

SABADELL RENDIMIENTO, FI

Nº Registro CNMV: 2145

Informe Trimestral del Tercer Trimestre 2022

Gestora: 1) SABADELL ASSET MANAGEMENT, S.A., S.G.I.I.C. **Depositario:** BNP PARIBAS S.A., SUCURSAL EN ESPAÑA **Auditor:** PricewaterhouseCoopers Auditores, S.L.

Grupo Gestora: **Grupo Depositario:** BNP PARIBAS **Rating Depositario:** A+ (Standard & Poor's)

El presente informe, junto con los últimos informes periódicos, se encuentran disponibles por medios telemáticos en www.sabadellassetmanagement.com.

La Entidad Gestora atenderá las consultas de los clientes, relacionadas con las IIC gestionadas en:

Dirección

Paseo de la Castellana, 1 - 28046 Madrid. Teléfono: 936410160

Correo Electrónico

SabadellAssetManagement@sabadellassetmanagement.com

Asimismo cuenta con un departamento o servicio de atención al cliente encargado de resolver las quejas y reclamaciones. La CNMV también pone a su disposición la Oficina de Atención al Inversor (902 149 200, e-mail: inversores@cnmv.es).

INFORMACIÓN FONDO

Fecha de registro: 14/06/2000

1. Política de inversión y divisa de denominación

Categoría

Tipo de fondo:

Otros

Vocación inversora: Renta Fija Euro

Perfil de Riesgo: 1, en una escala del 1 al 7

Descripción general

Política de inversión: El Fondo invierte en activos monetarios y de renta fija emitidos en euros. La duración media de la cartera de renta fija será máximo de 2 años. No existe predeterminación de la calificación crediticia de las inversiones. Con todo, se persigue un rendimiento regular, marcado por los tipos de interés a corto plazo en los mercados monetarios y de renta fija del euro. La selección de valores se realiza teniendo en cuenta no solo aspectos económicos y financieros sino también criterios extra-financieros de inversión sostenible, medioambientales, sociales y de buen gobierno, también conocidos como ESG, aplicando la metodología ESG desarrollada por Amundi. Este fondo puede no ser adecuado para inversores que prevean retirar su dinero en un plazo inferior a 1 año.

Operativa en instrumentos derivados

Una información más detallada sobre la política de inversión del Fondo se puede encontrar en su folleto informativo.

Divisa de denominación EUR

2. Datos económicos

| | Periodo actual | Periodo anterior | 2022 | 2021 |
|--|----------------|------------------|-------|-------|
| Índice de rotación de la cartera | 0,27 | 0,11 | 0,44 | 1,26 |
| Rentabilidad media de la liquidez (% anualizado) | -0,13 | -0,54 | -0,39 | -0,26 |

Nota: El período se refiere al trimestre o semestre, según sea el caso. En el caso de IIC cuyo valor liquidativo no se determine diariamente, éste dato y el de patrimonio se refieren a los últimos disponibles

2.1.a) Datos generales.

Cuando no exista información disponible las correspondientes celdas aparecerán en blanco

| CLASE | Nº de participaciones | | Nº de partícipes | | Divisa | Beneficios brutos distribuidos por participación | | Inversión mínima | Distribuye dividendos |
|-------------|-----------------------|------------------|------------------|------------------|--------|--|------------------|------------------|-----------------------|
| | Periodo actual | Periodo anterior | Periodo actual | Periodo anterior | | Periodo actual | Periodo anterior | | |
| BASE | 52.689.022,47 | 52.718.397,93 | 24.285 | 24.281 | EUR | | | 200 | NO |
| PLUS | 68.120.957,78 | 62.951.722,00 | 2.945 | 2.814 | EUR | | | 100000 | NO |
| PREMIER | 42.358.514,30 | 33.379.251,05 | 209 | 185 | EUR | | | 1000000 | NO |
| CARTERA | 60.486.703,00 | 64.641.201,88 | 9.989 | 10.182 | EUR | | | 0 | NO |
| PYME | 4.295.061,88 | 4.329.310,62 | 1.108 | 1.111 | EUR | | | 10000 | NO |
| EMPRESA | 11.902.143,36 | 11.909.670,07 | 161 | 166 | EUR | | | 500000 | NO |
| CANALIZADOR | 992.940,62 | 864.610,93 | 96 | 109 | EUR | | | 0 | NO |
| SUPERIOR | 13.612.006,61 | 14.770.355,13 | 13 | 15 | EUR | | | 5000000 | NO |

Patrimonio (en miles)

| CLASE | Divisa | Al final del periodo | Diciembre 2021 | Diciembre 2020 | Diciembre 2019 |
|-------------|--------|----------------------|----------------|----------------|----------------|
| BASE | EUR | 477.680 | 383.424 | 467.506 | 508.494 |
| PLUS | EUR | 620.599 | 506.190 | 591.904 | 534.091 |
| PREMIER | EUR | 387.891 | 330.616 | 312.179 | 284.317 |
| CARTERA | EUR | 555.056 | 586.948 | 585.164 | 745.171 |
| PYME | EUR | 39.056 | 35.377 | 32.786 | 14.120 |
| EMPRESA | EUR | 108.432 | 105.961 | 68.725 | 52.880 |
| CANALIZADOR | EUR | 9.135 | 7.360 | 11.785 | 15.873 |
| SUPERIOR | EUR | 126.067 | 130.897 | 79.450 | 0 |

Valor liquidativo de la participación (*)

| CLASE | Divisa | Al final del periodo | Diciembre 2021 | Diciembre 2020 | Diciembre 2019 |
|-------------|--------|----------------------|----------------|----------------|----------------|
| BASE | EUR | 9,0660 | 9,2022 | 9,2500 | 9,2757 |
| PLUS | EUR | 9,1102 | 9,2392 | 9,2817 | 9,3019 |
| PREMIER | EUR | 9,1573 | 9,2794 | 9,3165 | 9,3310 |
| CARTERA | EUR | 9,1765 | 9,2927 | 9,3204 | 9,3257 |
| PYME | EUR | 9,0932 | 9,2254 | 9,2696 | 9,2916 |
| EMPRESA | EUR | 9,1103 | 9,2393 | 9,2817 | 9,3018 |
| CANALIZADOR | EUR | 9,2003 | 9,3168 | 9,3447 | 9,3500 |

| | | | | | |
|----------|-----|--------|--------|--------|--------|
| SUPERIOR | EUR | 9,2615 | 9,3801 | 9,4100 | 9,4172 |
|----------|-----|--------|--------|--------|--------|

(*)El valor liquidativo y, por tanto, su rentabilidad no recogen el efecto derivado del cargo individual al partícipe de la comisión de gestión sobre resultados:

Comisiones aplicadas en el período, sobre patrimonio medio

| CLASE | Sist. Imputac. | Comisión de gestión | | | | | | Base de cálculo | Comisión de depositario | | |
|-------------|----------------|-------------------------|--------------|-------|--------------|--------------|-------|-----------------|-------------------------|-----------|-----------------|
| | | % efectivamente cobrado | | | | | | | % efectivamente cobrado | | Base de cálculo |
| | | Período | | | Acumulada | | | | Período | Acumulada | |
| | | s/patrimonio | s/resultados | Total | s/patrimonio | s/resultados | Total | | | | |
| BASE | al fondo | 0,17 | 0,00 | 0,17 | 0,32 | 0,00 | 0,32 | patrimonio | 0,01 | 0,03 | Patrimonio |
| PLUS | al fondo | 0,11 | 0,00 | 0,11 | 0,24 | 0,00 | 0,24 | patrimonio | 0,01 | 0,03 | Patrimonio |
| PREMIER | al fondo | 0,07 | 0,00 | 0,07 | 0,17 | 0,00 | 0,17 | patrimonio | 0,01 | 0,01 | Patrimonio |
| CARTER A | al fondo | 0,05 | 0,00 | 0,05 | 0,10 | 0,00 | 0,10 | patrimonio | 0,01 | 0,01 | Patrimonio |
| PYME | al fondo | 0,14 | 0,00 | 0,14 | 0,28 | 0,00 | 0,28 | patrimonio | 0,01 | 0,03 | Patrimonio |
| EMPRES A | al fondo | 0,11 | 0,00 | 0,11 | 0,24 | 0,00 | 0,24 | patrimonio | 0,01 | 0,03 | Patrimonio |
| CANALIZADOR | al fondo | 0,05 | 0,00 | 0,05 | 0,09 | 0,00 | 0,09 | patrimonio | 0,01 | 0,01 | Patrimonio |
| SUPERIOR | al fondo | 0,06 | 0,00 | 0,06 | 0,12 | 0,00 | 0,12 | patrimonio | 0,01 | 0,01 | Patrimonio |

2.2 Comportamiento

Cuando no exista información disponible las correspondientes celdas aparecerán en blanco

A) Individual BASE .Divisa EUR

| Rentabilidad (% sin anualizar) | Acumulad o año t actual | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--------------------------------|-------------------------------|--------------------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|---------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | Año t-1 | Año t-2 | Año t-3 | Año t-5 |
| Rentabilidad IIC | | -0,54 | | | | | | | |

| Rentabilidades extremas (i) | Trimestre actual | | Último año | | Últimos 3 años | |
|-----------------------------|------------------|------------|------------|-------|----------------|-------|
| | % | Fecha | % | Fecha | % | Fecha |
| Rentabilidad mínima (%) | -0,06 | 28-09-2022 | | | | |
| Rentabilidad máxima (%) | 0,04 | 20-07-2022 | | | | |

(i) Sólo se informa para las clases con una antigüedad mínima del periodo solicitado y siempre que no se haya modificado su vocación inversora

Se refiere a las rentabilidades máximas y mínimas entre dos valores liquidativos consecutivos.

La periodicidad de cálculo del valor liquidativo es *diaria*

Recuerde que rentabilidades pasadas no presuponen rentabilidades futuras. Sólo se informa si se ha mantenido una política de inversión homogénea en el período.

| Medidas de riesgo (%) | Acumulad o año t actual | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--|-------------------------------|--------------------|--------|--------|--------|-------|------|------|------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | 2021 | 2020 | 2019 | 2017 |
| Volatilidad(ii) de: | | | | | | | | | |
| Valor liquidativo | | 0,35 | | 0,15 | 0,12 | 0,12 | 0,40 | 0,14 | 0,11 |
| Ibex-35 | | 16,45 | | | | | | | |
| Letra Tesoro 1 año | | 2,00 | | | | | | | |
| VaR histórico del valor liquidativo(iii) | | | | | | | | | |

(ii) Volatilidad histórica: Indica el riesgo de un valor en un periodo, a mayor volatilidad mayor riesgo. A modo comparativo se ofrece la volatilidad de distintas referencias. Sólo se informa de la volatilidad para los períodos con política de inversión homogénea.

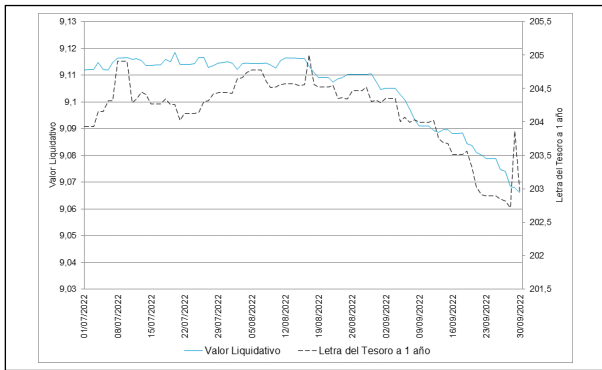
(iii) VaR histórico del valor liquidativo: Indica lo máximo que se puede perder, con un nivel de confianza del 99%, en el plazo de 1 mes, si se repitiese el comportamiento de la IIC de los últimos 5 años. El dato es a finales del periodo de referencia.

| Gastos (% s/ patrimonio medio) | Acumulado 2022 | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--------------------------------|----------------|-----------------|--------|--------|--------|-------|------|------|------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | 2021 | 2020 | 2019 | 2017 |
| Ratio total de gastos (iv) | 0,36 | 0,18 | 0,09 | 0,08 | 0,09 | 0,34 | 0,35 | 0,35 | 0,35 |

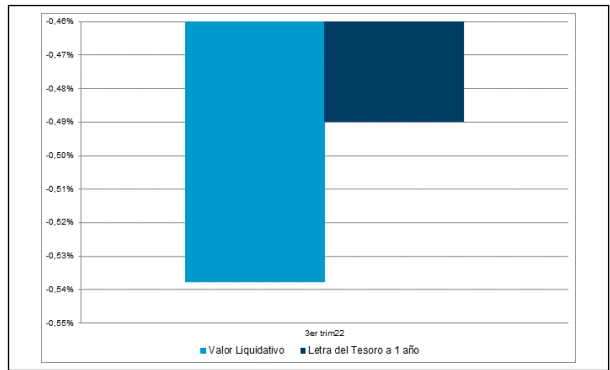
(iv) Incluye los gastos directos soportados en el periodo de referencia: comisión de gestión sobre patrimonio, comisión de depositario, auditoría, servicios bancarios (salvo gastos de financiación), y resto de gastos de gestión corriente, en términos de porcentaje sobre patrimonio medio del periodo. En el caso de fondos/compartimentos que invierten más de un 10% de su patrimonio en otras IIC este ratio incluye, de forma adicional al anterior, los gastos soportados indirectamente, derivados de esas inversiones, que incluyen las comisiones de suscripción y reembolso. Este ratio no incluye la comisión de gestión sobre resultados ni los costes de transacción por la compraventa de valores.

