aplicable: el fondo no tiene el compromiso de invertir en inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que no se ajusten al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

No es aplicable: el fondo no se compromete a invertir en inversiones sostenibles con un objetivo social



¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

Las participaciones clasificadas como «Otras» incluyen (i) activos líquidos auxiliares (a saber, depósitos bancarios a la vista) que se mantienen con fines de gestión de la liquidez; (ii) depósitos bancarios, instrumentos del mercado monetario o fondos del mercado monetario mantenidos con fines de tesorería; (iii) derivados con fines de cobertura; (iv) empresas con una calificación de materialidad ESG de 4 o 5; o (v) empresas no cubiertas por el modelo de materialidad ESG.

Estas inversiones no se utilizan para lograr las características medioambientales y sociales de la cartera. El objetivo de estos valores es proporcionar una cartera diversificada que pueda alcanzar el objetivo financiero.

Las garantías medioambientales o sociales mínimas se aseguran mediante la realización de un análisis de exclusión a todas las participaciones en empresas participadas. En el caso de las posiciones en efectivo y derivados, las consideraciones ESG se integran en la evaluación del riesgo de contraparte.



son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.



¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

Hemos colaborado con distintas empresas con el objetivo de influir en su enfoque de los riesgos y las prácticas ESG. Por ejemplo, durante el periodo, participamos en posiciones de la cartera con distintos temas. Incluimos, entre otras, la implicación con un banco estadounidense para comprender mejor la estructura de gobernanza de la empresa, específicamente en lo que respecta a la estructura del consejo de administración y su remuneración.



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

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo difiere el índice de referencia de un índice general de mercado?*

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo se ha comportado este producto financiero con respecto a los indicadores de sostenibilidad para determinar la conformidad del índice de referencia con las características medioambientales o sociales que promueve?*

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

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

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice general de mercado?*

Durante el periodo, el producto financiero mantuvo un perfil ESG superior al del MSCI World Small Cap Index, según las mediciones del modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Plantilla de información periódica de los productos financieros a que se refiere el artículo 8, apartados 1, 2 y 2 bis, del Reglamento (UE) 2019/2088 y el artículo 6, párrafo primero, del Reglamento (UE) 2020/852

Nombre del producto: Threadneedle (Lux) American Smaller Companies

Identificador de entidad jurídica: 549300FL849SFZ3EMB26

Características medioambientales o sociales

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?	
☒ ☐ Sí	☒ ☐ No
☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental: ____% ☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ Promovió características medioambientales o sociales y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del ____% de inversiones sostenibles ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo social
☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo social: ____%	☒ Promovió características medioambientales o sociales, pero no realizó ninguna inversión sostenible



¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

Los indicadores de sostenibilidad miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

El producto financiero promovió características medioambientales y sociales mediante la integración de las siguientes medidas de inversión responsable en el proceso de toma de decisiones de inversión:

- Compararse favorablemente con el índice en criterios ESG importantes, medidos por el modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle, durante periodos consecutivos de 12 meses.
- Mantener al menos el 50 % de las participaciones de la cartera en empresas con una calificación de 1-3 de materialidad ESG de Columbia Threadneedle. Cuando sea necesario, asesorar a las empresas que no estén cubiertas por el Modelo de calificación de materialidad ESG a través de un análisis fundamental, o implicarse con empresas con una calificación de materialidad ESG baja para fomentar su mejora, con el fin de lograr este compromiso mínimo del 50 %.
- Excluir a las empresas que infrinjan las normas y principios internacionales aceptados, como el Pacto Mundial de las Naciones Unidas y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos.
- Excluir a las empresas con participación en armas controvertidas, de conformidad con la Política sobre armas controvertidas de Columbia Threadneedle, y a las empresas con participación directa en armas nucleares.
- Con el fin de apoyar la promoción de las características medioambientales y sociales, establecer un compromiso con las empresas para influir en los equipos de dirección y mejorar sus prácticas, por ejemplo, en cuestiones relacionadas con las emisiones de carbono.

● **¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?**

El producto financiero tiene los siguientes indicadores de sostenibilidad:

- El indicador principal es la calificación media ponderada positiva de la materialidad ESG de la cartera frente al Russell 2500 Index, que se evalúa durante periodos consecutivos de 12 meses. Nuestros sistemas de cumplimiento supervisaron diariamente la calificación positiva de materialidad ESG en relación con el índice. La cartera mantuvo una mejor calificación de materialidad ESG que el índice de referencia durante todo el periodo. El 31 de marzo de 2023, la calificación de la cartera era 2,41 y la del índice de referencia era 2,97 (en una escala del 1 al 5, en la que la calificación más baja es la mejor).
- Invertimos al menos el 50 % de la cartera en empresas con una calificación de materialidad ESG alta. Cuando sea necesario, podremos asesorar a las empresas que no estén cubiertas por su Modelo de calificación de materialidad ESG a través de un análisis fundamental, o implicarnos con empresas con una calificación de materialidad ESG baja para fomentar su mejora, con el fin de lograr este compromiso mínimo del 50 %. El producto financiero mantuvo más del 50 % de sus participaciones en empresas con una calificación de 1-3 durante el periodo.
- Excluimos empresas que determinamos que incumplían las normas internacionales aceptadas, por ejemplo, los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas. La política de exclusión se respetó con la aplicación de estrictas restricciones previas a la negociación y se realizó un seguimiento continuo.
- También cumplimos nuestra política sobre armas controvertidas y excluimos a empresas con participación directa en armas nucleares.

Dado que estos indicadores constituyen la base de las características medioambientales o sociales promovidas por el producto financiero, también son los elementos vinculantes de la estrategia ESG de la cartera.

● **¿...y en comparación con períodos anteriores?**

En el próximo informe incluiremos una comparación de los indicadores de sostenibilidad con un período anterior.

● **¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

● **¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

La taxonomía de la UE establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la Unión.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente ningún objetivo medioambiental o social.



¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a tener en cuenta las principales incidencias adversas de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad.



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

	Inversiones más importantes	Sector	Ponderación media	País
La lista incluye las inversiones que constituyen la mayor parte de las inversiones del producto financiero durante el período de referencia.	WILLSCOT MOBILE MINI HOLDINGS CORP	Productos industriales	3,83 %	Estados Unidos
	AVISTA CORP	Servicios públicos	3,76 %	Estados Unidos
	CONMED CORP	Atención sanitaria	3,54 %	Estados Unidos
	CARRIAGE SERVICES INC	Consumo discrecional	3,32 %	Estados Unidos
	NEWPARK RESOURCES INC	Energía	3,12 %	Estados Unidos
	VOYA FINANCIAL INC	Servicios financieros	2,97 %	Estados Unidos
	KONTOOR BRANDS INC	Consumo discrecional	2,90 %	Estados Unidos
	MOELIS CLASS A	Servicios financieros	2,53 %	Estados Unidos
	HOULIHAN LOKEY INC CLASS A	Servicios financieros	2,47 %	Estados Unidos
	VIRTU FINANCIAL INC CLASS A	Servicios financieros	2,41 %	Estados Unidos
	NOV INC	Energía	2,35 %	Estados Unidos
	FTI CONSULTING INC	Productos industriales	2,29 %	Estados Unidos
	SCHNITZER STEEL INDUSTRIES INC CLA	Materiales	2,16 %	Estados Unidos
	MATTHEWS INTERNATIONAL CORP CLASS	Productos industriales	2,15 %	Estados Unidos
	ESSENT GROUP LTD	Servicios financieros	1,92 %	Estados Unidos

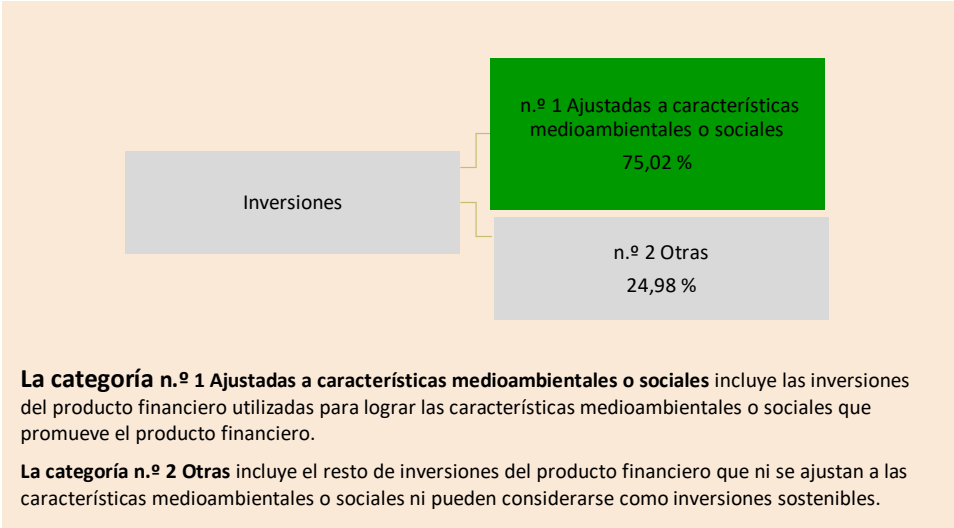


¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

● ¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 75,02 % del producto financiero se invirtió en empresas con una calificación de materialidad ESG de 1-3, por lo que se ajustaban a las características medioambientales y sociales.

El 24,98 % del producto financiero se invirtió en: (1) empresas con una calificación de materialidad ESG de 4 o 5 que, por lo tanto, no se ajustaban a las características medioambientales y sociales, (2) empresas no cubiertas por el modelo de materialidad ESG, y (3) efectivo y derivados.



Para cumplir la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos.

Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental.

Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

● ¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Sector	Ponderación media
Productos industriales	18,55 %
Servicios financieros	15,65 %
Consumo discrecional	13,46 %
Atención sanitaria	11,91 %
Tecnologías de la información	11,28 %
Materiales	6,48 %
Bienes de consumo básicos	6,27 %
Energía	5,66 %
Servicios públicos	3,76 %
Propiedades inmobiliarias	3,02 %
Efectivo	2,54 %
Servicios de comunicación	1,43 %

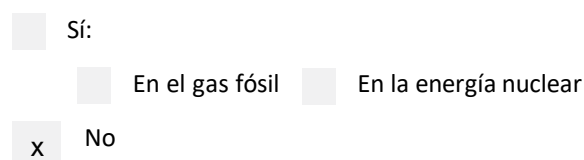


¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

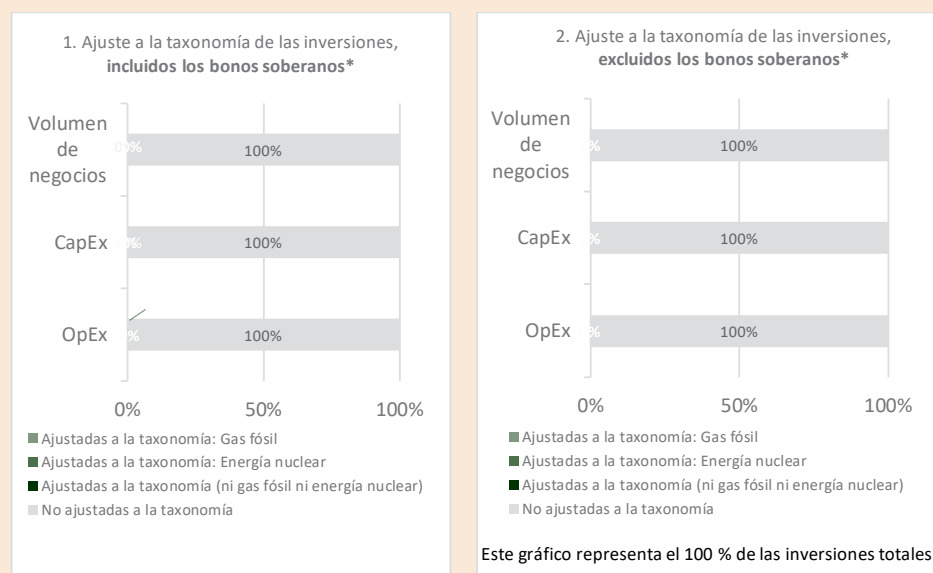
El fondo no se compromete a cumplir los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles, tal como se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE.

● **¿Invertió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplieran la taxonomía de la UE¹?**



Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos*, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.



* A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas.

¹Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

● **¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transición y facilitadoras?**

El 0 % de las inversiones realizadas por el fondo se realizan en actividades de transición y facilitadoras, según se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

● **¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?**

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE. El fondo aún no ha comunicado ninguna adaptación al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

No es aplicable: el fondo no tiene el compromiso de invertir en inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que no se ajusten al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

No es aplicable: el fondo no se compromete a invertir en inversiones sostenibles con un objetivo social



¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

Las participaciones clasificadas como «Otras» incluyen (i) activos líquidos auxiliares (a saber, depósitos bancarios a la vista) que se mantienen con fines de gestión de la liquidez; (ii) depósitos bancarios, instrumentos del mercado monetario o fondos del mercado monetario mantenidos con fines de tesorería; (iii) derivados con fines de cobertura; (iv) empresas con una calificación de materialidad ESG de 4 o 5; o (v) empresas no cubiertas por el modelo de materialidad ESG.

Estas inversiones no se utilizan para lograr las características medioambientales y sociales de la cartera. El objetivo de estos valores es proporcionar una cartera diversificada que pueda alcanzar el objetivo financiero.

Las garantías medioambientales o sociales mínimas se aseguran mediante la realización de un análisis de exclusión a todas las participaciones en empresas participadas. En el caso de las posiciones en efectivo y derivados, las consideraciones ESG se integran en la evaluación del riesgo de contraparte.



¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

Hemos colaborado con distintas empresas con el objetivo de influir en su enfoque de los riesgos y las prácticas ESG.

Por ejemplo, durante el periodo, nos pusimos en contacto con Livent para tratar los temas medioambientales y sociales clave que les afectaban y su capacidad para conservar una licencia para operar. La empresa es consciente de que la licencia para operar es fundamental y afirma estar dando prioridad a los derechos humanos, estableciendo relaciones con la comunidad y garantizando que se satisfagan las demandas de los clientes de cadenas de suministro bien auditadas y con menor impacto. La sede con el perfil más alto de la empresa se encuentra en Argentina, donde históricamente han tenido problemas con protestas contra la minería. Han trabajado con una ONG afiliada a la ONU para organizar eventos municipales para la población local y son conscientes de la necesidad de mantener un consentimiento libre, previo e informado de forma continua. El deseo de proceder con las operaciones de una manera que también beneficie a las comunidades es uno de los principales motivos de intentar conseguir la acreditación de la IRMA (Iniciativa para la Garantía de una Minería Responsable). Otro de los motivos es que los fabricantes de equipos originales (clientes de Livent) están en el consejo de administración de la IRMA y están empujando a los proveedores en esta dirección debido a la importancia que le dan a la trazabilidad de las cadenas de suministro y a la reducción del carbono. El agua es un tema importante en la extracción de litio, por lo que la empresa ha establecido contactos con las autoridades gubernamentales locales y las universidades estadounidenses para llevar a cabo un estudio hidrogeológico de la zona, que establece que no están tan expuestos al estrés hídrico como sus homólogas debido a las peculiaridades geográficas locales. Están sometidos a fuertes controles en la región y mantienen una continua comunicación con las comunidades locales, así como con las autoridades, sobre el consumo de agua. Livent se ha fijado el objetivo de conseguir cero emisiones netas para 2040, pero solo un objetivo de reducción de la intensidad de GEI del 30 % para 2030, lo que implica reducciones significativas después de 2030. A corto plazo, están trabajando en la optimización de procesos y confían en cumplir el objetivo de 2030. Sin embargo, a largo plazo, pueden tener problemas a la hora de conseguir energías renovables. La información de la empresa sigue siendo escasa y los planes de reducción de su impacto en la naturaleza no están claros. En general, Livent tiene un enfoque sólido de los problemas medioambientales y sociales para una empresa de su tamaño, sin embargo, necesitará planes más tangibles e informar mejor sobre cómo están reduciendo las emisiones, el consumo de agua y su impacto en la naturaleza, así como enfoques más claros y reforzados en relación con los derechos humanos y las relaciones con la comunidad.

También nos pusimos en contacto con Medpace para que nos explicase la importancia de la diversidad en los ensayos clínicos a nosotros como inversores. Aumentamos nuestro interés por obtener más información sobre la estrategia de la empresa y, al mismo tiempo, fomentar una mayor transparencia del sector en temas como el fomento de la confianza con participantes (históricamente) poco representados en los ensayos, la incentivación de la participación en ensayos (p. ej., recompensas, desafíos en las infraestructuras, ensayos descentralizados), prácticas de contratación, sensibilización interna y creación de capacidades, colaboración con los grupos de interesados pertinentes, como grupos de

pacientes e iniciativas industriales, y seguimiento de la eficacia de la diversidad en la estrategia de ensayos clínicos, incluida la recopilación de datos y el uso de los hallazgos para adaptar los enfoques. Acabamos nuestro correo electrónico con una llamada al compromiso.



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

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo difiere el índice de referencia de un índice general de mercado?*

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo se ha comportado este producto financiero con respecto a los indicadores de sostenibilidad para determinar la conformidad del índice de referencia con las características medioambientales o sociales que promueve?*

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

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

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice general de mercado?*

Durante el periodo, el producto financiero mantuvo un perfil ESG superior al del Russell 2500 Index, según las mediciones del modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Plantilla de información periódica de los productos financieros a que se refiere el artículo 8, apartados 1, 2 y 2 bis, del Reglamento (UE) 2019/2088 y el artículo 6, párrafo primero, del Reglamento (UE) 2020/852

Nombre del producto: Threadneedle (Lux) Asia Equities

Identificador de entidad jurídica: 549300NJZV56FVQ648

Características medioambientales o sociales

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?	
☒ ☐ Sí	☒ ☐ No
☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental: ____% ☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ Promovió características medioambientales o sociales y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del ____% de inversiones sostenibles ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo social
☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo social: ____%	☒ Promovió características medioambientales o sociales, pero no realizó ninguna inversión sostenible



¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

Los indicadores de sostenibilidad miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

El producto financiero promovió características medioambientales y sociales mediante la integración de las siguientes medidas de inversión responsable en el proceso de toma de decisiones de inversión:

- Compararse favorablemente con el índice en criterios ESG importantes, medidos por el modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle, durante periodos consecutivos de 12 meses.
- Mantener al menos el 50 % de las participaciones de la cartera en empresas con una calificación de 1-3 de materialidad ESG de Columbia Threadneedle. Cuando sea necesario, asesorar a las empresas que no estén cubiertas por el Modelo de calificación de materialidad ESG a través de un análisis fundamental, o implicarse con empresas con una calificación de materialidad ESG baja para fomentar su mejora, con el fin de lograr este compromiso mínimo del 50 %.
- Excluir a los emisores que infrinjan las normas y principios internacionales aceptados, como el Pacto Mundial de las Naciones Unidas y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos.
- Excluir a los emisores con participación en armas controvertidas, de conformidad con la Política sobre armas controvertidas de Columbia Threadneedle, y a los emisores con participación directa en armas nucleares.
- Con el fin de apoyar la promoción de las características medioambientales y sociales, establecer un compromiso con las empresas para influir en los equipos de dirección y mejorar sus prácticas, por ejemplo, en cuestiones relacionadas con las emisiones de carbono.

● ***¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?***

El producto financiero tiene los siguientes indicadores de sostenibilidad:

- El indicador principal es la calificación media ponderada positiva de la materialidad ESG de la cartera frente al MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index, que se evalúa durante periodos consecutivos de 12 meses. Nuestros sistemas de cumplimiento supervisaron diariamente la calificación positiva de materialidad ESG en relación con el índice. La cartera mantuvo una mejor calificación de materialidad ESG que el índice de referencia durante todo el periodo. El 31 de marzo de 2023, la calificación de la cartera era 2,12 y la del índice de referencia era 2,30 (en una escala del 1 al 5, en la que la calificación más baja es la mejor).
- Invertimos al menos el 50 % de la cartera en empresas con una calificación de materialidad ESG alta. Cuando sea necesario, podremos asesorar a las empresas que no estén cubiertas por su Modelo de calificación de materialidad ESG a través de un análisis fundamental, o implicarnos con empresas con una calificación de materialidad ESG baja para fomentar su mejora, con el fin de lograr este compromiso mínimo del 50 %. El producto financiero mantuvo más del 50 % de sus participaciones en emisores con una calificación de 1-3 durante el periodo.
- Excluimos empresas que determinamos que incumplían las normas internacionales aceptadas, por ejemplo, los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas. La política de exclusión se respetó con la aplicación de estrictas restricciones previas a la negociación y se realizó un seguimiento continuo.
- También cumplimos nuestra política sobre armas controvertidas y excluimos a emisores con participación directa en armas nucleares.

Dado que estos indicadores constituyen la base de las características medioambientales o sociales promovidas por el producto financiero, también son los elementos vinculantes de la estrategia ESG de la cartera.

● **¿...y en comparación con períodos anteriores?**

En el próximo informe incluiremos una comparación de los indicadores de sostenibilidad con un período anterior.

● **¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

● **¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— **¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— **¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

La taxonomía de la UE establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la Unión.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente ningún objetivo medioambiental o social.

Las principales incidencias adversas son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.



¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a tener en cuenta las principales incidencias adversas de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad.