En el caso de inversiones en IIC que no calculan su ratio de gastos, éste se ha estimado para incorporarlo en el ratio de gastos.

Evolución del valor liquidativo últimos 5 años



Rentabilidad trimestral de los últimos 3 años



29/04/2022 "Se puede encontrar información adicional en el Anexo de este informe"

A) Individual PLUS .Divisa EUR

| Rentabilidad (% sin anualizar) | Acumulado año t actual | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--------------------------------|------------------------|-----------------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|---------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | Año t-1 | Año t-2 | Año t-3 | Año t-5 |
| Rentabilidad IIC | | -0,48 | | | | | | | |

| Rentabilidades extremas (i) | Trimestre actual | | Último año | | Últimos 3 años | |
|-----------------------------|------------------|------------|------------|-------|----------------|-------|
| | % | Fecha | % | Fecha | % | Fecha |
| Rentabilidad mínima (%) | -0,06 | 28-09-2022 | | | | |
| Rentabilidad máxima (%) | 0,04 | 20-07-2022 | | | | |

(i) Sólo se informa para las clases con una antigüedad mínima del periodo solicitado y siempre que no se haya modificado su vocación inversora

Se refiere a las rentabilidades máximas y mínimas entre dos valores liquidativos consecutivos.

La periodicidad de cálculo del valor liquidativo es *diaria*

Recuerde que rentabilidades pasadas no presuponen rentabilidades futuras. Sólo se informa si se ha mantenido una política de inversión homogénea en el período.

| Medidas de riesgo (%) | Acumulado año t actual | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--|------------------------|-----------------|--------|--------|--------|-------|------|------|------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | 2021 | 2020 | 2019 | 2017 |
| Volatilidad(ii) de: | | | | | | | | | |
| Valor liquidativo | | 0,35 | | 0,15 | 0,12 | 0,12 | 0,40 | 0,14 | 0,11 |
| Ibex-35 | | 16,45 | | | | | | | |
| Letra Tesoro 1 año | | 2,00 | | | | | | | |
| VaR histórico del valor liquidativo(iii) | | | | | | | | | |

(ii) Volatilidad histórica: Indica el riesgo de un valor en un periodo, a mayor volatilidad mayor riesgo. A modo comparativo se ofrece la volatilidad de distintas referencias. Sólo se informa de la volatilidad para los períodos con política de inversión homogénea.

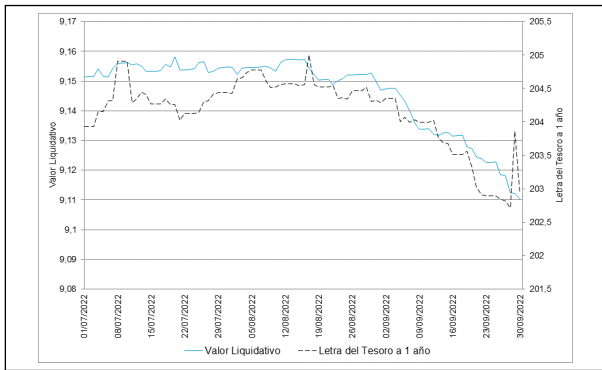
(iii) VaR histórico del valor liquidativo: Indica lo máximo que se puede perder, con un nivel de confianza del 99%, en el plazo de 1 mes, si se repitiese el comportamiento de la IIC de los últimos 5 años. El dato es a finales del periodo de referencia.

| Gastos (% s/ patrimonio medio) | Acumulado 2022 | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--------------------------------|----------------|-----------------|--------|--------|--------|-------|------|------|------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | 2021 | 2020 | 2019 | 2017 |
| Ratio total de gastos (iv) | 0,27 | 0,13 | 0,07 | 0,07 | 0,07 | 0,28 | 0,29 | 0,29 | 0,29 |

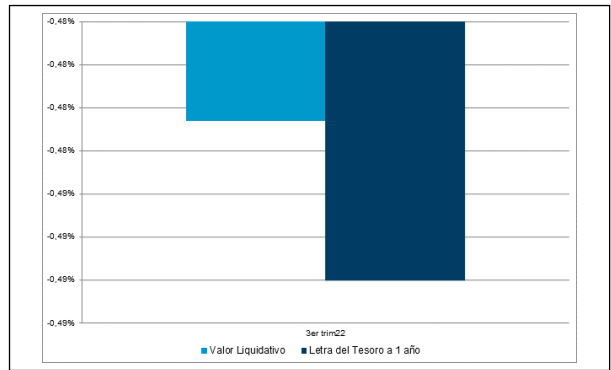
(iv) Incluye los gastos directos soportados en el periodo de referencia: comisión de gestión sobre patrimonio, comisión de depositario, auditoría, servicios bancarios (salvo gastos de financiación), y resto de gastos de gestión corriente, en términos de porcentaje sobre patrimonio medio del periodo. En el caso de fondos/compartimentos que invierten más de un 10% de su patrimonio en otras IIC este ratio incluye, de forma adicional al anterior, los gastos soportados indirectamente, derivados de esas inversiones, que incluyen las comisiones de suscripción y reembolso. Este ratio no incluye la comisión de gestión sobre resultados ni los costes de transacción por la compraventa de valores.

En el caso de inversiones en IIC que no calculan su ratio de gastos, éste se ha estimado para incorporarlo en el ratio de gastos.

Evolución del valor liquidativo últimos 5 años



Rentabilidad trimestral de los últimos 3 años



29/04/2022 "Se puede encontrar información adicional en el Anexo de este informe"

A) Individual PREMIER .Divisa EUR

| Rentabilidad (% sin anualizar) | Acumulado año t actual | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--------------------------------|------------------------|-----------------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|---------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | Año t-1 | Año t-2 | Año t-3 | Año t-5 |
| Rentabilidad IIC | | -0,43 | | | | | | | |

| Rentabilidades extremas (i) | Trimestre actual | | Último año | | Últimos 3 años | |
|-----------------------------|------------------|------------|------------|-------|----------------|-------|
| | % | Fecha | % | Fecha | % | Fecha |
| Rentabilidad mínima (%) | -0,06 | 28-09-2022 | | | | |
| Rentabilidad máxima (%) | 0,04 | 20-07-2022 | | | | |

(i) Sólo se informa para las clases con una antigüedad mínima del periodo solicitado y siempre que no se haya modificado su vocación inversora

Se refiere a las rentabilidades máximas y mínimas entre dos valores liquidativos consecutivos.

La periodicidad de cálculo del valor liquidativo es *diaria*

Recuerde que rentabilidades pasadas no presuponen rentabilidades futuras. Sólo se informa si se ha mantenido una política de inversión homogénea en el período.

| Medidas de riesgo (%) | Acumulado año t actual | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--|------------------------|-----------------|--------|--------|--------|-------|------|------|------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | 2021 | 2020 | 2019 | 2017 |
| Volatilidad(ii) de: | | | | | | | | | |
| Valor liquidativo | | 0,35 | | 0,15 | 0,12 | 0,12 | 0,40 | 0,14 | 0,11 |
| Ibex-35 | | 16,45 | | | | | | | |
| Letra Tesoro 1 año | | 2,00 | | | | | | | |
| VaR histórico del valor liquidativo(iii) | | | | | | | | | |

(ii) Volatilidad histórica: Indica el riesgo de un valor en un periodo, a mayor volatilidad mayor riesgo. A modo comparativo se ofrece la volatilidad de distintas referencias. Sólo se informa de la volatilidad para los períodos con política de inversión homogénea.

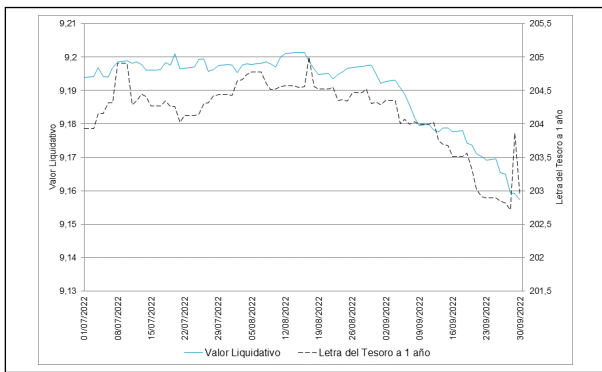
(iii) VaR histórico del valor liquidativo: Indica lo máximo que se puede perder, con un nivel de confianza del 99%, en el plazo de 1 mes, si se repitiese el comportamiento de la IIC de los últimos 5 años. El dato es a finales del periodo de referencia.

| Gastos (% s/ patrimonio medio) | Acumulado 2022 | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--------------------------------|----------------|-----------------|--------|--------|--------|-------|------|------|------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | 2021 | 2020 | 2019 | 2017 |
| Ratio total de gastos (iv) | 0,19 | 0,07 | 0,06 | 0,06 | 0,06 | 0,22 | 0,23 | 0,23 | 0,23 |

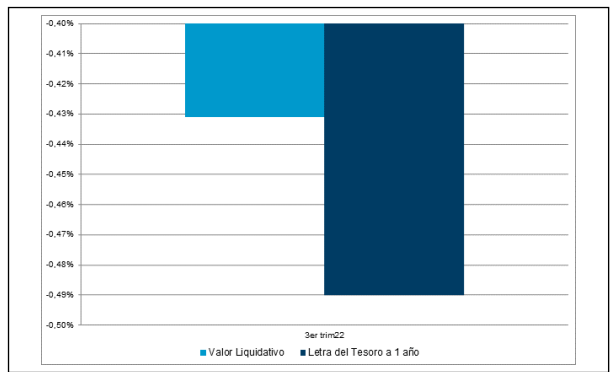
(iv) Incluye los gastos directos soportados en el periodo de referencia: comisión de gestión sobre patrimonio, comisión de depositario, auditoría, servicios bancarios (salvo gastos de financiación), y resto de gastos de gestión corriente, en términos de porcentaje sobre patrimonio medio del periodo. En el caso de fondos/compartimentos que invierten más de un 10% de su patrimonio en otras IIC este ratio incluye, de forma adicional al anterior, los gastos soportados indirectamente, derivados de esas inversiones, que incluyen las comisiones de suscripción y reembolso. Este ratio no incluye la comisión de gestión sobre resultados ni los costes de transacción por la compraventa de valores.

En el caso de inversiones en IIC que no calculan su ratio de gastos, éste se ha estimado para incorporarlo en el ratio de gastos.

Evolución del valor liquidativo últimos 5 años



Rentabilidad trimestral de los últimos 3 años



29/04/2022 "Se puede encontrar información adicional en el Anexo de este informe"

A) Individual CARTERA .Divisa EUR

| Rentabilidad (% sin anualizar) | Acumulad o año t actual | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--------------------------------|-------------------------------|--------------------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|---------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | Año t-1 | Año t-2 | Año t-3 | Año t-5 |
| Rentabilidad IIC | | -0,41 | | | | | | | |

| Rentabilidades extremas (i) | Trimestre actual | | Último año | | Últimos 3 años | |
|-----------------------------|------------------|------------|------------|-------|----------------|-------|
| | % | Fecha | % | Fecha | % | Fecha |
| Rentabilidad mínima (%) | -0,06 | 28-09-2022 | | | | |
| Rentabilidad máxima (%) | 0,04 | 20-07-2022 | | | | |

(i) Sólo se informa para las clases con una antigüedad mínima del periodo solicitado y siempre que no se haya modificado su vocación inversora

Se refiere a las rentabilidades máximas y mínimas entre dos valores liquidativos consecutivos.

La periodicidad de cálculo del valor liquidativo es *diaria*

Recuerde que rentabilidades pasadas no presuponen rentabilidades futuras. Sólo se informa si se ha mantenido una política de inversión homogénea en el período.

| Medidas de riesgo (%) | Acumulad o año t actual | Trimestral | | | | Anual | | | |
|---|-------------------------------|--------------------|--------|--------|--------|-------|------|------|------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | 2021 | 2020 | 2019 | 2017 |
| Volatilidad(ii) de: | | | | | | | | | |
| Valor liquidativo | | 0,35 | | 0,15 | 0,12 | 0,12 | 0,40 | 0,14 | 0,11 |
| Ibex-35 | | 16,45 | | | | | | | |
| Letra Tesoro 1 año | | 2,00 | | | | | | | |
| VaR histórico del valor liquidativo(iii) | | | | | | | | | |

(ii) Volatilidad histórica: Indica el riesgo de un valor en un periodo, a mayor volatilidad mayor riesgo. A modo comparativo se ofrece la volatilidad de distintas referencias. Sólo se informa de la volatilidad para los períodos con política de inversión homogénea.

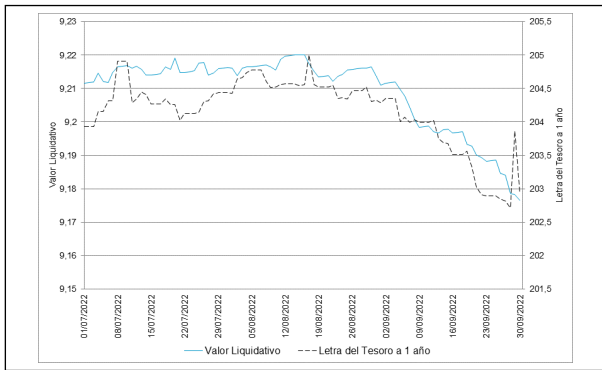
(iii) VaR histórico del valor liquidativo: Indica lo máximo que se puede perder, con un nivel de confianza del 99%, en el plazo de 1 mes, si se repitiese el comportamiento de la IIC de los últimos 5 años. El dato es a finales del periodo de referencia.

| Gastos (% s/ patrimonio medio) | Acumulado 2022 | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--------------------------------|----------------|-----------------|--------|--------|--------|-------|------|------|------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | 2021 | 2020 | 2019 | 2017 |
| Ratio total de gastos (iv) | 0,12 | 0,06 | 0,03 | 0,03 | 0,03 | 0,12 | 0,13 | 0,13 | 0,29 |

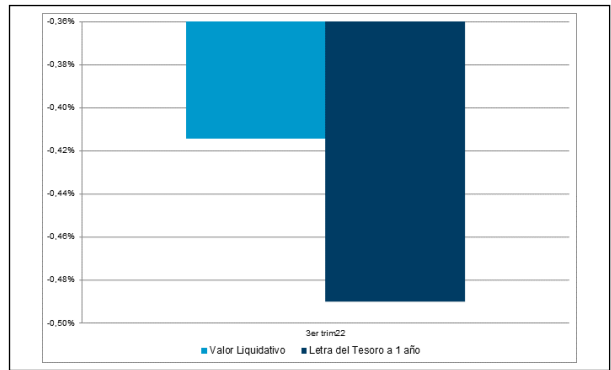
(iv) Incluye los gastos directos soportados en el periodo de referencia: comisión de gestión sobre patrimonio, comisión de depositario, auditoría, servicios bancarios (salvo gastos de financiación), y resto de gastos de gestión corriente, en términos de porcentaje sobre patrimonio medio del periodo. En el caso de fondos/compartimentos que invierten más de un 10% de su patrimonio en otras IIC este ratio incluye, de forma adicional al anterior, los gastos soportados indirectamente, derivados de esas inversiones, que incluyen las comisiones de suscripción y reembolso. Este ratio no incluye la comisión de gestión sobre resultados ni los costes de transacción por la compraventa de valores.

En el caso de inversiones en IIC que no calculan su ratio de gastos, éste se ha estimado para incorporarlo en el ratio de gastos.

Evolución del valor liquidativo últimos 5 años



Rentabilidad trimestral de los últimos 3 años



29/04/2022 "Se puede encontrar información adicional en el Anexo de este informe"

A) Individual PYME .Divisa EUR

| Rentabilidad (% sin anualizar) | Acumulado año t actual | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--------------------------------|------------------------|-----------------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|---------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | Año t-1 | Año t-2 | Año t-3 | Año t-5 |
| Rentabilidad IIC | | -0,51 | | | | | | | |

| Rentabilidades extremas (i) | Trimestre actual | | Último año | | Últimos 3 años | |
|-----------------------------|------------------|------------|------------|-------|----------------|-------|
| | % | Fecha | % | Fecha | % | Fecha |
| Rentabilidad mínima (%) | -0,06 | 28-09-2022 | | | | |
| Rentabilidad máxima (%) | 0,04 | 20-07-2022 | | | | |

(i) Sólo se informa para las clases con una antigüedad mínima del periodo solicitado y siempre que no se haya modificado su vocación inversora

Se refiere a las rentabilidades máximas y mínimas entre dos valores liquidativos consecutivos.

La periodicidad de cálculo del valor liquidativo es *diaria*

Recuerde que rentabilidades pasadas no presuponen rentabilidades futuras. Sólo se informa si se ha mantenido una política de inversión homogénea en el período.

| Medidas de riesgo (%) | Acumulado año t actual | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--|------------------------|-----------------|--------|--------|--------|-------|------|------|------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | 2021 | 2020 | 2019 | 2017 |
| Volatilidad(ii) de: | | | | | | | | | |
| Valor liquidativo | | 0,35 | | 0,15 | 0,12 | 0,12 | 0,40 | 0,14 | 0,11 |
| Ibex-35 | | 16,45 | | | | | | | |
| Letra Tesoro 1 año | | 2,00 | | | | | | | |
| VaR histórico del valor liquidativo(iii) | | | | | | | | | |

(ii) Volatilidad histórica: Indica el riesgo de un valor en un periodo, a mayor volatilidad mayor riesgo. A modo comparativo se ofrece la volatilidad de distintas referencias. Sólo se informa de la volatilidad para los períodos con política de inversión homogénea.

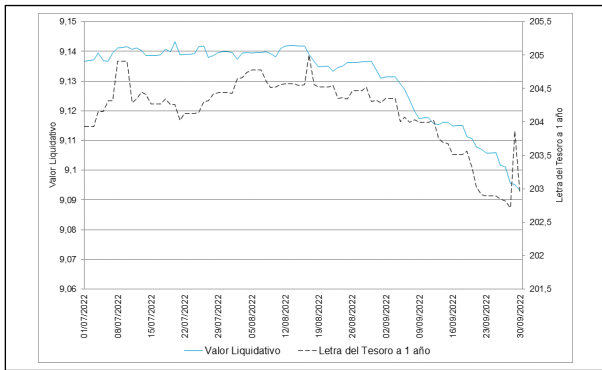
(iii) VaR histórico del valor liquidativo: Indica lo máximo que se puede perder, con un nivel de confianza del 99%, en el plazo de 1 mes, si se repitiese el comportamiento de la IIC de los últimos 5 años. El dato es a finales del periodo de referencia.

| Gastos (% s/ patrimonio medio) | Acumulado 2022 | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--------------------------------|----------------|-----------------|--------|--------|--------|-------|------|------|------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | 2021 | 2020 | 2019 | 2017 |
| Ratio total de gastos (iv) | 0,31 | 0,15 | 0,08 | 0,07 | 0,08 | 0,30 | 0,31 | 0,31 | 0,31 |

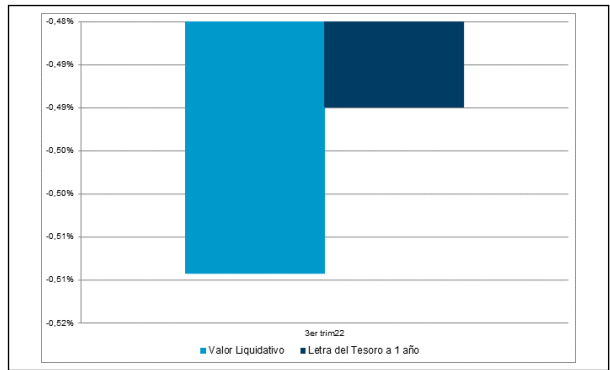
(iv) Incluye los gastos directos soportados en el periodo de referencia: comisión de gestión sobre patrimonio, comisión de depositario, auditoría, servicios bancarios (salvo gastos de financiación), y resto de gastos de gestión corriente, en términos de porcentaje sobre patrimonio medio del periodo. En el caso de fondos/compartimentos que invierten más de un 10% de su patrimonio en otras IIC este ratio incluye, de forma adicional al anterior, los gastos soportados indirectamente, derivados de esas inversiones, que incluyen las comisiones de suscripción y reembolso. Este ratio no incluye la comisión de gestión sobre resultados ni los costes de transacción por la compraventa de valores.

En el caso de inversiones en IIC que no calculan su ratio de gastos, éste se ha estimado para incorporarlo en el ratio de gastos.

Evolución del valor liquidativo últimos 5 años



Rentabilidad trimestral de los últimos 3 años



29/04/2022 "Se puede encontrar información adicional en el Anexo de este informe"

A) Individual EMPRESA .Divisa EUR

| Rentabilidad (% sin anualizar) | Acumulado año t actual | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--------------------------------|------------------------|-----------------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|---------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | Año t-1 | Año t-2 | Año t-3 | Año t-5 |
| Rentabilidad IIC | | -0,48 | | | | | | | |

| Rentabilidades extremas (i) | Trimestre actual | | Último año | | Últimos 3 años | |
|-----------------------------|------------------|------------|------------|-------|----------------|-------|
| | % | Fecha | % | Fecha | % | Fecha |
| Rentabilidad mínima (%) | -0,06 | 28-09-2022 | | | | |
| Rentabilidad máxima (%) | 0,04 | 20-07-2022 | | | | |

(i) Sólo se informa para las clases con una antigüedad mínima del periodo solicitado y siempre que no se haya modificado su vocación inversora

Se refiere a las rentabilidades máximas y mínimas entre dos valores liquidativos consecutivos.

La periodicidad de cálculo del valor liquidativo es *diaria*

Recuerde que rentabilidades pasadas no presuponen rentabilidades futuras. Sólo se informa si se ha mantenido una política de inversión homogénea en el período.

| Medidas de riesgo (%) | Acumulado año t actual | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--|------------------------|-----------------|--------|--------|--------|-------|------|------|------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | 2021 | 2020 | 2019 | 2017 |
| Volatilidad(ii) de: | | | | | | | | | |
| Valor liquidativo | | 0,35 | | 0,15 | 0,12 | 0,12 | 0,40 | 0,14 | 0,11 |
| Ibex-35 | | 16,45 | | | | | | | |
| Letra Tesoro 1 año | | 2,00 | | | | | | | |
| VaR histórico del valor liquidativo(iii) | | | | | | | | | |

(ii) Volatilidad histórica: Indica el riesgo de un valor en un periodo, a mayor volatilidad mayor riesgo. A modo comparativo se ofrece la volatilidad de distintas referencias. Sólo se informa de la volatilidad para los períodos con política de inversión homogénea.

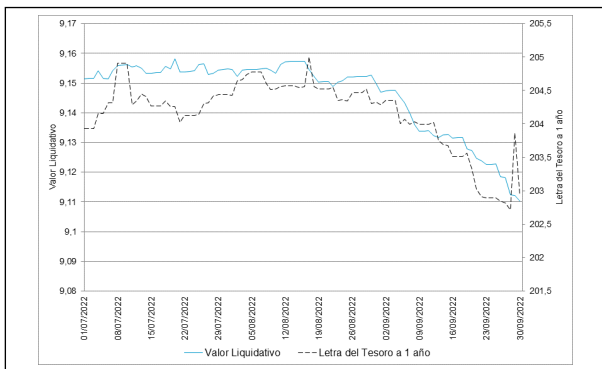
(iii) VaR histórico del valor liquidativo: Indica lo máximo que se puede perder, con un nivel de confianza del 99%, en el plazo de 1 mes, si se repitiese el comportamiento de la IIC de los últimos 5 años. El dato es a finales del periodo de referencia.

| Gastos (% s/ patrimonio medio) | Acumulado 2022 | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--------------------------------|----------------|-----------------|--------|--------|--------|-------|------|------|------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | 2021 | 2020 | 2019 | 2017 |
| Ratio total de gastos (iv) | 0,27 | 0,12 | 0,07 | 0,07 | 0,07 | 0,28 | 0,29 | 0,29 | 0,29 |

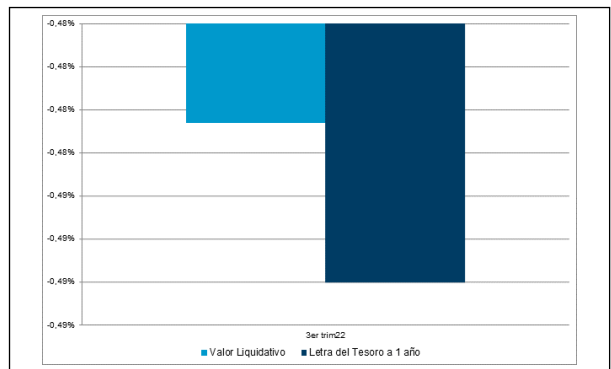
(iv) Incluye los gastos directos soportados en el periodo de referencia: comisión de gestión sobre patrimonio, comisión de depositario, auditoría, servicios bancarios (salvo gastos de financiación), y resto de gastos de gestión corriente, en términos de porcentaje sobre patrimonio medio del periodo. En el caso de fondos/compartimentos que invierten más de un 10% de su patrimonio en otras IIC este ratio incluye, de forma adicional al anterior, los gastos soportados indirectamente, derivados de esas inversiones, que incluyen las comisiones de suscripción y reembolso. Este ratio no incluye la comisión de gestión sobre resultados ni los costes de transacción por la compraventa de valores.