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen la **mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es:

Inversiones más importantes	Ponderación media	País	Sector
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	7,55 %	Taiwán (República de China)	Tecnologías de la información
SAMSUNG ELECTRONICS LTD	4,18 %	Corea del Sur, República de	Tecnologías de la información
TENCENT HOLDINGS LTD	3,80 %	China	Servicios de comunicación
AIA GROUP LTD	3,57 %	Hong Kong	Servicios financieros
RELIANCE INDUSTRIES LTD	3,00 %	India	Energía
MACQUARIE GROUP LTD DEF	2,65 %	Australia	Servicios financieros
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	2,63 %	Australia	Servicios financieros
JD.COM CLASS A INC	2,51 %	China	Consumo discrecional
CSL LTD	2,32 %	Australia	Atención sanitaria
BANK RAKYAT INDONESIA (PERSERO)	2,32 %	Indonesia	Servicios financieros
MEITUAN	2,29 %	China	Consumo discrecional
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,26 %	China	Consumo discrecional
UNITED OVERSEAS BANK LTD	2,21 %	Singapur	Servicios financieros
HDFC BANK LTD	2,18 %	India	Servicios financieros
SANTOS LTD	2,16 %	Australia	Energía



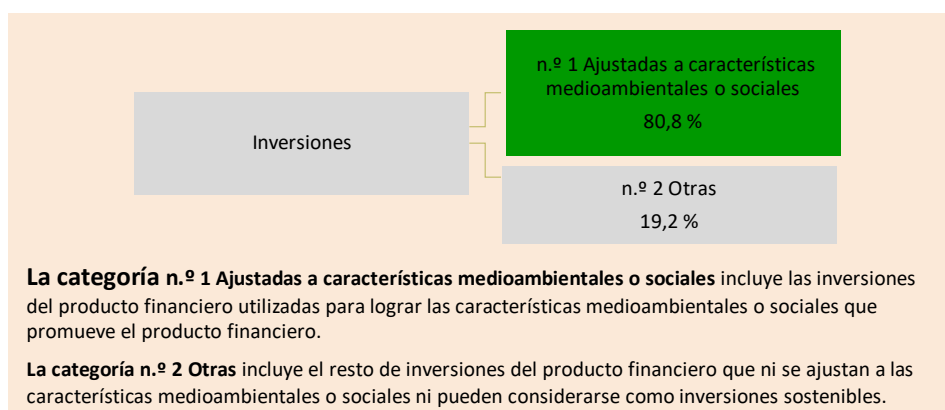
¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

● ¿Cuál ha sido la asignación de activos?

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

El 80,8 % del producto financiero se invirtió en emisores con una calificación de materialidad ESG de 1-3, por lo que se ajustaban a las características medioambientales y sociales.

El 19,2 % del producto financiero se invirtió en: (1) emisores con una calificación de materialidad ESG de 4 o 5 que, por lo tanto, no se ajustaban a las características medioambientales y sociales, (2) emisores no cubiertos por el modelo de materialidad ESG, y (3) efectivo y derivados.



● ¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Sector	Ponderación media
Servicios financieros	25,16 %
Tecnologías de la información	18,88 %
Consumo discrecional	13,54 %
Servicios de comunicación	9,67 %
Materiales	6,84 %
Energía	6,02 %
Productos industriales	4,73 %
Bienes de consumo básicos	4,67 %
Atención sanitaria	4,50 %
Propiedades inmobiliarias	4,07 %

Para cumplir la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos.

Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental.

Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.



¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El fondo no se compromete a cumplir los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles, tal como se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplieran la taxonomía de la UE¹?

☐ Sí:

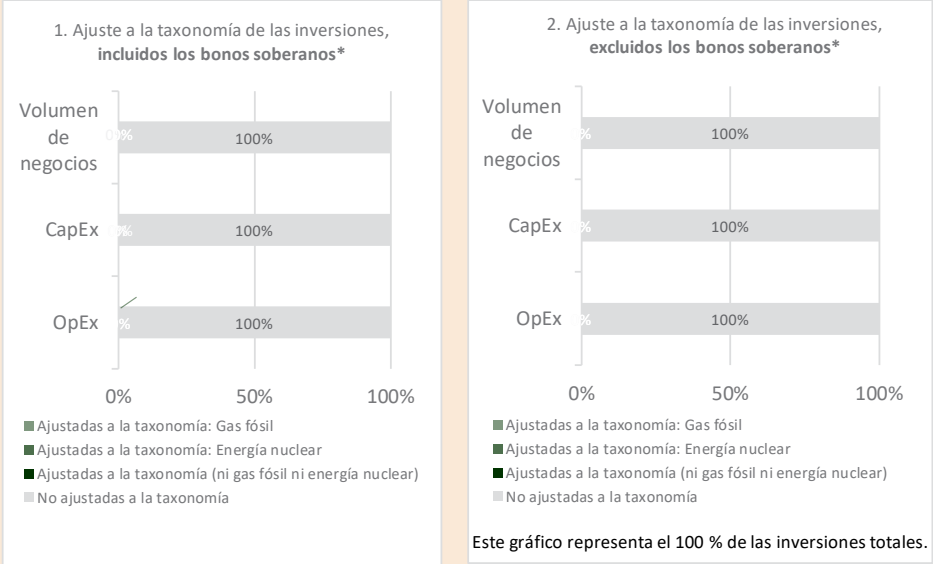
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:

- El **volumen de negocios**, que refleja el porcentaje de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo (CapEx)**, que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación (OpEx)**, que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos*, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.



● **¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transición y facilitadoras?**

El 0 % de las inversiones realizadas por el fondo se realizan en actividades de transición y facilitadoras, según se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

● **¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?**

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE. El fondo aún no ha comunicado ninguna adaptación al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

No es aplicable: el fondo no tiene el compromiso de invertir en inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que no se ajusten al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

No es aplicable: el fondo no se compromete a invertir en inversiones sostenibles con un objetivo social



¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

Las participaciones clasificadas como «Otras» incluyen (i) activos líquidos auxiliares (a saber, depósitos bancarios a la vista) que se mantienen con fines de gestión de la liquidez; (ii) depósitos bancarios, instrumentos del mercado monetario o fondos del mercado monetario mantenidos con fines de tesorería; (iii) derivados con fines de cobertura; (iv) empresas con una calificación de materialidad ESG de 4 o 5; o (v) empresas no cubiertas por el modelo de materialidad ESG.

Estas inversiones no se utilizan para lograr las características medioambientales y sociales de la cartera. El objetivo de estos valores es proporcionar una cartera diversificada que pueda alcanzar el objetivo financiero.

Las garantías medioambientales o sociales mínimas se aseguran mediante la realización de un análisis de exclusión a todas las participaciones en empresas participadas. En el caso de las posiciones en efectivo y derivados, las consideraciones ESG se integran en la evaluación del riesgo de contraparte.



¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

Hemos colaborado con distintas empresas con el objetivo de influir en su enfoque de los riesgos y las prácticas ESG. Por ejemplo, nos hemos comprometido con Samsung Electronics de Corea para hacer un seguimiento con el equipo de RSC/IR de la empresa describiendo nuestras expectativas del diálogo anterior. Hicimos distintas recomendaciones, incluyendo ejemplos de casos de estudio específicos relativos a su proceso de gestión de productos químicos y sobre una divulgación más detallada de sus métricas de salud y seguridad en el trabajo. Además se incluyó la participación en la Red de Producción de Electrónica Limpia, y la formación de los trabajadores de las instalaciones en materia de libertad de asociación, con especial atención en los países donde las leyes laborales son más laxas. También dimos ejemplos de mejores prácticas para cada una de nuestras recomendaciones.

También colaboramos con Bank Rakyat. Se hizo una visita de colaboración con el director de relaciones con los inversores y el director de ESG. La visita se centró en su enfoque más amplio de la gobernanza de la sostenibilidad y la gestión de riesgos, así como en la gestión del riesgo climático. Analizamos su nueva hoja de ruta en cuestiones ESG y el proceso de gobernanza en temas ESG actualizado. En esto han hecho progresos y ahora cuentan con un equipo dedicado de ESG. En general, la visita resultó positiva y Bank Rakyat está haciendo buenos progresos. Se comprometieron a actualizar sus informes sobre TCFD, a financiar la divulgación de emisiones y a hacer un compromiso con las cero emisiones netas para principios de 2024. Mencionaron que les gustaría presentar unos objetivos basados en la ciencia. Esto resulta bastante ambicioso teniendo en cuenta donde se encuentran actualmente, por lo que continuaremos con la supervisión y nos implicaremos en sus avances en estas áreas.



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

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● ¿Cómo difiere el índice de referencia de un índice general de mercado?

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

- ***¿Cómo se ha comportado este producto financiero con respecto a los indicadores de sostenibilidad para determinar la conformidad del índice de referencia con las características medioambientales o sociales que promueve?***

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

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

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

- ***¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice general de mercado?***

Durante el periodo, el producto financiero mantuvo un perfil ESG superior al del MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index, según las mediciones del modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Plantilla de información periódica de los productos financieros a que se refiere el artículo 8, apartados 1, 2 y 2 bis, del Reglamento (UE) 2019/2088 y el artículo 6, párrafo primero, del Reglamento (UE) 2020/852

Nombre del producto: Threadneedle (Lux) Pan European ESG Equities

Identificador de entidad jurídica: 5493003HOJGB5U7D3492

Características medioambientales o sociales

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?	
☒ ☐ Sí	☒ ☐ No
☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental: ____% ☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo social: ____%	☐ Promovió características medioambientales o sociales y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del ____% de inversiones sostenibles ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo social ☒ Promovió características medioambientales o sociales, pero no realizó ninguna inversión sostenible



¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

Los indicadores de sostenibilidad miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

El producto financiero promovió características medioambientales y sociales mediante la integración de las siguientes medidas de inversión responsable en el proceso de toma de decisiones de inversión:

- Compararse favorablemente con el índice en criterios ESG importantes, medidos por el modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle, durante periodos consecutivos de 12 meses.
- Invertimos al menos el 80 % de la cartera en empresas con características ESG sólidas o en proceso de mejora, medidas mediante una combinación de la calificación de materialidad ESG y el análisis fundamental de las empresas de la cartera. La cartera tratará de priorizar a las empresas que obtengan una puntuación alta en la calificación de la materialidad ESG de Columbia Threadneedle, dando así a la cartera una inclinación positiva hacia las características ESG en comparación con las del MSCI Europe Index, durante periodos consecutivos de 12 meses. Se considera que todas las empresas con una calificación alta se ajustan a las características medioambientales o sociales promovidas por la cartera. Sin embargo, la cartera puede invertir en empresas con una calificación inferior que también se considere que se ajustan a las características medioambientales o sociales promovidas por la cartera, con arreglo a que, a pesar de dicha calificación (i) se determine, a través del análisis fundamental, que estos valores ya demuestran prácticas ESG sólidas o (ii) que disponen de margen para mejorar sus prácticas ESG. Tratamos de fomentar dichas mejoras mediante la aplicación de su política de participación.
- Excluir a las empresas que infrinjan las normas y principios internacionales aceptados, como el Pacto Mundial de las Naciones Unidas y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos.
- Excluir a las empresas con participación en armas controvertidas, de conformidad con la Política sobre armas controvertidas de Columbia Threadneedle, y a las empresas con participación directa en armas nucleares.
- Con el fin de apoyar la promoción de las características medioambientales y sociales, establecer un compromiso con las empresas para influir en los equipos de dirección y mejorar sus prácticas, por ejemplo, en cuestiones relacionadas con las emisiones de carbono.