En el caso de inversiones en IIC que no calculan su ratio de gastos, éste se ha estimado para incorporarlo en el ratio de gastos.

Evolución del valor liquidativo últimos 5 años



Rentabilidad trimestral de los últimos 3 años



29/04/2022 "Se puede encontrar información adicional en el Anexo de este informe"

A) Individual CANALIZADOR .Divisa EUR

| Rentabilidad (% sin anualizar) | Acumulado año t actual | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--------------------------------|------------------------|-----------------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|---------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | Año t-1 | Año t-2 | Año t-3 | Año t-5 |
| Rentabilidad IIC | | -0,41 | | | | | | | |

| Rentabilidades extremas (i) | Trimestre actual | | Último año | | Últimos 3 años | |
|-----------------------------|------------------|------------|------------|-------|----------------|-------|
| | % | Fecha | % | Fecha | % | Fecha |
| Rentabilidad mínima (%) | -0,06 | 28-09-2022 | | | | |
| Rentabilidad máxima (%) | 0,04 | 20-07-2022 | | | | |

(i) Sólo se informa para las clases con una antigüedad mínima del periodo solicitado y siempre que no se haya modificado su vocación inversora

Se refiere a las rentabilidades máximas y mínimas entre dos valores liquidativos consecutivos.

La periodicidad de cálculo del valor liquidativo es *diaria*

Recuerde que rentabilidades pasadas no presuponen rentabilidades futuras. Sólo se informa si se ha mantenido una política de inversión homogénea en el período.

| Medidas de riesgo (%) | Acumulado año t actual | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--|------------------------|-----------------|--------|--------|--------|-------|------|------|------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | 2021 | 2020 | 2019 | 2017 |
| Volatilidad(ii) de: | | | | | | | | | |
| Valor liquidativo | | 0,35 | | 0,15 | 0,12 | 0,12 | 0,40 | 0,14 | 0,11 |
| Ibex-35 | | 16,45 | | | | | | | |
| Letra Tesoro 1 año | | 2,00 | | | | | | | |
| VaR histórico del valor liquidativo(iii) | | | | | | | | | |

(ii) Volatilidad histórica: Indica el riesgo de un valor en un periodo, a mayor volatilidad mayor riesgo. A modo comparativo se ofrece la volatilidad de distintas referencias. Sólo se informa de la volatilidad para los períodos con política de inversión homogénea.

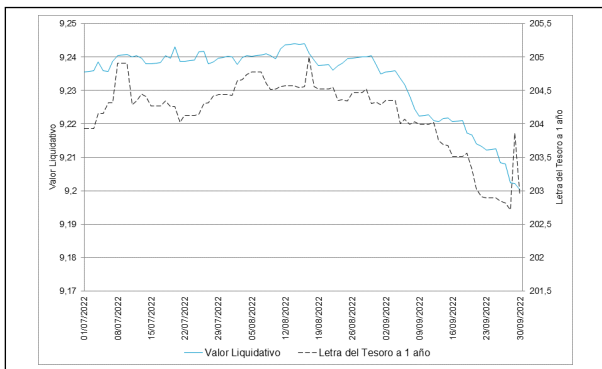
(iii) VaR histórico del valor liquidativo: Indica lo máximo que se puede perder, con un nivel de confianza del 99%, en el plazo de 1 mes, si se repitiese el comportamiento de la IIC de los últimos 5 años. El dato es a finales del periodo de referencia.

| Gastos (% s/ patrimonio medio) | Acumulado 2022 | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--------------------------------|----------------|-----------------|--------|--------|--------|-------|------|------|------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | 2021 | 2020 | 2019 | 2017 |
| Ratio total de gastos (iv) | 0,11 | 0,06 | 0,03 | 0,03 | 0,03 | 0,12 | 0,13 | 0,13 | 0,23 |

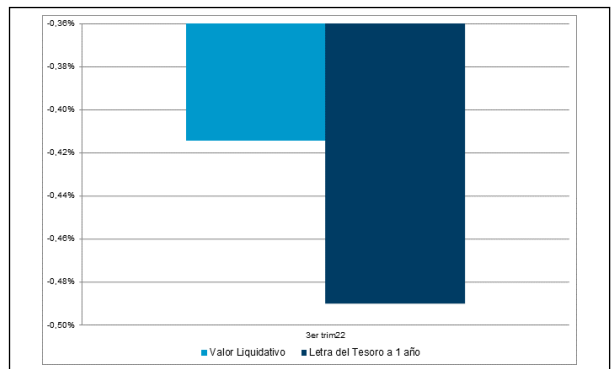
(iv) Incluye los gastos directos soportados en el periodo de referencia: comisión de gestión sobre patrimonio, comisión de depositario, auditoría, servicios bancarios (salvo gastos de financiación), y resto de gastos de gestión corriente, en términos de porcentaje sobre patrimonio medio del periodo. En el caso de fondos/compartimentos que invierten más de un 10% de su patrimonio en otras IIC este ratio incluye, de forma adicional al anterior, los gastos soportados indirectamente, derivados de esas inversiones, que incluyen las comisiones de suscripción y reembolso. Este ratio no incluye la comisión de gestión sobre resultados ni los costes de transacción por la compraventa de valores.

En el caso de inversiones en IIC que no calculan su ratio de gastos, éste se ha estimado para incorporarlo en el ratio de gastos.

Evolución del valor liquidativo últimos 5 años



Rentabilidad trimestral de los últimos 3 años



29/04/2022 "Se puede encontrar información adicional en el Anexo de este informe"

A) Individual SUPERIOR .Divisa EUR

| Rentabilidad (% sin anualizar) | Acumulad o año t actual | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--------------------------------|-------------------------------|--------------------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|---------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | Año t-1 | Año t-2 | Año t-3 | Año t-5 |
| Rentabilidad IIC | | -0,42 | | | | | | | |

| Rentabilidades extremas (i) | Trimestre actual | | Último año | | Últimos 3 años | |
|-----------------------------|------------------|------------|------------|-------|----------------|-------|
| | % | Fecha | % | Fecha | % | Fecha |
| Rentabilidad mínima (%) | -0,06 | 28-09-2022 | | | | |
| Rentabilidad máxima (%) | 0,04 | 20-07-2022 | | | | |

(i) Sólo se informa para las clases con una antigüedad mínima del periodo solicitado y siempre que no se haya modificado su vocación inversora

Se refiere a las rentabilidades máximas y mínimas entre dos valores liquidativos consecutivos.

La periodicidad de cálculo del valor liquidativo es *diaria*

Recuerde que rentabilidades pasadas no presuponen rentabilidades futuras. Sólo se informa si se ha mantenido una política de inversión homogénea en el período.

| Medidas de riesgo (%) | Acumulad o año t actual | Trimestral | | | | Anual | | | |
|---|-------------------------------|--------------------|--------|--------|--------|-------|------|---------|---------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | 2021 | 2020 | Año t-3 | Año t-5 |
| Volatilidad(ii) de: | | | | | | | | | |
| Valor liquidativo | | 0,35 | | 0,15 | 0,12 | 0,12 | 0,40 | | |
| Ibex-35 | | 16,45 | | | | | | | |
| Letra Tesoro 1 año | | 2,00 | | | | | | | |
| VaR histórico del valor liquidativo(iii) | | | | | | | | | |

(ii) Volatilidad histórica: Indica el riesgo de un valor en un periodo, a mayor volatilidad mayor riesgo. A modo comparativo se ofrece la volatilidad de distintas referencias. Sólo se informa de la volatilidad para los períodos con política de inversión homogénea.

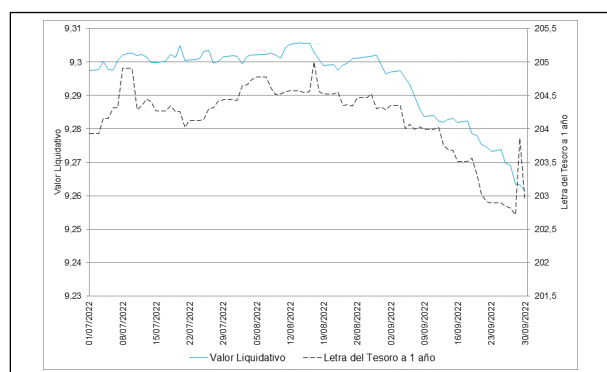
(iii) VaR histórico del valor liquidativo: Indica lo máximo que se puede perder, con un nivel de confianza del 99%, en el plazo de 1 mes, si se repitiese el comportamiento de la IIC de los últimos 5 años. El dato es a finales del periodo de referencia.

| Gastos (% s/ patrimonio medio) | Acumulado 2022 | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--------------------------------|----------------|-----------------|--------|--------|--------|-------|------|---------|---------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | 2021 | 2020 | Año t-3 | Año t-5 |
| Ratio total de gastos (iv) | 0,14 | 0,06 | 0,04 | 0,04 | 0,04 | 0,14 | 0,15 | | |

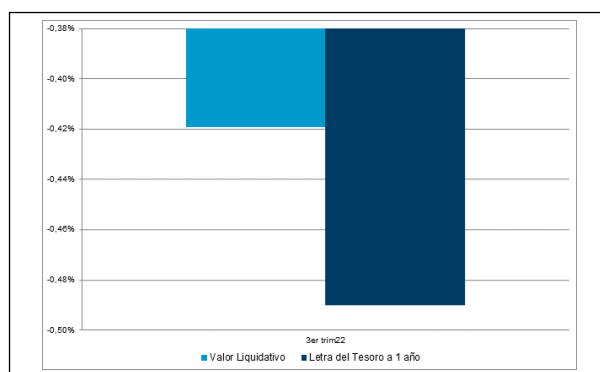
(iv) Incluye los gastos directos soportados en el periodo de referencia: comisión de gestión sobre patrimonio, comisión de depositario, auditoría, servicios bancarios (salvo gastos de financiación), y resto de gastos de gestión corriente, en términos de porcentaje sobre patrimonio medio del periodo. En el caso de fondos/compartimentos que invierten más de un 10% de su patrimonio en otras IIC este ratio incluye, de forma adicional al anterior, los gastos soportados indirectamente, derivados de esas inversiones, que incluyen las comisiones de suscripción y reembolso. Este ratio no incluye la comisión de gestión sobre resultados ni los costes de transacción por la compraventa de valores.

En el caso de inversiones en IIC que no calculan su ratio de gastos, éste se ha estimado para incorporarlo en el ratio de gastos.

Evolución del valor liquidativo últimos 5 años



Rentabilidad trimestral de los últimos 3 años



29/04/2022 "Se puede encontrar información adicional en el Anexo de este informe"

B) Comparativa

Durante el periodo de referencia, la rentabilidad media en el periodo de referencia de los fondos gestionados por la Sociedad Gestora se presenta en el cuadro adjunto. Los fondos se agrupan según su vocación inversora.

| Vocación inversora | Patrimonio gestionado* (miles de euros) | Nº de partícipes* | Rentabilidad Trimestral media** |
|--|---|-------------------|---------------------------------|
| Renta Fija Euro | 2.492.918 | 64.008 | -0,97 |
| Renta Fija Internacional | 187.528 | 22.247 | -0,67 |
| Renta Fija Mixta Euro | 64.881 | 856 | -2,71 |
| Renta Fija Mixta Internacional | 987.617 | 24.033 | -3,21 |
| Renta Variable Mixta Euro | 0 | 0 | 0,00 |
| Renta Variable Mixta Internacional | 261.106 | 13.156 | -2,55 |
| Renta Variable Euro | 86.763 | 9.037 | -2,66 |
| Renta Variable Internacional | 937.666 | 57.982 | -0,84 |
| IIC de Gestión Pasiva | 0 | 0 | 0,00 |
| Garantizado de Rendimiento Fijo | 175.150 | 5.389 | -2,15 |
| Garantizado de Rendimiento Variable | 1.244.679 | 41.055 | -1,92 |
| De Garantía Parcial | 0 | 0 | 0,00 |
| Retorno Absoluto | 57.174 | 6.502 | 0,25 |
| Global | 2.851.209 | 61.923 | -1,90 |
| FMM a Corto Plazo de Valor Liquidativo Variable | 0 | 0 | 0,00 |
| FMM a Corto Plazo de Valor Liq. Constante de Deuda Pública | 0 | 0 | 0,00 |
| FMM a Corto Plazo de Valor Liquidativo de Baja Volatilidad | 0 | 0 | 0,00 |
| FMM Estándar de Valor Liquidativo Variable | 0 | 0 | 0,00 |

| Vocación inversora | Patrimonio gestionado* (miles de euros) | Nº de partícipes* | Rentabilidad Trimestral media** |
|--|---|-------------------|---------------------------------|
| Renta Fija Euro Corto Plazo | 340.625 | 7.609 | 0,00 |
| IIC que Replica un Índice | 0 | 0 | 0,00 |
| IIC con Objetivo Concreto de Rentabilidad No Garantizado | 15.960 | 465 | -1,97 |
| Total fondos | 9.703.276 | 314.262 | -1,63 |

*Medias.