● *¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?*

El producto financiero tiene los siguientes indicadores de sostenibilidad:

- El indicador principal es la calificación media ponderada positiva de la materialidad ESG de la cartera frente al MSCI Europe (Gross TR) Index, que se evalúa durante periodos consecutivos de 12 meses. Nuestros sistemas de cumplimiento supervisaron diariamente la calificación positiva de materialidad ESG en relación con el índice. La cartera mantuvo una mejor calificación de materialidad ESG que el índice de referencia durante todo el periodo. El 31 de marzo de 2023, la calificación de la cartera era 2,70 y la del índice de referencia era 2,79 (en una escala del 1 al 5, en la que la calificación más baja es la mejor).
- Invertimos al menos el 80 % de la cartera en empresas con características ESG sólidas o en proceso de mejora, medidas mediante una combinación de la calificación de materialidad ESG y el análisis fundamental de las empresas.
- Excluimos empresas que determinamos que incumplían las normas internacionales aceptadas, por ejemplo, los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas. La política de exclusión se respetó con la aplicación de estrictas restricciones previas a la negociación y se realizó un seguimiento continuo.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

- También cumplimos nuestra política sobre armas controvertidas y excluimos a empresas con participación directa en armas nucleares.

Dado que estos indicadores constituyen la base de las características medioambientales o sociales promovidas por el producto financiero, también son los elementos vinculantes de la estrategia ESG de la cartera.

● **¿...y en comparación con períodos anteriores?**

En el próximo informe incluiremos una comparación de los indicadores de sostenibilidad con un período anterior.

● **¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

● **¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— **¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— **¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

La taxonomía de la UE establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la Unión.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente ningún objetivo medioambiental o social.



¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a tener en cuenta las principales incidencias adversas de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad.



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen la **mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia.

Inversiones más importantes	Sector	Ponderación media	País
NOVO NORDISK CLASS B	Atención sanitaria	4,01 %	Dinamarca
ASML HOLDING NV	Tecnologías de la información	3,84 %	Países Bajos
LVMH	Consumo discrecional	3,82 %	Francia
NESTLE SA	Bienes de consumo básicos	3,73 %	Suiza
ROCHE HOLDING PAR AG	Atención sanitaria	3,70 %	Estados Unidos
ASTRAZENECA PLC	Atención sanitaria	3,38 %	Reino Unido
TOTALENERGIES	Energía	3,15 %	Francia
LOREAL SA	Bienes de consumo básicos	2,90 %	Francia
ASHTAD GROUP PLC	Productos industriales	2,29 %	Reino Unido
UBS GROUP AG	Servicios financieros	2,28 %	Suiza
CRH PLC	Materiales	2,18 %	Irlanda
SIKA AG	Materiales	2,12 %	Suiza
3I GROUP PLC	Servicios financieros	2,10 %	Reino Unido
VODAFONE GROUP PLC	Servicios de comunicación	2,07 %	Reino Unido
RIO TINTO PLC	Materiales	2,00 %	Reino Unido



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

Para cumplir la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos.

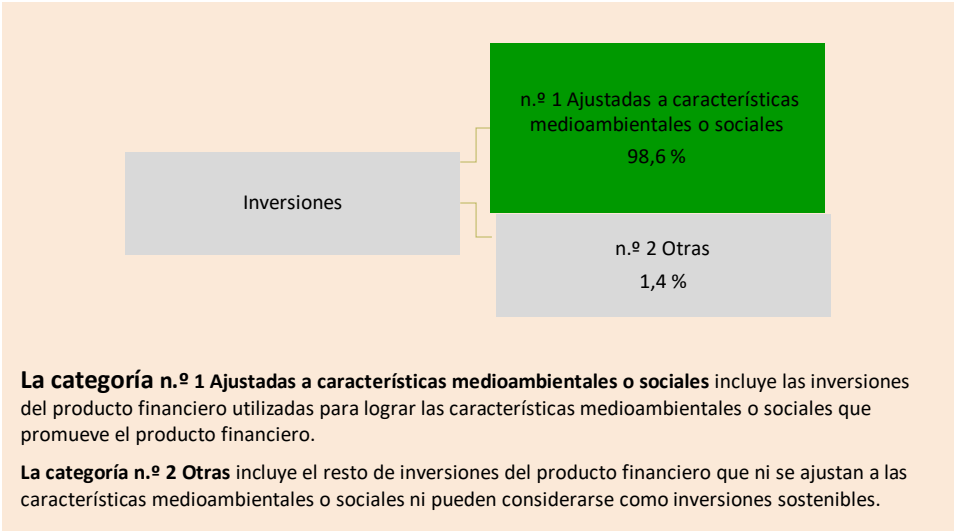
Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental.

Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

● ¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 98,6 % de la cartera se invirtió en empresas con características ESG sólidas o en proceso de mejora, medidas mediante una combinación de la calificación de materialidad ESG y el análisis fundamental de las empresas de la cartera.

El 1,4 % incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse inversiones sostenibles.



● ¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Sector	Ponderación media
Servicios de comunicación	3,7 %
Consumo discrecional	13,5 %
Bienes de consumo básicos	9,2 %
Energía	3,4 %
Servicios financieros	18,3 %
Atención sanitaria	14,3 %
Productos industriales	18,0 %
Tecnologías de la información	7,3 %
Materiales	9,7 %
Servicios públicos	1,3 %
Efectivo	1,4 %



¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El fondo no se compromete a cumplir los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles, tal como se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE.

● ¿Invertió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplieran la taxonomía de la UE¹?

☐ Sí:

☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

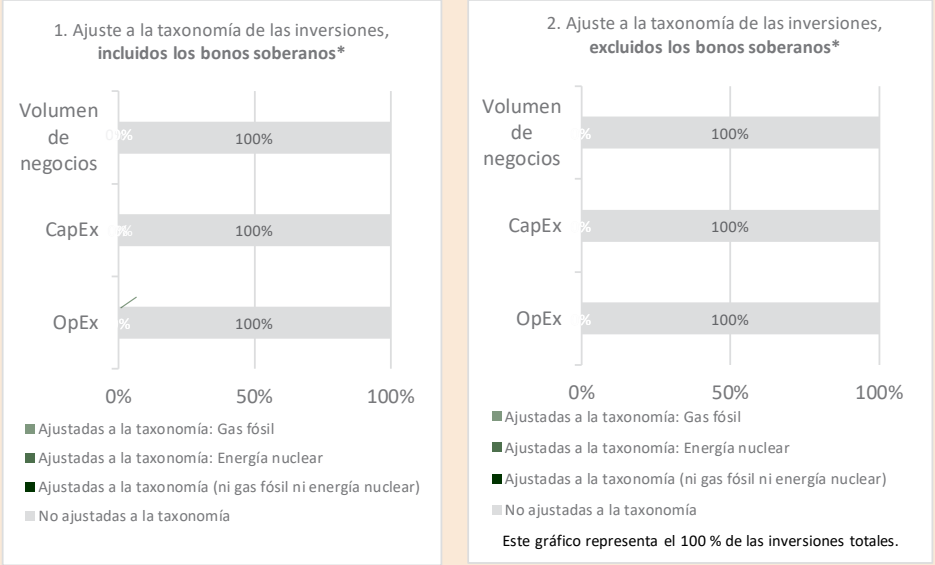
¹Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:

- El **volumen de negocios**, que refleja el porcentaje de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo (CapEx)**, que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación (OpEx)**, que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

 son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos*, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.



* A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas.

● **¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transición y facilitadoras?**

El 0 % de las inversiones realizadas por el fondo se realizan en actividades de transición y facilitadoras, según se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

● **¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?**

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE. El fondo aún no ha comunicado ninguna adaptación al Reglamento sobre taxonomía de la UE.

 ¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

No es aplicable: el fondo no tiene el compromiso de invertir en inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que no se ajusten al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

- No es aplicable: el fondo no se compromete a invertir en inversiones sostenibles con un objetivo social



¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

Las participaciones clasificadas como «Otras» incluyen (i) activos líquidos auxiliares (a saber, depósitos bancarios a la vista) que se mantienen con fines de gestión de la liquidez; (ii) depósitos bancarios, instrumentos del mercado monetario o fondos del mercado monetario mantenidos con fines de tesorería; o (iii) derivados con fines de cobertura.

Las garantías medioambientales o sociales mínimas para las posiciones de efectivo y los derivados están integradas en la evaluación de riesgos de contraparte de ESG.



¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

Hemos colaborado con distintas empresas con el objetivo de influir en su enfoque de los riesgos y las prácticas ESG.

Por ejemplo, durante el periodo, hemos colaborado con ASM International para hablar sobre gobernanza y la incorporación de métricas ESG en la remuneración de los directivos. Esto añadirá responsabilidad a la dirección. Tras nuestra colaboración, la empresa acordó implementarlas. Además, tras las colaboraciones de 2022, la empresa ha mejorado la diversidad entre sus empleados y ha establecido objetivos para contratar en el futuro teniendo en cuenta el sexo de los empleados. Por último, la empresa ha establecido un objetivo de emisiones con arreglo al propósito mundial sobre los 1,5 °C.

También hablamos sobre la estrategia de nutrición con Nestlé. La empresa nos contó que aspira a ser líder en la venta de productos alimenticios saludables. Les transmitimos nuestra preocupación por el hecho de que, a diferencia de sus homólogos, Nestlé no tiene unos objetivos específicos. Afirmamos que tener algún objetivo enviaría un mensaje claro a la industria en general. Seguiremos involucrándonos en este tema.



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

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo difiere el índice de referencia de un índice general de mercado?*

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo se ha comportado este producto financiero con respecto a los indicadores de sostenibilidad para determinar la conformidad del índice de referencia con las características medioambientales o sociales que promueve?*

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

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

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice general de mercado?*

Durante el periodo, el producto financiero mantuvo un perfil ESG superior al del MSCI Europe (Gross TR) Index, según las mediciones del modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Plantilla de información periódica de los productos financieros a que se refiere el artículo 8, apartados 1, 2 y 2 bis, del Reglamento (UE) 2019/2088 y el artículo 6, párrafo primero, del Reglamento (UE) 2020/852

Nombre del producto: Threadneedle (Lux) Pan European Smaller Companies

Identificador de entidad jurídica: 549300FG0S32L53EKJ87

Características medioambientales o sociales

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible? [marcar y rellenar según proceda; la cifra porcentual representa inversiones sostenibles]

☒ ☒ ☐ Sí	☒ ☐ ☒ No
☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental: ____% ☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ Promovió características medioambientales o sociales y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del ____% de inversiones sostenibles ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo social
☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo social: ____%	☒ Promovió características medioambientales o sociales, pero no realizó ninguna inversión sostenible

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo medioambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.



¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

El producto financiero promovió características medioambientales y sociales mediante la integración de las siguientes medidas de inversión responsable en el proceso de toma de decisiones de inversión:

- Compararse favorablemente con el índice en criterios ESG importantes, medidos por el modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle, durante periodos consecutivos de 12 meses.
- Mantener al menos el 50 % de las participaciones de la cartera en empresas con una calificación de 1-3 de materialidad ESG de Columbia Threadneedle. Cuando sea necesario, asesorar a las empresas que no estén cubiertas por el Modelo de calificación de materialidad ESG a través de un análisis fundamental, o implicarse con empresas con una calificación de materialidad ESG baja para fomentar su mejora, con el fin de lograr este compromiso mínimo del 50 %.
- Excluir a las empresas que infrinjan las normas y principios internacionales aceptados, como el Pacto Mundial de las Naciones Unidas y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos.
- Excluir a las empresas con participación en armas controvertidas, de conformidad con la Política sobre armas controvertidas de Columbia Threadneedle, y a las empresas con participación directa en armas nucleares.
- Con el fin de apoyar la promoción de las características medioambientales y sociales, establecer un compromiso con las empresas para influir en los equipos de dirección y mejorar sus prácticas, por ejemplo, en cuestiones relacionadas con las emisiones de carbono.

● ***¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?***

El producto financiero tiene los siguientes indicadores de sostenibilidad:

- El indicador principal es la calificación media ponderada positiva de la materialidad ESG de la cartera frente al EMIX Smaller Europe (inc UK) Index, que se evalúa durante periodos consecutivos de 12 meses. Nuestros sistemas de cumplimiento supervisaron diariamente la calificación positiva de materialidad ESG en relación con el índice. La cartera mantuvo una mejor calificación de materialidad ESG que el índice de referencia durante todo el periodo. El 31 de marzo de 2023, la calificación de la cartera era 2,76 y la del índice de referencia era 2,97 (en una escala del 1 al 5, en la que la calificación más baja es la mejor).
- Invertimos al menos el 50 % de la cartera en empresas con una calificación de materialidad ESG alta. Cuando sea necesario, podremos asesorar a las empresas que no estén cubiertas por su Modelo de calificación de materialidad ESG a través de un análisis fundamental, o implicarnos con empresas con una calificación de materialidad ESG baja para fomentar su mejora, con el fin de lograr este compromiso mínimo del 50 %. El producto financiero mantuvo más del 50 % de sus participaciones en empresas con una calificación de 1-3 durante el periodo.
- Excluimos empresas que determinamos que incumplían las normas internacionales aceptadas, por ejemplo, los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas. La política de exclusión se respetó con la aplicación de estrictas restricciones previas a la negociación y se realizó un seguimiento continuo.
- También cumplimos nuestra política sobre armas controvertidas y excluimos a empresas con participación directa en armas nucleares.

Dado que estos indicadores constituyen la base de las características medioambientales o sociales promovidas por el producto financiero, también son los elementos vinculantes de la estrategia ESG de la cartera.

● **¿...y en comparación con períodos anteriores?**

En el próximo informe incluiremos una comparación de los indicadores de sostenibilidad con un período anterior.

● **¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

● **¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— **¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— **¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

La taxonomía de la UE establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la Unión.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente ningún objetivo medioambiental o social.

Las principales incidencias adversas

son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.



¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a tener en cuenta las principales incidencias adversas de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad.



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen la **mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia.

Inversiones más importantes	Sector	Ponderación media	País
SIG GROUP N AG	Materiales	2,60 %	Suiza
CVS GROUP PLC	Atención sanitaria	2,50 %	Reino Unido
CTS EVENTIM AG	Servicios de comunicación	2,41 %	Alemania
WATCHES OF SWITZERLAND GROUP PLC	Consumo discrecional	2,20 %	Reino Unido
EUROFINS SCIENTIFIC	Atención sanitaria	2,09 %	Luxemburgo
FINECOBANK BANCA FINECO	Servicios financieros	2,08 %	Italia
GENUS PLC	Atención sanitaria	2,06 %	Reino Unido
AVANZA BANK HOLDING	Servicios financieros	2,05 %	Suecia
ST.JAMES PLACE PLC	Servicios financieros	2,04 %	Reino Unido
HOWDEN JOINERY GROUP PLC	Productos industriales	2,01 %	Reino Unido
BIG YELLOW GROUP PLC	Propiedades inmobiliarias	2,00 %	Reino Unido
COMPUGROUP MEDICAL N	Atención sanitaria	1,97 %	Alemania
BELIMO N AG	Productos industriales	1,96 %	Suiza
FLUIDRA SA	Productos industriales	1,94 %	España
ASM INTERNATIONAL NV	Tecnologías de la información	1,88 %	Países Bajos



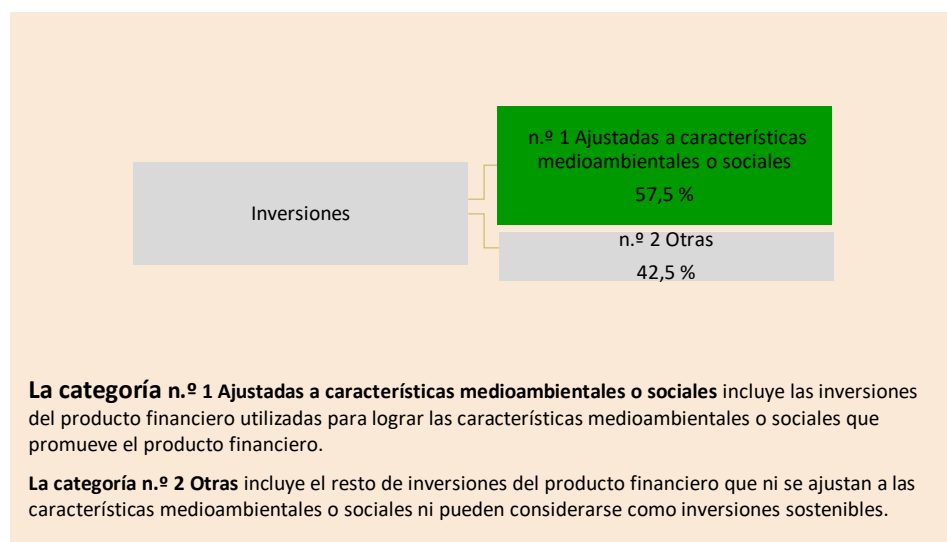
¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

● ¿Cuál ha sido la asignación de activos?

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

El 57,5 % del producto financiero se invirtió en empresas con una calificación de materialidad ESG de 1-3, por lo que se ajustaban a las características medioambientales y sociales.

El 42,5 % del producto financiero se invirtió en: (1) empresas con una calificación de materialidad ESG de 4 o 5 que, por lo tanto, no se ajustaban a las características medioambientales y sociales, (2) empresas no cubiertas por el modelo de materialidad ESG, y (3) efectivo y derivados.



● ¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Sector	Ponderación media
Productos industriales	20,71 %
Atención sanitaria	18,02 %
Tecnologías de la información	14,10 %
Servicios financieros	12,31 %
Consumo discrecional	10,49 %
Materiales	9,52 %
Servicios de comunicación	8,19 %
Bienes de consumo básicos	3,38 %
Propiedades inmobiliarias	2,65 %
Energía	0,08 %
Efectivo	0,56 %



¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El fondo no se compromete a cumplir los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles, tal como se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:

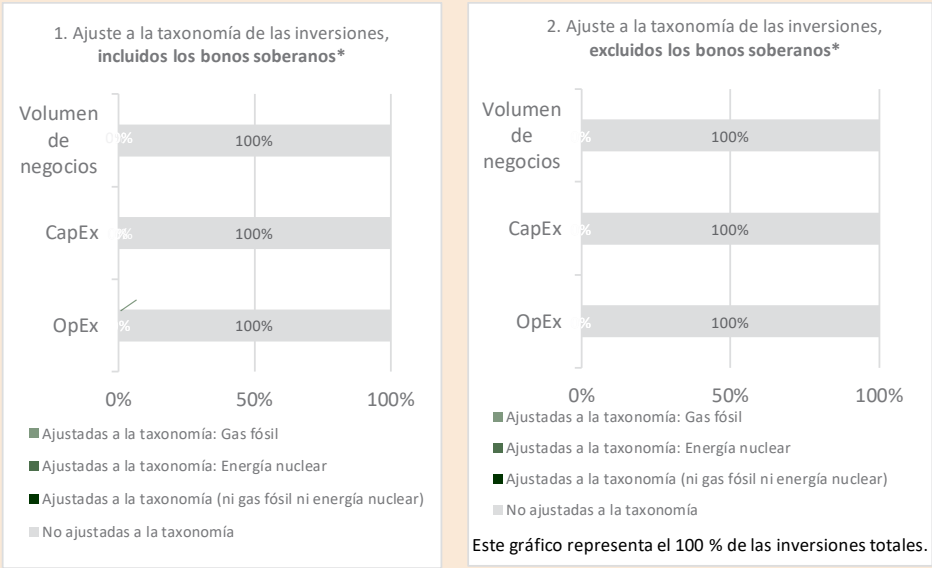
- El **volumen de negocios**, que refleja el porcentaje de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo (CapEx)**, que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación (OpEx)**, que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE.

● **¿Invertió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplieran la taxonomía de la UE¹?**

- ☐ Sí:
- ☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear
- ☒ No

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos*, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.



* A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas.

● **¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transición y facilitadoras?**

El 0 % de las inversiones realizadas por el fondo se realizan en actividades de transición y facilitadoras, según se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

¹Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

● **¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?**

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE. El fondo aún no ha comunicado ninguna adaptación al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

No es aplicable: el fondo no tiene el compromiso de invertir en inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que no se ajusten al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

No es aplicable: el fondo no se compromete a invertir en inversiones sostenibles con un objetivo social



¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

Las participaciones clasificadas como «Otras» incluyen (i) activos líquidos auxiliares (a saber, depósitos bancarios a la vista) que se mantienen con fines de gestión de la liquidez; (ii) depósitos bancarios, instrumentos del mercado monetario o fondos del mercado monetario mantenidos con fines de tesorería; (iii) derivados con fines de cobertura; (iv) empresas con una calificación de materialidad ESG de 4 o 5; o (v) empresas no cubiertas por el modelo de materialidad ESG.