**Rentabilidad media ponderada por patrimonio medio de cada FI en el periodo

2.3 Distribución del patrimonio al cierre del período (Importes en miles de EUR)

| Distribución del patrimonio | Fin periodo actual | | Fin periodo anterior | |
|---|--------------------|--------------------|----------------------|--------------------|
| | Importe | % sobre patrimonio | Importe | % sobre patrimonio |
| (+) INVERSIONES FINANCIERAS | 2.251.168 | 96,87 | 2.071.354 | 91,92 |
| * Cartera interior | 145.377 | 6,26 | 145.226 | 6,44 |
| * Cartera exterior | 2.112.444 | 90,90 | 1.933.245 | 85,79 |
| * Intereses de la cartera de inversión | -6.653 | -0,29 | -7.117 | -0,32 |
| * Inversiones dudosas, morosas o en litigio | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| (+) LIQUIDEZ (TESORERÍA) | 79.661 | 3,43 | 180.696 | 8,02 |
| (+/-) RESTO | -6.913 | -0,30 | 1.355 | 0,06 |
| TOTAL PATRIMONIO | 2.323.916 | 100,00 % | 2.253.405 | 100,00 % |

Notas:

El período se refiere al trimestre o semestre, según sea el caso.

Las inversiones financieras se informan a valor e estimado de realización.

2.4 Estado de variación patrimonial

| | % sobre patrimonio medio | | | % variación respecto fin periodo anterior |
|--|------------------------------|--------------------------------|---------------------------|---|
| | Variación del período actual | Variación del periodo anterior | Variación acumulada anual | |
| PATRIMONIO FIN PERIODO ANTERIOR (miles de EUR) | 2.253.405 | 2.069.757 | 2.086.772 | |
| ± Suscripciones/ reembolsos (neto) | 3,48 | 9,09 | 12,21 | -58,77 |
| - Beneficios brutos distribuidos | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| ± Rendimientos netos | -0,47 | -0,65 | -1,39 | -21,73 |
| (+) Rendimientos de gestión | -0,37 | -0,59 | -1,16 | -33,26 |
| + Intereses | 0,04 | -0,01 | 0,00 | -450,93 |
| + Dividendos | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| ± Resultados en renta fija (realizadas o no) | -0,61 | -0,65 | -1,53 | 1,61 |
| ± Resultados en renta variable (realizadas o no) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| ± Resultados en depósitos (realizadas o no) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| ± Resultado en derivados (realizadas o no) | 0,20 | 0,08 | 0,40 | 166,06 |
| ± Resultado en IIC (realizados o no) | 0,00 | -0,01 | -0,03 | -100,15 |
| ± Otros resultados | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| ± Otros rendimientos | 0,00 | 0,00 | -0,01 | 151,58 |
| (-) Gastos repercutidos | -0,10 | -0,06 | -0,22 | 96,19 |
| - Comisión de gestión | -0,10 | -0,05 | -0,20 | 106,94 |
| - Comisión de depositario | -0,01 | -0,01 | -0,02 | 31,82 |
| - Gastos por servicios exteriores | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -6,14 |
| - Otros gastos de gestión corriente | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1,19 |
| - Otros gastos repercutidos | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (+) Ingresos | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| + Comisiones de descuento a favor de la IIC | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| + Comisiones retrocedidas | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

| | % sobre patrimonio medio | | | % variación respecto fin periodo anterior |
|--|------------------------------|--------------------------------|---------------------------|---|
| | Variación del período actual | Variación del período anterior | Variación acumulada anual | |
| + Otros ingresos | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| PATRIMONIO FIN PERIODO ACTUAL (miles de EUR) | 2.323.916 | 2.253.405 | 2.323.916 | |

Nota: El período se refiere al trimestre o semestre, según sea el caso.

3. Inversiones financieras

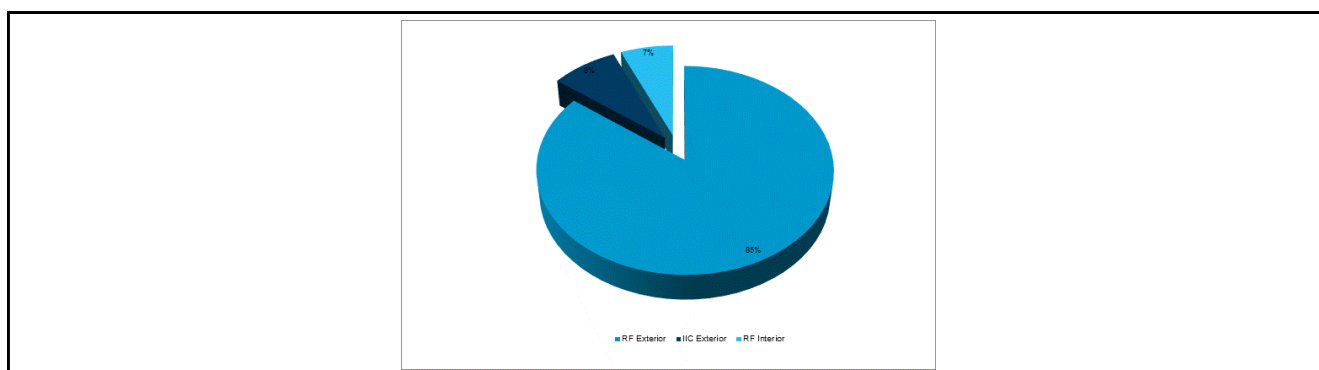
3.1 Inversiones financieras a valor estimado de realización (en miles de EUR) y en porcentaje sobre el patrimonio, al cierre del periodo

| Descripción de la inversión y emisor | Periodo actual | | Periodo anterior | |
|--|------------------|-------|------------------|-------|
| | Valor de mercado | % | Valor de mercado | % |
| TOTAL RENTA FIJA COTIZADA | 145.377 | 6,26 | 145.226 | 6,44 |
| TOTAL RENTA FIJA | 145.377 | 6,26 | 145.226 | 6,44 |
| TOTAL INVERSIONES FINANCIERAS INTERIOR | 145.377 | 6,26 | 145.226 | 6,44 |
| TOTAL RENTA FIJA COTIZADA | 1.929.564 | 83,03 | 1.731.519 | 76,84 |
| TOTAL RENTA FIJA | 1.929.564 | 83,03 | 1.731.519 | 76,84 |
| TOTAL IIC | 183.487 | 7,90 | 202.870 | 9,00 |
| TOTAL INVERSIONES FINANCIERAS EXTERIOR | 2.113.051 | 90,93 | 1.934.389 | 85,84 |
| TOTAL INVERSIONES FINANCIERAS | 2.258.428 | 97,18 | 2.079.614 | 92,29 |

Notas: El período se refiere al final del trimestre o semestre, según sea el caso.

Los productos estructurados suponen un 0,00% de la cartera de inversiones financieras del fondo o compartimento.

3.2 Distribución de las inversiones financieras, al cierre del período: Porcentaje respecto al patrimonio total



3.3 Operativa en derivados. Resumen de las posiciones abiertas al cierre del periodo (importes en miles de EUR)

| Subyacente | Instrumento | Importe nominal comprometido | Objetivo de la inversión |
|--------------------------------|---|------------------------------|--------------------------|
| TOTAL DERECHOS | | 0 | |
| BONO NOCIONAL ALEMAN 2 AÑOS 6% | V/ FUTURO EURO-SCHATZ 2YR 6% VT.08/12/22 | 364.426 | Inversión |
| Total subyacente renta fija | | 364426 | |
| TOTAL OBLIGACIONES | | 364426 | |

4. Hechos relevantes

| | SI | NO |
|---|----|----|
| a. Suspensión temporal de suscripciones/reembolsos | | X |
| b. Reanudación de suscripciones/reembolsos | | X |
| c. Reembolso de patrimonio significativo | | X |
| d. Endeudamiento superior al 5% del patrimonio | | X |
| e. Sustitución de la sociedad gestora | | X |
| f. Sustitución de la entidad depositaria | | X |
| g. Cambio de control de la sociedad gestora | | X |
| h. Cambio en elementos esenciales del folleto informativo | | X |
| i. Autorización del proceso de fusión | | X |
| j. Otros hechos relevantes | X | |

5. Anexo explicativo de hechos relevantes

01/08/2022 Conociendo que la media diaria del cierre oficial del índice EUR Swap 1 año durante los últimos 10 días hábiles del mes de julio de 2022 ha sido 1,035% anual, se informa de las comisiones aplicables a las distintas clases de participaciones de SABADELL MIENTO, FI durante el período comprendido entre el 1 de agosto de 2022 y el 31 de enero de 2023: Clase Comisión de gestión anual sobre el patrimonio Comisión de depositaria anual sobre el patrimonio BASE 0,85% 0,05% PLUS 0,55% 0,05% PREMIER 0,30% 0,02% CARTERA 0,25% 0,02% PYME 0,70% 0,05% EMPRESA 0,55% 0,05% CANALIZADOR 0,25% 0,02% SUPERIOR 0,27% 0,02%") A consecuencia de la fusión de BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, Sucursal en España con su entidad matriz, BNP PARIBAS, S.A., Sucursal en España, esta última ha pasado a ser la nueva entidad depositaria del Fondo. La citada sustitución de entidad depositaria entró en vigor el pasado 1 de octubre y se ha inscrito en la Comisión Nacional del Mercado de Valores el reglamento actualizado que la recoge.

6. Operaciones vinculadas y otras informaciones

| | SI | NO |
|--|----|----|
| a. Partícipes significativos en el patrimonio del fondo (porcentaje superior al 20%) | X | |
| b. Modificaciones de escasa relevancia en el Reglamento | | X |
| c. Gestora y el depositario son del mismo grupo (según artículo 4 de la LMV) | | X |
| d. Se han realizado operaciones de adquisición y venta de valores en los que el depositario ha actuado como vendedor o comprador, respectivamente | | X |
| e. Se han adquirido valores o instrumentos financieros emitidos o avalados por alguna entidad del grupo de la gestora o depositario, o alguno de éstos ha actuado como colocador, asegurador, director o asesor, o se han prestado valores a entidades vinculadas. | X | |
| f. Se han adquirido valores o instrumentos financieros cuya contrapartida ha sido otra una entidad del grupo de la gestora o depositario, u otra IIC gestionada por la misma gestora u otra gestora del grupo. | | X |
| g. Se han percibido ingresos por entidades del grupo de la gestora que tienen como origen comisiones o gastos satisfechos por la IIC. | | X |
| h. Otras informaciones u operaciones vinculadas | X | |

7. Anexo explicativo sobre operaciones vinculadas y otras informaciones

Existe un partícipe con un saldo de 489.730.021,21 euros que representa un 21,73% sobre el total del Fondo.

El Fondo ha realizado operaciones de adquisición de valores o instrumentos financieros emitidos o avalados por alguna entidad del grupo de Crédit Agricole, S.A., o en los que alguna entidad del grupo de Crédit Agricole, S.A. ha actuado como colocador, asegurador, director o asesor por importe de 7.963.920,00 euros, equivalentes a un 0,34% del patrimonio medio del Fondo.

El Fondo ha realizado operaciones de adquisición de valores o instrumentos financieros emitidos o avalados por alguna entidad del grupo de BNP Paribas, S.A., o en los que alguna entidad del grupo de BNP Paribas, S.A., ha actuado como colocador, asegurador, director o asesor por importe de 15.804.012,00 euros, equivalentes a un 0,67% del patrimonio medio del Fondo.

El Fondo puede realizar operaciones de compraventa de activos o valores negociados en mercados secundarios oficiales, incluso aquéllos emitidos o avalados por entidades del grupo de Crédit Agricole, S.A. y/o del grupo BNP Paribas, S.A., operaciones de compraventa de divisa, así como operaciones de compraventa de títulos de deuda pública con pacto de recompra en las que actúen como intermediarios o liquidadores entidades del grupo de Crédit Agricole, S.A. y/o del grupo de BNP Paribas, S.A. Esta Sociedad Gestora verifica que dichas operaciones se realicen a precios y condiciones de mercado.

La remuneración de las cuentas y depósitos del Fondo en la entidad depositaria se realiza a precios y condiciones de mercado.

8. Información y advertencias a instancia de la CNMV

No aplicable

9. Anexo explicativo del informe periódico

1. SITUACION DE LOS MERCADOS Y EVOLUCIÓN DEL FONDO. a) Visión de la gestora/sociedad sobre la situación de los mercados. Durante las primeras semanas del trimestre vimos una cierta relajación de la aversión al riesgo. Las bolsas recuperaban mientras los diferenciales de tipos retrocedían y los tipos de la deuda a largo plazo se mantenían cerca de los mínimos del verano. En la segunda quincena de agosto el tono cambió radicalmente. A pesar de que los datos de actividad económica seguían deteriorándose, las expectativas de inflación para 2022 y 2023 aumentaron sensiblemente y los bancos centrales, con la Fed al frente, se mostraron preocupados y dispuestos a ser más beligerantes contra la inflación, aunque ello comportase sufrimiento económico. En consecuencia los tipos de interés repuntaron, y bolsas y crédito volvieron a la debilidad, mientras el dólar se fortaleció aún más. En septiembre las bolsas siguieron bajando hasta sus mínimos anuales y los activos de renta fija continuaron su caída en precio como consecuencia de la elevación de tipos de interés y de los diferenciales de crédito. Elementos de inestabilidad, como los planes de expansión fiscal en Gran Bretaña, que obligaron a su banco central a intervenir para estabilizar la deuda y la divisa, se han añadido al panorama inversor. ¿Es lo que hemos visto en septiembre ya una capitulación de los activos de riesgo? Es difícil saberlo y por tanto mantenemos una actitud vigilante y de máxima flexibilidad en el posicionamiento. La relajación de junio y julio en los tipos de la deuda resultó ser un espejismo. Los índices de inflación no dan tregua, especialmente la energía. A finales de agosto, en su reunión de Jackson Hole, los banqueros centrales dejaron claro que van a luchar contra la inflación cueste lo que cueste. Tanto los bonos del Tesoro de Estados Unidos como los bonos europeos iniciaron una nueva escalada. Los activos de crédito, que también habían estrechado sus diferenciales, volvieron a ampliar, en una clara señal de aversión al riesgo. En septiembre se completa el peor trimestre del año para los tipos de interés, a causa de la persistente inflación y la reacción agresiva de los bancos centrales. La rentabilidad de la deuda pública alemana a 10 años ha subido 77pb en el trimestre, uno de los movimientos de más intensidad de los últimos años, como reacción al endurecimiento de la política monetaria. Los plazos más cortos también se han visto afectados por la misma tendencia. La renta fija privada también ha continuado ampliando sus diferenciales, tanto en Investment Grade como en High Yield, en un movimiento de aversión al riesgo ante el riesgo de recesión, especialmente en Europa. En los mercados de divisas, el dólar estadounidense volvió a tener otro trimestre sólido debido a las fuertes subidas de tipos de interés de la Reserva Federal y la huida a activos seguros dada la preocupación por la economía mundial y la crisis energética y la incertidumbre en torno al conflicto entre Rusia y Ucrania. En el tercer trimestre, el índice del dólar estadounidense ganó +7,1 % (septiembre +3,1 %), marcando la primera vez desde finales de la década de 1990 que el dólar se ha fortalecido durante 5 trimestres consecutivos. En general, el dólar se fortaleció frente a todas las monedas principales en el tercer trimestre y en septiembre: +7,0 % frente al euro, +9,0 % frente a la libra esterlina, +6,6 % frente al yen japonés, +7,4 % frente al dólar canadiense y +7,9 % frente al dólar australiano. El euro tuvo un trimestre y mes mixto: en el tercer trimestre se debilitó frente al dólar estadounidense (-6,5 %), el franco suizo (-3,4 %) y el yen japonés (-0,3 %), pero se fortaleció frente a la libra esterlina (+1,9 %) y las divisas de materias primas (+0,9% frente al dólar australiano y +0,5% frente al dólar canadiense). En los Mercados Emergentes, la renta variable se vio afectada por el aumento de los tipos de interés de EE. UU. a niveles vistos en el período previo a la crisis financiera mundial, lecturas altas de inflación y desaceleración del crecimiento. Desde una perspectiva macro, el impulso de los mercados emergentes se está deteriorando debido a la desaceleración de las exportaciones y al debilitamiento de la demanda interna. A nivel regional el deterioro macro más pronunciado se dio en Europa del Este seguido de Latam mientras que por el contrario Asia se mantuvo estable. Las perspectivas de inflación de los mercados emergentes no se han deteriorado más durante el último mes y se espera que la inflación se estabilice o alcance un pico leve en algunos casos. En términos de política monetaria, en septiembre, la mayoría de los bancos centrales de mercados emergentes continuaron subiendo con algunos bancos centrales en Asia acelerando el ritmo de subidas de tipos mientras que otros, como los bancos centrales de Brasil y el banco central húngaro, anunciaron el final

del ciclo de endurecimiento debido al deterioro de la perspectiva de crecimiento. En este entorno, los mercados emergentes experimentaron un trimestre negativo, con el índice MSCI EM cayendo un -11,6 % en términos de rentabilidad total en dólares estadounidenses y un -8,2 % en términos locales. En términos de USD, Latam superó a otras regiones dentro de los mercados emergentes con una rentabilidad del +0,7 %, mientras que Emea disminuyó un -6,3 % y Asia cayó un -14,7 %. En términos locales y durante el trimestre, Latam volvió a ser la región con mejor desempeño relativo (+3,1 %), seguida de Emea con una caída del -2,8 %, mientras que Asia cayó un -11,3 %. Tanto los mercados de renta variable desarrollados como los emergentes cayeron en el tercer trimestre. Los mercados de valores de EE. UU. tuvieron un trimestre negativo con el S&P500 cayendo -4,9%. La perspectiva de un ritmo más agresivo de subidas de tipos por parte de la Fed y unos datos macro más débiles afectaron a la confianza de los inversores. El Dow Jones 30, con un número de compañías reducido, tuvo un desempeño relativamente peor en el tercer trimestre con un rendimiento de -6,7%. En cambio, las acciones de pequeña capitalización y las acciones tecnológicas experimentaron un septiembre pobre con el Russell 2000 cayendo un -9,7% y el índice compuesto Nasdaq cayendo un -10,5%, pero ambos índices se comportaron relativamente bien en el tercer trimestre con un retorno del -2,5% y -4,1% respectivamente. Del mismo modo, el índice FANG+, que mide las cinco grandes empresas digitales (más las grandes capitalizaciones de mayor crecimiento), experimentó un trimestre negativo con una rentabilidad del -4,9%. En Europa, al igual que en EE. UU., los mercados subieron en la primera parte del trimestre debido a que se disiparon los temores de subidas de tipos de interés más agresivas. Sin embargo, las preocupaciones de una desaceleración económica más fuerte debido al choque energético y los bancos centrales endureciendo agresivamente para mantener la inflación bajo control pesaron sobre los mercados en la segunda parte del trimestre. En general, los índices bursátiles europeos registraron rentabilidades negativas: durante el trimestre, el MSCI Europe se depreció un -4,1 % en la rentabilidad total local y el MSCI EMU perdió un -4,7 %, mientras que el Euro Stoxx 50 en términos de retorno neto local tuvo un mejor desempeño al terminar el trimestre con una caída de -3.7%. Aunque la inflación subyacente podría estar tocando techo en Estados Unidos sigue muy por encima de los objetivos de la Reserva Federal. Este hecho, junto con los riesgos renovados de orden geopolítico por la escalada militar en Ucrania, el cambio de gobierno en Italia y las próximas elecciones en Estados Unidos y Brasil, contribuyen a un panorama complejo en el que no es fácil recuperar la estabilidad. En este entorno, en el que además las perspectivas de crecimiento se han deteriorado, creemos que es preciso mantener un posicionamiento basado en la cautela. En renta fija preferimos duraciones algo más largas, acercándonos al nivel neutral de cada cartera y apostamos todavía por emisores de alta calidad crediticia. En acciones seguimos con menor peso del que consideremos neutral, y una preferencia por Estados Unidos frente a Europa. b) Decisiones generales de inversión adoptadas. Durante el trimestre el Fondo ha gestionado activamente y de forma dinámica su exposición, tanto sectorialmente como a nivel de títulos individuales. Se han realizado mayoritariamente compras y unas pocas ventas de bonos corporativos y financieros de cupón fijo y variable. Se han realizado ventas de futuros del dos años alemán para cubrir el riesgo de tipos en la cartera. c) Índice de referencia. No aplica d) Evolución del Patrimonio, participes, rentabilidad y gastos de la IIC. El patrimonio sube desde 2.253.405.257,61 euros hasta 2.323.916.182,06 euros, es decir un 3,13%. El número de participes baja desde 38.863 unidades hasta 38.806 unidades. La rentabilidad en el trimestre ha sido de un -0,54% para la clase base, un -0,48% para la clase plus, un -0,43% para la clase premier, un -0,41% para la clase cartera, un -0,51% para la clase pyme, un -0,48% para la clase empresa, un -0,41% para la clase canalizador y un -0,42% para la clase superior. La referida rentabilidad obtenida es neta de unos gastos que han supuesto una carga del 0,18% para la clase base, un 0,13% para la clase plus, un 0,07% para la clase premier, un 0,06% para la clase cartera, un 0,15% para la clase pyme, un 0,12% para la clase empresa, un 0,06% para la clase canalizador y un 0,06% para la clase superior sobre el patrimonio medio. e) Rendimiento del fondo en comparación con el resto de fondos de la gestora. Durante este periodo la rentabilidad del Fondo ha sido de un -0,54%, superior a la rentabilidad media ponderada del total de Fondos gestionados por Sabadell Asset Management y ha sido inferior al -0,49% que se hubiera obtenido al invertir en Letras del Tesoro a 1 año. La rentabilidad del Fondo ha estado en línea con la de los mercados hacia los que orienta sus inversiones.

2. INFORMACION SOBRE LAS INVERSIONES.

a) Inversiones concretas realizadas durante el periodo. Durante el trimestre se han realizado mayoritariamente compras de bonos corporativos y financieros de cupón fijo. El Fondo ha continuado reduciendo su duración, con coberturas de futuros sobre el bono alemán a dos años, manteniéndola por debajo de su nivel objetivo. También se ha reducido el nivel de riesgo de la Renta Fija Privada en cartera. El fondo está sobreponderado en Renta Fija Privada, en especial en el sector financiero y en menor medida en el de autos. A nivel geográfico, las principales exposiciones son a Francia, Estados Unidos, España y Alemania. Los activos que más han contribuido a la rentabilidad

del Fondo en el periodo han sido: FUTURO EURO-SCHATZ 2YR 6% VT.08/12/22 (0.133%); FUTURO EURO-SCHATZ 2YR 6% VT.08/09/22 (0.097%); PART.AMUNDI EURO LIQ RATED SRI-Z (0.003%); OB.BANK AMERICA %VAR VT.25/04/24(C4/23) (0.002%); OB.FORTUM OYJ 2,25% VT.06/09/2022 (0.002%). Los activos que menos han contribuido a la rentabilidad del Fondo en el periodo han sido: OB.ESSITY 1,125% VT.27/3/24(C12/23) (-0.014%); BO.BANQUE FED CR 0,125% VT.05/02/2024 (-0.012%); OB.AMER HONDA FIN 0,75% VT.17/01/2024 (-0.012%); OB.BNP PARIBAS SA 2,875% VT.26/09/23 (-0.011%); BO.VEOLIA ENV 0,892% VT.14/1/24 (C10/23) (-0.010%). b) Operativa de préstamo de valores.No aplica c) Operativa en derivados y adquisición temporal de activos.A lo largo del trimestre, el Fondo ha operado en los siguientes instrumentos derivados: futuros sobre el bono alemán a dos años (Euro-Schatz Future). El objetivo de todas las posiciones en derivados es, por un lado, la inversión complementaria a las posiciones de contado permitiendo una mayor flexibilidad en la gestión de la cartera, y por otro, la gestión activa, tanto al alza como a la baja, de las expectativas sobre los mercados. El grado de inversión del Fondo, agregando a las posiciones de contado las posiciones en dichos instrumentos derivados, no se ha situado durante el trimestre por encima del 100% de su patrimonio. d) Otra información sobre inversiones.A la fecha de referencia 30/09/2021, el Fondo mantiene una cartera de activos de renta fija con una vida media de 0,621 años y con una TIR media bruta (esto es sin descontar los gastos y comisiones imputables al FI) a precios de mercado de 1,89%. No existirá predeterminación en cuanto a la calificación crediticia por las distintas agencias especializadas en la selección de inversiones de renta fija. El Fondo podría invertir hasta el 100% en emisiones de renta fija con una calificación crediticia inferior a investment grade. El nivel de inversión en este tipo de activos es de un 0,41% a cierre del período.3. EVOLUCION DEL OBJETIVO CONCRETO DE RENTABILIDAD.No aplica4. RIESGO ASUMIDO POR EL FONDO.El Fondo ha aumentado los niveles de riesgo acumulados respecto al trimestre anterior, tal y como reflejan los datos de volatilidad detallados en el informe, debido principalmente al incremento de los niveles de riesgo de los mercados hacia los que orienta sus inversiones. En este sentido, el Fondo ha experimentado durante el trimestre una volatilidad del 0,35% frente a la volatilidad del 1,08% de la Letra del Tesoro a 1 año.5. EJERCICIO DERECHOS POLITICOS.No aplica6. INFORMACION Y ADVERTENCIAS CNMV.A cierre del período, un 0,29% del patrimonio del Fondo está invertido en activos que presentan menores niveles de liquidez.7. ENTIDADES BENEFICIARIAS DEL FONDO SOLIDARIO E IMPORTE CEDIDO A LAS MISMAS.No aplica8. COSTES DERIVADOS DEL SERVICIO DE ANALISIS.No aplica9. COMPARTIMENTOS DE PROPOSITO ESPECIAL (SIDE POCKETS).No aplica10. PERSPECTIVAS DE MERCADO Y ACTUACION PREVISIBLE DEL FONDO.La gestión del Fondo estará, durante todo el tiempo que dure la presente situación, encaminada a mantener los riesgos controlados y en niveles limitados, y su gestión será acorde con la evolución de la situación económica actual. El Fondo se gestionará de forma dinámica y proactiva para aprovechar los movimientos de mercado, con la finalidad de alcanzar una revalorización a largo plazo representativa de la alcanzada por los fondos adscritos a la categoría "EAA Fund EUR Ultra Short-Term Bond" según establezca, en cada momento,MorningStar.