Estas inversiones no se utilizan para lograr las características medioambientales y sociales de la cartera. El objetivo de estos valores es proporcionar una cartera diversificada que pueda alcanzar el objetivo financiero.

Las garantías medioambientales o sociales mínimas se aseguran mediante la realización de un análisis de exclusión a todas las participaciones en empresas participadas. En el caso de las posiciones en efectivo y derivados, las consideraciones ESG se integran en la evaluación del riesgo de contraparte.



¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

Hemos colaborado con distintas empresas con el objetivo de influir en su enfoque de los riesgos y las prácticas ESG.

Por ejemplo, durante el periodo, hemos colaborado con ASM International para hablar sobre gobernanza y la incorporación de métricas ESG en la remuneración de los directivos. Esto añadirá responsabilidad a la dirección. Tras nuestra colaboración, la empresa acordó implementarlas. Además, tras las colaboraciones de 2022, la empresa ha mejorado la diversidad entre sus empleados y ha establecido objetivos para contratar en el futuro teniendo en cuenta el sexo de los empleados. Por último, la empresa ha establecido un objetivo de emisiones con arreglo al propósito mundial sobre los 1,5 °C.



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

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo difiere el índice de referencia de un índice general de mercado?*

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo se ha comportado este producto financiero con respecto a los indicadores de sostenibilidad para determinar la conformidad del índice de referencia con las características medioambientales o sociales que promueve?*

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

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

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice general de mercado?*

Durante el periodo, el producto financiero mantuvo un perfil ESG superior al del EMIX Smaller Europe (Inc UK) Index, según las mediciones del modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Plantilla de información periódica de los productos financieros a que se refiere el artículo 8, apartados 1, 2 y 2 bis, del Reglamento (UE) 2019/2088 y el artículo 6, párrafo primero, del Reglamento (UE) 2020/852

Nombre del producto: Threadneedle (Lux) European Select

Identificador de entidad jurídica: 549300MKHX2X26Q8CM51

Características medioambientales o sociales

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☒ ☐ ☐ Sí	☒ ☐ ☒ No
☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental: ____% ☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ Promovió características medioambientales o sociales y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del ____% de inversiones sostenibles ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo social
☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo social: ____%	☒ Promovió características medioambientales o sociales, pero no realizó ninguna inversión sostenible



¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

El producto financiero promovió características medioambientales y sociales mediante la integración de las siguientes medidas de inversión responsable en el proceso de toma de decisiones de inversión:

- Compararse favorablemente con el índice en criterios ESG importantes, medidos por el modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle, durante periodos consecutivos de 12 meses.
- Mantener al menos el 50 % de las participaciones de la cartera en empresas con una calificación de 1-3 de materialidad ESG de Columbia Threadneedle. Cuando sea necesario, asesorar a las empresas que no estén cubiertas por el Modelo de calificación de materialidad ESG a través de un análisis fundamental, o implicarse con empresas con una calificación de materialidad ESG baja para fomentar su mejora, con el fin de lograr este compromiso mínimo del 50 %.
- Excluir a las empresas que infrinjan las normas y principios internacionales aceptados, como el Pacto Mundial de las Naciones Unidas y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos.
- Excluir a las empresas con participación en armas controvertidas, de conformidad con la Política sobre armas controvertidas de Columbia Threadneedle, y a las empresas con participación directa en armas nucleares.
- Con el fin de apoyar la promoción de las características medioambientales y sociales, establecer un compromiso con las empresas para influir en los equipos de dirección y mejorar sus prácticas, por ejemplo, en cuestiones relacionadas con las emisiones de carbono.

● ***¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?***

El producto financiero tiene los siguientes indicadores de sostenibilidad:

- El indicador principal es la calificación media ponderada positiva de la materialidad ESG de la cartera frente al FTSE World Europe ex UK Index, que se evalúa durante periodos consecutivos de 12 meses. Nuestros sistemas de cumplimiento supervisaron diariamente la calificación positiva de materialidad ESG en relación con el índice. La cartera mantuvo una mejor calificación de materialidad ESG que el índice de referencia durante todo el periodo. El 31 de marzo de 2023, la calificación de la cartera era 2,34 y la del índice de referencia era 2,73 (en una escala del 1 al 5, en la que la calificación más baja es la mejor).
- Invertimos al menos el 50 % de la cartera en empresas con una calificación de materialidad ESG alta. Cuando sea necesario, podremos asesorar a las empresas que no estén cubiertas por su Modelo de calificación de materialidad ESG a través de un análisis fundamental, o implicarnos con empresas con una calificación de materialidad ESG baja para fomentar su mejora, con el fin de lograr este compromiso mínimo del 50 %. El producto financiero mantuvo más del 50 % de sus participaciones en empresas con una calificación de 1-3 durante el periodo.
- Excluimos empresas que determinamos que incumplían las normas internacionales aceptadas, por ejemplo, los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas. La política de exclusión se respetó con la aplicación de estrictas restricciones previas a la negociación y se realizó un seguimiento continuo.
- También cumplimos nuestra política sobre armas controvertidas y excluimos a empresas con participación directa en armas nucleares.

Dado que estos indicadores constituyen la base de las características medioambientales o sociales promovidas por el producto financiero, también son los elementos vinculantes de la estrategia ESG de la cartera.

● **¿...y en comparación con períodos anteriores?**

En el próximo informe incluiremos una comparación de los indicadores de sostenibilidad con un período anterior.

● **¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

● **¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— **¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— **¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

La taxonomía de la UE establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la Unión.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente ningún objetivo medioambiental o social.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.



¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a tener en cuenta las principales incidencias adversas de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad.



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen la **mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia.

Inversiones más importantes	Sector	Ponderación media	País
NESTLE SA	Bienes de consumo básicos	6,22 %	Suiza
ASML HOLDING NV	Tecnologías de la información	5,42 %	Países Bajos
LVMH	Consumo discrecional	5,41 %	Francia
SCHNEIDER ELECTRIC	Productos industriales	4,49 %	Francia
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL INDITEX	Consumo discrecional	4,28 %	España
LOREAL SA	Bienes de consumo básicos	4,01 %	Francia
TRYG	Servicios financieros	3,90 %	Dinamarca
NOVO NORDISK CLASS B	Atención sanitaria	3,82 %	Dinamarca
BRENTAG	Productos industriales	3,81 %	Alemania
LONZA GROUP AG	Atención sanitaria	3,72 %	Suiza
SAP	Tecnologías de la información	3,65 %	Alemania
PERNOD RICARD SA	Bienes de consumo básicos	3,55 %	Francia
DAVIDE CAMPARI MILANO NV	Bienes de consumo básicos	3,42 %	Italia
SIKA AG	Materiales	3,17 %	Suiza
IMCD NV	Productos industriales	2,77 %	Países Bajos



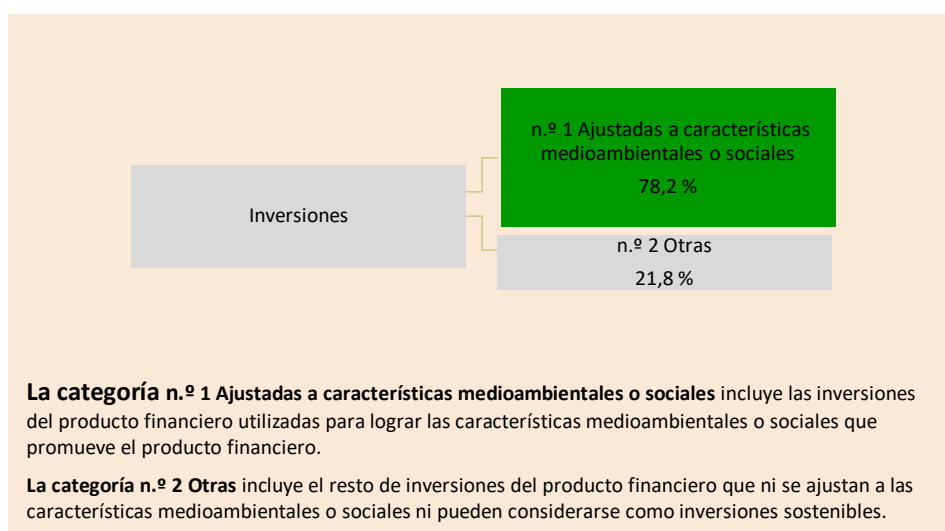
¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

● ¿Cuál ha sido la asignación de activos?

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

El 78,2 % del producto financiero se invirtió en empresas con una calificación de materialidad ESG de 1-3, por lo que se ajustaban a las características medioambientales y sociales.

El 21,8 % del producto financiero se invirtió en: (1) empresas con una calificación de materialidad ESG de 4 o 5 que, por lo tanto, no se ajustaban a las características medioambientales y sociales, (2) empresas no cubiertas por el modelo de materialidad ESG, y (3) efectivo y derivados.



● ¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Sector	Ponderación media
Productos industriales	22,26 %
Bienes de consumo básicos	17,21 %
Consumo discrecional	16,75 %
Tecnologías de la información	12,77 %
Servicios financieros	12,13 %
Atención sanitaria	10,80 %
Materiales	6,03 %
Efectivo	2,04 %

Para cumplir la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos.

Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental.

Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:

- El **volumen de negocios**, que refleja el porcentaje de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.



¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El fondo no se compromete a cumplir los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles, tal como se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplieran la taxonomía de la UE¹?

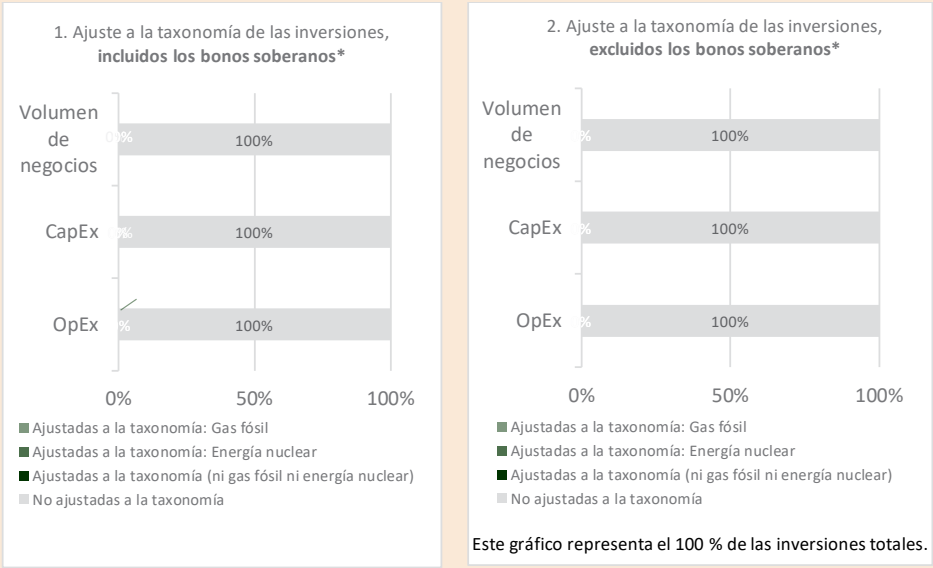
☐ Sí:

☐ En el gas fósil

☐ En la energía nuclear

☒ No

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos*, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.