10. Detalle de inversiones financieras

| Descripción de la inversión y emisor | Divisa | Periodo actual | | Periodo anterior | |
|---|--------|------------------|------|------------------|------|
| | | Valor de mercado | % | Valor de mercado | % |
| ES0312300017 - AYT GENOVA HIPO IX A2 %VAR VT.15/07/39 | EUR | 10.328 | 0,44 | 10.810 | 0,48 |
| ES0312349014 - AYT GENOVA HIPO VI A2 %VAR VT.15/01/38 | EUR | 2.837 | 0,12 | 3.030 | 0,13 |
| ES0312343017 - AYT GENOVA HIPO VII A2 %VAR VT.15/09/38 | EUR | 9.073 | 0,39 | 9.645 | 0,43 |
| ES0312344015 - AYT GENOVA HIPO VIII A2 %VAR VT.15/05/39 | EUR | 5.977 | 0,26 | 6.352 | 0,28 |
| ES0312252002 - AYT HIPO MIXTO V FTA %VAR VT.10/06/44 | EUR | 3.641 | 0,16 | 3.842 | 0,17 |
| ES0313529010 - BANKINTER 10 FTA A2 %VAR VT.21/06/43 | EUR | 4.781 | 0,21 | 5.034 | 0,22 |
| ES0313714018 - BANKINTER 11 FTH A2 %VAR VT.22/08/48 | EUR | 1.546 | 0,07 | 1.622 | 0,07 |
| ES0313814016 - BANKINTER 9 FTA A2P %VAR VT.16/07/2042 | EUR | 3.166 | 0,14 | 3.351 | 0,15 |
| ES0313679K13 - BO.BANKINTER 0,875% VT.05/03/2024 | EUR | 3.870 | 0,17 | 1.965 | 0,09 |
| ES0313307201 - BO.CAIXABANK 0,875% VT.25/03/2024 | EUR | 2.428 | 0,10 | 1.976 | 0,09 |
| ES0305045009 - BO.CRITERIA CAIXA 1,375% VT.10/04/2024 | EUR | 5.818 | 0,25 | 0 | 0,00 |
| ES0378641320 - BO.FADE AVAL EST 0,85% VT.17/12/2023 | EUR | 1.980 | 0,09 | 2.004 | 0,09 |
| ES0313252001 - CAIXA PENEDES 1 TDA FTA %VAR VT.28/01/43 | EUR | 1.174 | 0,05 | 1.245 | 0,06 |
| ES0413211790 - CE.BBVA 3,875% VT.30/01/2023 | EUR | 10.160 | 0,44 | 10.199 | 0,45 |
| ES0413307127 - CE.CAIXABANK 1% VT.14/03/2023 | EUR | 14.962 | 0,64 | 15.046 | 0,67 |
| ES0347565006 - IM CAJA LABORAL 1 FTA %VAR VT.24/10/49 | EUR | 7.170 | 0,31 | 7.609 | 0,34 |
| ES0347783005 - IM CAJAMAR 3 FTA A %VAR VT.22/09/2048 | EUR | 7.022 | 0,30 | 7.335 | 0,33 |
| ES0349044000 - IM CAJAMAR 4 FTA A %VAR VT.22/03/2049 | EUR | 1.694 | 0,07 | 1.793 | 0,08 |
| ES0347861009 - IM PASTOR 2 FTH A %VAR VT.22/09/41 | EUR | 430 | 0,02 | 612 | 0,03 |
| ES0205045018 - OB.CRITERIA CAIXA 1,5% VT.10/05/2023 | EUR | 20.207 | 0,87 | 20.277 | 0,90 |
| ES0377964004 - TDA 19 MIXTO FTA A %VAR VT.22/03/2036 | EUR | 1.659 | 0,07 | 1.818 | 0,08 |

| Descripción de la inversión y emisor | Divisa | Periodo actual | | Periodo anterior | |
|---|--------|------------------|------|------------------|------|
| | | Valor de mercado | % | Valor de mercado | % |
| ES0338451000 - TDA IBERCAJA 2 FTA A %VAR VT.26/10/2042 | EUR | 4.040 | 0,17 | 4.271 | 0,19 |
| ES0338452008 - TDA IBERCAJA 3 FTA A %VAR VT.28/12/2043 | EUR | 1.042 | 0,04 | 1.090 | 0,05 |
| ES0338453014 - TDA IBERCAJA 4 FTA A2 %VAR VT.26/08/2044 | EUR | 6.694 | 0,29 | 7.014 | 0,31 |
| ES0338340005 - UCI11 FTA A %VAR VT.15/09/41 | EUR | 5.410 | 0,23 | 5.747 | 0,26 |
| ES0338147004 - UCI12 FTH A %VAR VT.15/06/42 | EUR | 5.869 | 0,25 | 6.246 | 0,28 |
| ES0382745000 - VALENCIA HIPOTEC 2 FTH %VAR VT.24/01/43 | EUR | 0 | 0,00 | 2.777 | 0,12 |
| ES0382746016 - VALENCIA HIPOTEC 3 FTA %VAR VT.22/09/44 | EUR | 2.397 | 0,10 | 2.516 | 0,11 |
| Total Renta Fija Privada Cotizada mas de 1 año | | 145.377 | 6,25 | 145.226 | 6,46 |
| TOTAL RENTA FIJA COTIZADA | | 145.377 | 6,26 | 145.226 | 6,44 |
| TOTAL RENTA FIJA | | 145.377 | 6,26 | 145.226 | 6,44 |
| TOTAL INVERSIONES FINANCIERAS INTERIOR | | 145.377 | 6,26 | 145.226 | 6,44 |
| PTOTVKOE0002 - BO.PORTUGAL %VAR VT.02/08/2022 | EUR | 0 | 0,00 | 1.540 | 0,07 |
| PTOTVLOE0001 - BO.PORTUGAL %VAR VT.05/12/2022 | EUR | 6.113 | 0,26 | 6.113 | 0,27 |
| Total Deuda Pública Cotizada mas de 1 año | | 6.113 | 0,26 | 7.653 | 0,34 |
| XS1883354620 - BO.ABBOTT IR 0,875% VT.27/9/23 (C08/23) | EUR | 10.846 | 0,47 | 9.964 | 0,44 |
| XS1856791873 - BO.ABN AMRO BANK 0,5% VT.17/07/2023 | EUR | 16.816 | 0,72 | 15.927 | 0,71 |
| XS1935139995 - BO.ABN AMRO BANK 0,875% VT.15/01/2024 | EUR | 7.811 | 0,34 | 7.928 | 0,35 |
| XS2029574634 - BO.ALD SA 0,375% VT.18/7/2023 | EUR | 11.809 | 0,51 | 9.902 | 0,44 |
| XS2243983520 - BO.ALD SA 0,375% VT.19/10/2023 | EUR | 8.763 | 0,38 | 8.857 | 0,39 |
| XS1647404554 - BO.ALD SA 0,875% VT.18/7/2022 | EUR | 0 | 0,00 | 15.199 | 0,67 |
| XS1892240281 - BO.ALD SA 1,25% VT.11/10/2022 | EUR | 15.315 | 0,66 | 15.304 | 0,68 |
| XS1957532887 - BO.AMERICAN HONDA FIN 0,35% VT.26/08/22 | EUR | 0 | 0,00 | 14.095 | 0,63 |
| XS1793316834 - BO.AMERICAN HONDA FIN 0,55% VT.17/03/23 | EUR | 9.920 | 0,43 | 6.484 | 0,29 |
| XS2328980979 - BO.ASAHI GROUP 0,01% VT.19/04/24 (C3/24) | EUR | 1.905 | 0,08 | 0 | 0,00 |
| XS1998902479 - BO.AT&T 1,95% VT.15/09/2023 (C06/23) | EUR | 14.927 | 0,64 | 7.125 | 0,32 |
| XS1731105612 - BO.BANCO SABADELL 0,875% VT.05/03/2023 | EUR | 8.954 | 0,39 | 8.970 | 0,40 |
| XS2476266205 - BO.BANCO SANTANDER %VAR VT.05/05/2024 | EUR | 22.766 | 0,98 | 22.745 | 1,01 |
| XS2014287937 - BO.BANCO SANTANDER 0,25% VT.19/06/2024 | EUR | 6.660 | 0,29 | 0 | 0,00 |
| FR0013432770 - BO.BANQUE FED CR 0,125% VT.05/02/2024 | EUR | 14.392 | 0,62 | 1.955 | 0,09 |
| XS1856833543 - BO.BANQUE FED CR 0,5% VT.16/11/2022 | EUR | 10.134 | 0,44 | 10.131 | 0,45 |
| FR0013386539 - BO.BANQUE FED CRED MUT 0,75% VT.15/6/23 | EUR | 21.786 | 0,94 | 21.922 | 0,97 |
| XS1873982745 - BO.BARCLAYS 1,5% VT.03/09/23 | EUR | 2.004 | 0,09 | 2.021 | 0,09 |
| DE000A289DB1 - BO.BASF SE 0,101% VT.05/06/2023 (C05/23) | EUR | 11.773 | 0,51 | 5.935 | 0,26 |
| XS2199265617 - BO.BAYER AG 0,375% VT.06/07/2024(C06/24) | EUR | 3.805 | 0,16 | 0 | 0,00 |
| XS1840614900 - BO.BAYER CAPI 0,625% VT.15/12/22(C11/22) | EUR | 20.204 | 0,87 | 20.225 | 0,90 |
| XS2384578824 - BO.BBVA %VAR VT.09/09/2023 | EUR | 10.069 | 0,43 | 0 | 0,00 |
| FR0013396447 - BO.BCPE SA 1% VT.15/07/2024 | EUR | 1.926 | 0,08 | 0 | 0,00 |
| XS2055727916 - BO.BMW FINANCE NV 0% VT.24/03/2023 | EUR | 12.394 | 0,53 | 11.958 | 0,53 |
| XS2010445026 - BO.BMW FINANCE NV 0,125% VT.13/07/2022 | EUR | 0 | 0,00 | 5.023 | 0,22 |
| XS1747444245 - BO.BMW FINANCE NV 0,375% VT.10/07/2023 | EUR | 16.752 | 0,72 | 10.444 | 0,46 |
| XS1823246712 - BO.BMW FINANCE NV 0,5% VT.22/11/2022 | EUR | 11.126 | 0,48 | 11.131 | 0,49 |
| XS1948612905 - BO.BMW FINANCE NV 0,625% VT.06/10/2023 | EUR | 10.814 | 0,47 | 10.926 | 0,48 |
| XS2135797202 - BO.BP CAPITAL MK 1,876% VT.07/04/2024 | EUR | 4.921 | 0,21 | 2.001 | 0,09 |
| FR0013367406 - BO.BPCE SA 0,625% VT.26/09/2023 | EUR | 14.730 | 0,63 | 9.957 | 0,44 |
| XS1752476538 - BO.CAIXABANK SA 0,75% VT.18/04/2023 | EUR | 26.121 | 1,12 | 26.205 | 1,16 |
| FR0013342128 - BO.CARREFOUR 0,875% VT.12/06/2023(C3/23) | EUR | 1.971 | 0,08 | 0 | 0,00 |
| IT0005408080 - BO.CASSA DEPOSITI 1,5% VT.20/04/2023 | EUR | 1.531 | 0,07 | 1.537 | 0,07 |
| IT0005346579 - BO.CASSA DEPOSITI 2,125% VT.27/09/2023 | EUR | 500 | 0,02 | 507 | 0,02 |
| XS2150053721 - BO.CIE SAINT-GO 1,75% VT.03/04/23(C3/23) | EUR | 6.031 | 0,26 | 3.046 | 0,14 |
| XS1795253134 - BO.CITIGROUP INC %VAR VT.21/03/2023 | EUR | 2.010 | 0,09 | 2.010 | 0,09 |
| XS1811023735 - BO.COMMON BK COV 0,375 VT.24/04/2023 | EUR | 14.885 | 0,64 | 14.964 | 0,66 |
| XS2178585423 - BO.CONTI-GUMM 2,125% VT.27/11/23(C10/23) | EUR | 6.017 | 0,26 | 6.087 | 0,27 |
| XS2051667181 - BO.CONTINENTAL 0% VT.12/09/23 (C06/23) | EUR | 1.932 | 0,08 | 1.957 | 0,09 |
| FR0013370137 - BO.CRED MUT ARKEA 0,875% VT.05/10/2023 | EUR | 6.852 | 0,29 | 6.929 | 0,31 |
| FR0013385515 - BO.CREDIT AGRICOLE LONDO 0,75% VT.05/12/2023 | EUR | 9.746 | 0,42 | 4.956 | 0,22 |
| DE000A289XH6 - BO.DAIMLER AG 1,625% VT.22/08/23 | EUR | 17.055 | 0,73 | 15.217 | 0,68 |
| DE000A2R9ZT1 - BO.DAIMLER INTL FIN 0,25% VT.06/11/2023 | EUR | 9.708 | 0,42 | 9.836 | 0,44 |
| DE000A2RYD83 - BO.DAIMLER INTL FIN 0,625% VT.27/02/2023 | EUR | 15.046 | 0,65 | 12.092 | 0,54 |
| XS1828032513 - BO.DEUTSCHE TELEKOM 0,625% VT.01/12/22 | EUR | 10.139 | 0,44 | 10.145 | 0,45 |
| XS1982107903 - BO.DIAGEO FI 0,125% VT.12/10/23 (C09/23) | EUR | 9.739 | 0,42 | 8.878 | 0,39 |
| XS2103015009 - BO.E.ON SE 0% VT.18/12/2023 (C9/23) | EUR | 967 | 0,04 | 981 | 0,04 |
| XS2177575177 - BO.E.ON SE 0,375% VT.20/04/2023 (C3/23) | EUR | 14.930 | 0,64 | 14.985 | 0,66 |
| XS2066706818 - BO.ENEL FIN INT 0% VT.17/06/24 (C5/24) | EUR | 8.522 | 0,37 | 1.926 | 0,09 |
| FR0013284247 - BO.ENGIE 0,375% VT.28/02/2023(C11/22) | EUR | 7.938 | 0,34 | 6.980 | 0,31 |
| XS2069380488 - BO.EON SE 0% VT.24/10/2022 | EUR | 20.085 | 0,86 | 20.062 | 0,89 |
| FR0013463643 - BO.ESSILORLUX 0% VT.27/05/2023 (C04/23) | EUR | 3.944 | 0,17 | 1.984 | 0,09 |
| FR0013516051 - BO.ESSILORLUX 0% VT.05/01/24(C12/23) | EUR | 1.939 | 0,08 | 0 | 0,00 |
| XS2196322155 - BO.EXXON MOBIL 0,142% VT.26/06/24(C5/24) | EUR | 476 | 0,02 | 0 | 0,00 |
| XS2332254015 - BO.FCA BANK SP 0% VT.16/04/24 (C1/24) | EUR | 943 | 0,04 | 964 | 0,04 |
| XS2258558464 - BO.FCA BANK SP 0,125% VT.16/11/23(C8/23) | EUR | 7.886 | 0,33 | 7.816 | 0,35 |
| XS2231792586 - BO.FCA BANK SP 0,5% VT.18/09/23(C06/23) | EUR | 14.634 | 0,63 | 10.884 | 0,48 |
| XS2001270995 - BO.FCA BANK SP 0,62% VT.24/11/22(C10/22) | EUR | 9.059 | 0,39 | 9.066 | 0,40 |
| XS2109806369 - BO.FCA BANK SPA 0,25% VT.28/02/23 | EUR | 19.956 | 0,86 | 19.965 | 0,89 |
| XS1956028168 - BO.FORTUM OYJ 0,875% VT.27/02/2023 | EUR | 2.007 | 0,09 | 2.002 | 0,09 |