Este gráfico representa el 100 % de las inversiones totales.

* A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas.

¹Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

● **¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transición y facilitadoras?**

El 0 % de las inversiones realizadas por el fondo se realizan en actividades de transición y facilitadoras, según se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE. El fondo aún no ha comunicado ninguna adaptación al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

No es aplicable: el fondo no tiene el compromiso de invertir en inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que no se ajusten al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

No es aplicable: el fondo no se compromete a invertir en inversiones sostenibles con un objetivo social



¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

Las participaciones clasificadas como «Otras» incluyen (i) activos líquidos auxiliares (a saber, depósitos bancarios a la vista) que se mantienen con fines de gestión de la liquidez; (ii) depósitos bancarios, instrumentos del mercado monetario o fondos del mercado monetario mantenidos con fines de tesorería; (iii) derivados con fines de cobertura; (iv) empresas con una calificación de materialidad ESG de 4 o 5; o (v) empresas no cubiertas por el modelo de materialidad ESG.

Estas inversiones no se utilizan para lograr las características medioambientales y sociales de la cartera. El objetivo de estos valores es proporcionar una cartera diversificada que pueda alcanzar el objetivo financiero.

Las garantías medioambientales o sociales mínimas se aseguran mediante la realización de un análisis de exclusión a todas las participaciones en empresas participadas. En el caso de las posiciones en efectivo y derivados, las consideraciones ESG se integran en la evaluación del riesgo de contraparte.

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.



¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

Hemos colaborado con distintas empresas con el objetivo de influir en su enfoque de los riesgos y las prácticas ESG.

Por ejemplo, durante el periodo, hemos colaborado con ASM International para hablar sobre gobernanza y la incorporación de métricas ESG en la remuneración de los directivos. Esto añadirá responsabilidad a la dirección. Tras nuestra colaboración, la empresa acordó implementarlas. Además, tras las colaboraciones de 2022, la empresa ha mejorado la diversidad entre sus empleados y ha establecido objetivos para contratar en el futuro teniendo en cuenta el sexo de los empleados. Por último, la empresa ha establecido un objetivo de emisiones con arreglo al propósito mundial sobre los 1,5 °C.

También hablamos sobre la estrategia de nutrición con Nestlé. La empresa nos contó que aspira a ser líder en la venta de productos alimenticios saludables. Les transmitimos nuestra preocupación por el hecho de que, a diferencia de sus homólogos, Nestlé no tiene unos objetivos específicos. Afirmamos que tener algún objetivo enviaría un mensaje claro a la industria en general. Mantendremos nuestra implicación.



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

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo difiere el índice de referencia de un índice general de mercado?*

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo se ha comportado este producto financiero con respecto a los indicadores de sostenibilidad para determinar la conformidad del índice de referencia con las características medioambientales o sociales que promueve?*

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

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

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice general de mercado?*

Durante el periodo, el producto financiero mantuvo un perfil ESG superior al del FTSE World Europe ex UK Index, según las mediciones del modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Plantilla de información periódica de los productos financieros a que se refiere el artículo 8, apartados 1, 2 y 2 bis, del Reglamento (UE) 2019/2088 y el artículo 6, párrafo primero, del Reglamento (UE) 2020/852

Nombre del producto: Threadneedle (Lux) European Smaller Companies

Identificador de entidad jurídica: 54930003VV6JZQNNIC16

Características medioambientales o sociales

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☒ ☐ ☐ Sí	☒ ☐ ☒ No
☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental: ____% ☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ Promovió características medioambientales o sociales y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del ____% de inversiones sostenibles ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE ☐ con un objetivo social
☐ Realizó inversiones sostenibles con un objetivo social: ____%	☒ Promovió características medioambientales o sociales, pero no realizó ninguna inversión sostenible

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo medioambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.



¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

El producto financiero promovió características medioambientales y sociales mediante la integración de las siguientes medidas de inversión responsable en el proceso de toma de decisiones de inversión:

- Compararse favorablemente con el índice en criterios ESG importantes, medidos por el modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle, durante periodos consecutivos de 12 meses.
- Mantener al menos el 50 % de las participaciones de la cartera en empresas con una calificación de 1-3 de materialidad ESG de Columbia Threadneedle. Cuando sea necesario, asesorar a las empresas que no estén cubiertas por el Modelo de calificación de materialidad ESG a través de un análisis fundamental, o implicarse con empresas con una calificación de materialidad ESG baja para fomentar su mejora, con el fin de lograr este compromiso mínimo del 50 %.
- Excluir a las empresas que infrinjan las normas y principios internacionales aceptados, como el Pacto Mundial de las Naciones Unidas y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos.
- Excluir a las empresas con participación en armas controvertidas, de conformidad con la Política sobre armas controvertidas de Columbia Threadneedle, y a las empresas con participación directa en armas nucleares.
- Con el fin de apoyar la promoción de las características medioambientales y sociales, establecer un compromiso con las empresas para influir en los equipos de dirección y mejorar sus prácticas, por ejemplo, en cuestiones relacionadas con las emisiones de carbono.

● ***¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?***

El producto financiero tiene los siguientes indicadores de sostenibilidad:

- El indicador principal es la calificación media ponderada positiva de la materialidad ESG de la cartera frente al Euromoney Small Europe ex-UK Index, que se evalúa durante periodos consecutivos de 12 meses. Nuestros sistemas de cumplimiento supervisaron diariamente la calificación positiva de materialidad ESG en relación con el índice. La cartera mantuvo una mejor calificación de materialidad ESG que el índice de referencia durante todo el periodo. El 31 de marzo de 2023, la calificación de la cartera era 2,89 y la del índice de referencia era 2,86 (en una escala del 1 al 5, en la que la calificación más baja es la mejor).
- Invertimos al menos el 50 % de la cartera en empresas con una calificación de materialidad ESG alta. Cuando sea necesario, podremos asesorar a las empresas que no estén cubiertas por su Modelo de calificación de materialidad ESG a través de un análisis fundamental, o implicarnos con empresas con una calificación de materialidad ESG baja para fomentar su mejora, con el fin de lograr este compromiso mínimo del 50 %. El producto financiero mantuvo más del 50 % de sus participaciones en empresas con una calificación de 1-3 durante el periodo.
- Excluimos empresas que determinamos que incumplían las normas internacionales aceptadas, por ejemplo, los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas. La política de exclusión se respetó con la aplicación de estrictas restricciones previas a la negociación y se realizó un seguimiento continuo.
- También cumplimos nuestra política sobre armas controvertidas y excluimos a empresas con participación directa en armas nucleares.

Dado que estos indicadores constituyen la base de las características medioambientales o sociales promovidas por el producto financiero, también son los elementos vinculantes de la estrategia ESG de la cartera.

● **¿...y en comparación con períodos anteriores?**

En el próximo informe incluiremos una comparación de los indicadores de sostenibilidad con un período anterior.

● **¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

● **¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?**

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— ¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

— ¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a invertir en inversiones sostenibles.

La taxonomía de la UE establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la Unión.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente ningún objetivo medioambiental o social.

Las principales incidencias adversas son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.



¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

No es aplicable: el producto financiero no se compromete a tener en cuenta las principales incidencias adversas de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad.



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen la mayor parte de las inversiones del producto financiero durante el período de referencia.

Inversiones más importantes	Sector	Ponderación media	País
CTS EVENTIM AG	Servicios de comunicación	2,66 %	Alemania
SIG GROUP N AG	Materiales	2,66 %	Suiza
MELEXIS NV	Tecnologías de la información	2,63 %	Bélgica
ASM INTERNATIONAL NV	Tecnologías de la información	2,53 %	Países Bajos
IMCD NV	Productos industriales	2,51 %	Países Bajos
BELIMO N AG	Productos industriales	2,51 %	Suiza
BUREAU VERITAS SA	Productos industriales	2,47 %	Francia
TRYG	Servicios financieros	2,40 %	Dinamarca
FINECOBANK BANCA FINECO	Servicios financieros	2,38 %	Italia
VAT GROUP AG	Productos industriales	2,18 %	Suiza
SIKA AG	Materiales	2,10 %	Suiza
BRENTAG	Productos industriales	2,03 %	Alemania
BURCKHARDT COMPRESSION HOLDING AG	Productos industriales	2,01 %	Suiza
AVANZA BANK HOLDING	Servicios financieros	1,97 %	Suecia
HUHTAMAKI	Materiales	1,92 %	Finlandia



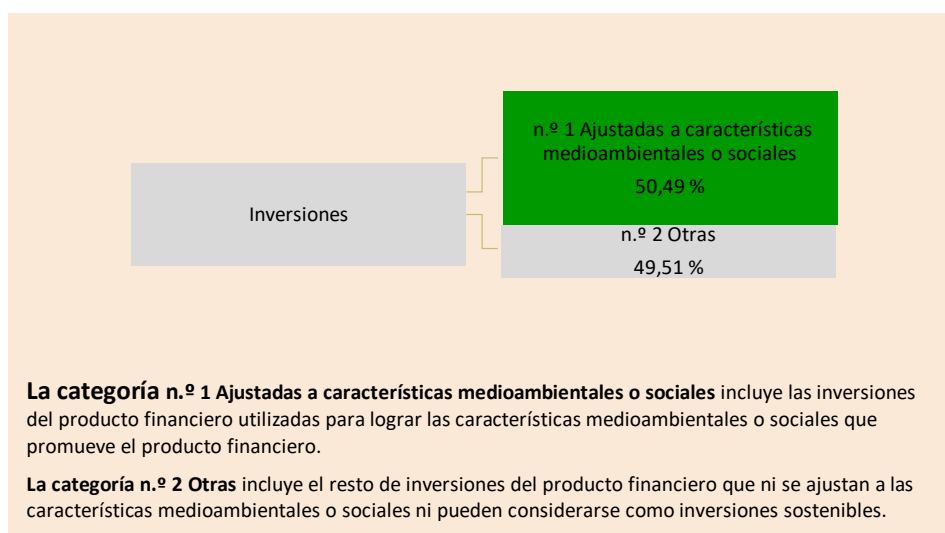
¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

La asignación de activos describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 50,49 % del producto financiero se invirtió en empresas con una calificación de materialidad ESG de 1-3, por lo que se ajustaban a las características medioambientales y sociales.

El 49,51 % del producto financiero se invirtió en: (1) empresas con una calificación de materialidad ESG de 4 o 5 que, por lo tanto, no se ajustaban a las características medioambientales y sociales, (2) empresas no cubiertas por el modelo de materialidad ESG, y (3) efectivo y derivados.



● **¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?**

Sector	Ponderación media
Productos industriales	27,74 %
Tecnologías de la información	16,61 %
Atención sanitaria	15,91 %
Servicios financieros	11,91 %
Materiales	10,09 %
Bienes de consumo básicos	5,97 %
Servicios de comunicación	5,34 %
Consumo discrecional	4,68 %
Propiedades inmobiliarias	0,26 %
Energía	0,09 %
Efectivo	1,40 %

Para cumplir la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos.

Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental.

Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:

- El **volumen de negocios**, que refleja el porcentaje de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo (CapEx)**, que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación (OpEx)**, que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.



¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El fondo no se compromete a cumplir los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles, tal como se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE.

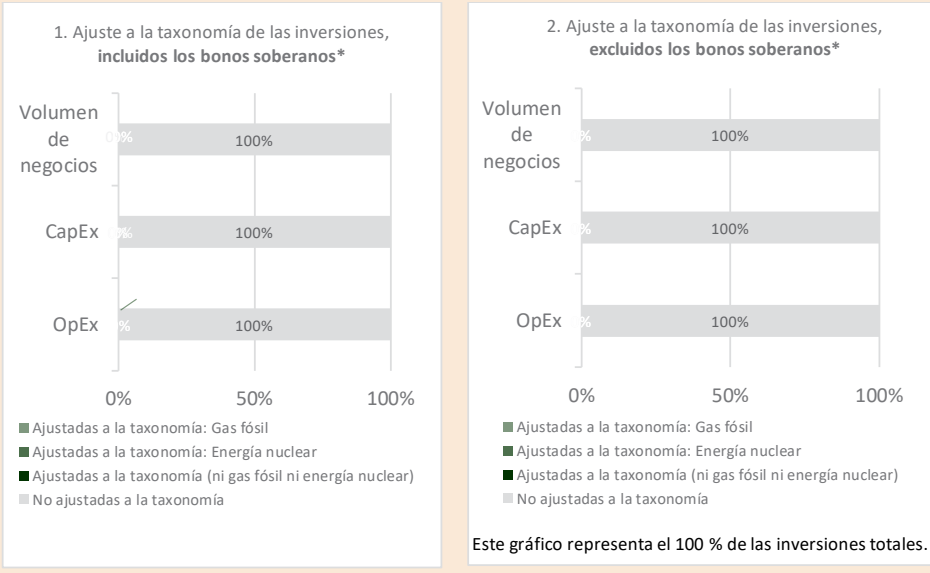
¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplieran la taxonomía de la UE¹?

☐ Sí:

☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos*, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.



* A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas.

¹Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

● **¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transición y facilitadoras?**

El 0 % de las inversiones realizadas por el fondo se realizan en actividades de transición y facilitadoras, según se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE.

● **¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?**

Basándose en los datos fiables disponibles hasta la fecha, el fondo informa de que el 0 % de sus inversiones se realizan en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento sobre taxonomía de la UE. El fondo aún no ha comunicado ninguna adaptación al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

No es aplicable: el fondo no tiene el compromiso de invertir en inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que no se ajusten al Reglamento sobre taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

No es aplicable: el fondo no se compromete a invertir en inversiones sostenibles con un objetivo social



¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

Las participaciones clasificadas como «Otras» incluyen (i) activos líquidos auxiliares (a saber, depósitos bancarios a la vista) que se mantienen con fines de gestión de la liquidez; (ii) depósitos bancarios, instrumentos del mercado monetario o fondos del mercado monetario mantenidos con fines de tesorería; (iii) derivados con fines de cobertura; (iv) empresas con una calificación de materialidad ESG de 4 o 5; o (v) empresas no cubiertas por el modelo de materialidad ESG.

Estas inversiones no se utilizan para lograr las características medioambientales y sociales de la cartera. El objetivo de estos valores es proporcionar una cartera diversificada que pueda alcanzar el objetivo financiero.

Las garantías medioambientales o sociales mínimas se aseguran mediante la realización de un análisis de exclusión a todas las participaciones en empresas participadas. En el caso de las posiciones en efectivo y derivados, las consideraciones ESG se integran en la evaluación del riesgo de contraparte.



son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.



¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

Hemos colaborado con distintas empresas con el objetivo de influir en su enfoque de los riesgos y las prácticas ESG.

Por ejemplo, durante el periodo, hemos colaborado con ASM International para hablar sobre gobernanza y la incorporación de métricas ESG en la remuneración de los directivos. Esto añadirá responsabilidad a la dirección. Tras nuestra colaboración, la empresa acordó implementarlas. Además, tras las colaboraciones de 2022, la empresa ha mejorado la diversidad entre sus empleados y ha establecido objetivos para contratar en el futuro teniendo en cuenta el sexo de los empleados. Por último, la empresa ha establecido un objetivo de emisiones con arreglo al propósito mundial sobre los 1,5 °C.



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

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo difiere el índice de referencia de un índice general de mercado?*

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo se ha comportado este producto financiero con respecto a los indicadores de sostenibilidad para determinar la conformidad del índice de referencia con las características medioambientales o sociales que promueve?*

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

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

No es aplicable: el producto financiero no tiene un índice de referencia designado que se utilice para medir si alcanza las características medioambientales o sociales que promueve la cartera.

● *¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice general de mercado?*

Durante el periodo, el producto financiero mantuvo un perfil ESG superior al del Euromoney Small Europe ex-UK Index, según las mediciones del modelo de calificación de materialidad ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Información acerca del Reglamento sobre taxonomía de la UE (sin auditar)

El Reglamento (UE) 2020/852 es un marco para facilitar las inversiones sostenibles (el «Reglamento sobre taxonomía de la UE») que establece criterios que determinan si una actividad económica cumple los requisitos para considerarse sostenible desde el punto de vista medioambiental a partir de seis objetivos medioambientales (actividades «**Ajustadas a la taxonomía**»). El Reglamento sobre taxonomía de la UE requiere la divulgación de determinada información en el presente informe.

Productos financieros con arreglo al artículo 6

Las inversiones subyacentes a los productos financieros enumerados a continuación no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en virtud del Reglamento sobre taxonomía de la UE. Los productos financieros con arreglo al artículo 6 incluyen:

- Threadneedle (Lux) – American
- Threadneedle (Lux) – American Absolute Alpha
- Threadneedle (Lux) – American Extended Alpha
- Threadneedle (Lux) – American Select
- Threadneedle (Lux) – Asia Contrarian Equity
- Threadneedle (Lux) – Asian Equity Income
- Threadneedle (Lux) – Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) – Emerging Market Corporate Bonds
- Threadneedle (Lux) – Emerging Market Debt
- Threadneedle (Lux) – Enhanced Commodities
- Threadneedle (Lux) – Euro Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) – European Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) – European Short-Term High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) – European Strategic Bond
- Threadneedle (Lux) – Flexible Asian Bond
- Threadneedle (Lux) – Global Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) – Global Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) – Global Emerging Market Equities
- Threadneedle (Lux) – Global Emerging Market Short-Term Bonds
- Threadneedle (Lux) – Global Extended Alpha
- Threadneedle (Lux) – Global Investment Grade Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) – Global Multi Asset Income
- Threadneedle (Lux) – Global Technology
- Threadneedle (Lux) – Pan European Absolute Alpha
- Threadneedle (Lux) – Pan European Equity Dividend
- Threadneedle (Lux) – Pan European Small Cap Opportunities
- Threadneedle (Lux) – UK Equities
- Threadneedle (Lux) – UK Equity Income
- Threadneedle (Lux) – US Contrarian Core Equities
- Threadneedle (Lux) – US Disciplined Core Equities
- Threadneedle (Lux) – US High Yield Bond

Productos financieros que promueven características medioambientales con arreglo al artículo 8

Las inversiones subyacentes a los productos financieros con arreglo al artículo 8 que promueven características medioambientales indicadas a continuación no han adquirido el compromiso de tener en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles, tal como se definen en el Reglamento sobre taxonomía de la UE, por lo que el principio de «no causar un perjuicio significativo» del Reglamento sobre taxonomía de la UE no se aplica a estos productos. Según los datos fiables facilitados en la fecha de este informe, el 0% de las inversiones en productos financieros son inversiones Ajustadas a la taxonomía.

- Threadneedle (Lux) – American Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Asia Equities
- Threadneedle (Lux) – European Select
- Threadneedle (Lux) – European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Global Equity Income
- Threadneedle (Lux) – Global Focus
- Threadneedle (Lux) – Global Select
- Threadneedle (Lux) – Global Smaller Companies

Información acerca del Reglamento sobre taxonomía de la UE (sin auditar)

(continuación)

- Threadneedle (Lux) – Pan European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – European High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) – Pan European ESG Equities
- Threadneedle (Lux) – Emerging Market ESG Equities

Productos financieros que no promueven características medioambientales con arreglo al artículo 8

El Threadneedle (Lux) – European Social Bond solo promueve características sociales. Por tanto, las inversiones subyacentes de este producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles en virtud del Reglamento sobre taxonomía de la UE, y el 0% de las inversiones del producto financiero se comprometen a ser inversiones Ajustadas a la taxonomía.

Directorio

Domicilio social

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

Asesor de inversiones

Threadneedle Management Luxembourg S.A.

Sociedad Gestora

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

Delegado a¹:

Columbia Management
Investment Advisers, LLC
225 Franklin Street
Boston MA 02110
Estados Unidos de América

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

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

Directorio

(continuación)

Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited 3 Killiney Road #07-07 Winsland House 1 Singapur 239519 Singapur	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity ⁶
STANLIB Asset Management (Pty) Limited 17 Melrose Boulevard Melrose Arch 2196 Johannesburgo Sudáfrica	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity ⁷

¹ Sujeto a la responsabilidad y supervisión de Threadneedle Management Luxembourg S.A.

² Threadneedle Asset Management Limited ofrece recomendaciones de inversión a Columbia Management Investment Advisers, LLC y, por lo tanto, proporciona asesoramiento de inversión respaldado por investigación a Columbia Management Investment Advisers, LLC.

³ Threadneedle Asset Management Limited podrá, sujeto a su propia responsabilidad, delegar la gestión de inversiones discrecionales de parte de los activos de la Cartera a Columbia Management Investment Advisers, LLC (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 1.

Directorio

(continuación)

Depositorio, 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.
49, 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
Am Belvedere 1
1100 Viena
Austria

En Bélgica

CACEIS Belgium S.A.
Avenue du Port 86 C b 320
B-1000 Bruselas
Bélgica

En Francia

CACEIS Bank
1/3 Place Valhubert
75013 París
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
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 467660