| Descripción de la inversión y emisor | Divisa | Periodo actual | | Periodo anterior | |
|---|--------|------------------|------|------------------|------|
| | | Valor de mercado | % | Valor de mercado | % |
| XS2054626788 - BO.GLAXOSMITH C 0% VT.23/09/2023 (C7/23) | EUR | 2.917 | 0,13 | 1.972 | 0,09 |
| XS2170609403 - BO.GLAXOSMITH C 0,125% VT.12/5/23(C4/23) | EUR | 2.958 | 0,13 | 2.978 | 0,13 |
| XS2338355360 - BO.GOLDMAN SA %VAR VT.30/4/24(C4/23) | EUR | 2.003 | 0,09 | 2.001 | 0,09 |
| XS2338355105 - BO.GOLDMAN SA FTF %VAR VT.30/4/24(C4/23) | EUR | 1.958 | 0,08 | 1.965 | 0,09 |
| XS2154335363 - BO.HARLEY-DA 3,875% VT.19/05/23 | EUR | 5.053 | 0,22 | 5.059 | 0,22 |
| FR0013323722 - BO.HSBC CONTINENT EUR 0,6% VT.20/03/2023 | EUR | 3.972 | 0,17 | 999 | 0,04 |
| XS1944456018 - BO.IBM CORP 0,375% VT.31/01/2023 | EUR | 5.021 | 0,22 | 4.030 | 0,18 |
| XS1882544627 - BO.ING GROEP 1% VT.20/09/23 | EUR | 4.974 | 0,21 | 5.025 | 0,22 |
| XS1829217428 - BO.INNOGY FINA 0,75% VT.30/11/22(C10/22) | EUR | 13.177 | 0,57 | 13.167 | 0,58 |
| XS1699951767 - BO.INTESA SANPAOLO 0,75% VT.17/10/2022 | EUR | 25.314 | 1,09 | 25.274 | 1,12 |
| XS2031235315 - BO.INTESA SANPAOLO 1% VT.22/07/2022 | EUR | 0 | 0,00 | 5.066 | 0,22 |
| XS1873219304 - BO.INTESA SANPAOLO 2,125% VT.30/08/2023 | EUR | 12.060 | 0,52 | 12.165 | 0,54 |
| XS1611042646 - BO.KELLOGG CO 0,8% VT.17/11/2022 | EUR | 3.049 | 0,13 | 3.051 | 0,14 |
| FR0013512381 - BO.KERING 0,25% VT.13/05/2023(C2/23) | EUR | 5.938 | 0,26 | 5.962 | 0,26 |
| FR0013405347 - BO.LVMH MOET 0,125% VT.28/02/23 (C12/22) | EUR | 2.489 | 0,11 | 1.003 | 0,04 |
| XS2020670696 - BO.MEDTRONIC 0% VT.02/12/2022(C11/22) | EUR | 10.026 | 0,43 | 10.022 | 0,44 |
| XS2240133459 - BO.MEDTRONIC 0% VT.15/03/2023 | EUR | 16.890 | 0,73 | 16.948 | 0,75 |
| XS1960678099 - BO.MEDTRONIC 0,375% VT.7/3/23(C2/23) | EUR | 1.985 | 0,09 | 0 | 0,00 |
| DE000A2Y2VZ0 - BO.MERCEDES BENZ FIN 0% VT.08/02/2024 | EUR | 2.867 | 0,12 | 2.918 | 0,13 |
| DE000A2R6UF7 - BO.MERCEDES BENZ FIN 0% VT.21/08/2022 | EUR | 0 | 0,00 | 5.011 | 0,22 |
| XS2023643146 - BO.MERCK FIN 0,005% VT.15/12/23(C9/23) | EUR | 970 | 0,04 | 985 | 0,04 |
| XS1872032369 - BO.NAT AUSTRALIA BK 0,625% VT.30/08/2023 | EUR | 5.391 | 0,23 | 496 | 0,02 |
| XS1864037541 - BO.NATIONAL GRID NA 0,75% VT.08/08/2023 | EUR | 9.883 | 0,43 | 9.933 | 0,44 |
| XS2002491517 - BO.NATWEST MARKET PLC 1% VT.28/05/2024 | EUR | 960 | 0,04 | 0 | 0,00 |
| XS1837997979 - BO.NATWEST MARKET PLC 1,125% VT.14/6/23 | EUR | 2.970 | 0,13 | 0 | 0,00 |
| XS2004795725 - BO.NN BANK NV NETH 0,375% VT.31/05/2023 | EUR | 14.846 | 0,64 | 10.950 | 0,49 |
| XS2189614014 - BO.OMV AG 0% VT.16/06/2023 | EUR | 14.767 | 0,64 | 14.858 | 0,66 |
| XS1917590876 - BO.OMV AG 0,75% VT.04/12/2023 | EUR | 1.963 | 0,08 | 1.993 | 0,09 |
| FR0013456423 - BO.PERNOD-RICARD 0% VT.24/10/23(C9/23) | EUR | 4.349 | 0,19 | 3.930 | 0,17 |
| XS2015267953 - BO.PSA BANQUE 0,625% VT.21/06/24(C3/24) | EUR | 1.903 | 0,08 | 0 | 0,00 |
| XS1808861840 - BO.PSA BANQUE 0,75% VT.19/04/2023 | EUR | 20.775 | 0,89 | 15.969 | 0,71 |
| XS1694212181 - BO.PSA BANQUE FR 0,625% VT.10/10/2022 | EUR | 23.311 | 1,00 | 23.294 | 1,03 |
| FR0013412699 - BO.RCI BANQUE 0,75% VT.10/4/23(C1/23) | EUR | 9.962 | 0,43 | 9.979 | 0,44 |
| FR0013324332 - BO.SANOFI 0% VT.21/03/2023 (C12/22) | EUR | 1.492 | 0,06 | 0 | 0,00 |
| XS2018637913 - BO.SANTANDER CONS 0,375% VT.27/06/2024 | EUR | 1.897 | 0,08 | 0 | 0,00 |
| XS1824235219 - BO.SANTANDER CONS 0,875% VT.30/05/2023 | EUR | 14.432 | 0,62 | 11.009 | 0,49 |
| XS1956025651 - BO.SANTANDER CONS 1% VT.27/02/2024 | EUR | 9.675 | 0,42 | 5.900 | 0,26 |
| XS1888206627 - BO.SANTANDER CONS 1,125% VT.09/10/2023 | EUR | 15.611 | 0,67 | 14.966 | 0,66 |
| XS2176715311 - BO.SAP SE 0% VT.17/05/2023 (C4/23) | EUR | 4.926 | 0,21 | 0 | 0,00 |
| FR0013517711 - BO.SCHNEIDER ELE 0% VT.12/6/23 (C5/23) | EUR | 4.417 | 0,19 | 1.482 | 0,07 |
| XS2170384130 - BO.SHELL INT FIN 0,5% VT.11/05/2024 | EUR | 2.886 | 0,12 | 2.941 | 0,13 |
| XS2118276539 - BO.SIEMENS FINAN 0% VT.20/02/2023 | EUR | 2.988 | 0,13 | 3.000 | 0,13 |
| XS2051660335 - BO.SNAM SPA 0% VT.12/05/24 (C2/24) | EUR | 7.565 | 0,33 | 3.873 | 0,17 |
| XS2178832379 - BO.STELLANTIS 3,375% VT.07/07/23 (C4/23) | EUR | 1.032 | 0,04 | 1.035 | 0,05 |
| XS1946004451 - BO.TELEFONICA E 1,069% VT.5/2/24(C11/23) | EUR | 5.881 | 0,25 | 1.992 | 0,09 |
| XS2056395606 - BO.TELENOR ASA 0, % VT.25/09/23 (C6/23) | EUR | 970 | 0,04 | 0 | 0,00 |
| XS1858912915 - BO.TERNA SPA 1% VT.23/07/23 | EUR | 7.928 | 0,34 | 5.008 | 0,22 |
| XS1978200639 - BO.TOYOTA FINANCE AU 0,25% VT.09/04/2024 | EUR | 9.613 | 0,41 | 0 | 0,00 |
| XS1884740041 - BO.TOYOTA MOTOR FIN 0,625% VT.26/09/2023 | EUR | 14.749 | 0,63 | 14.892 | 0,66 |
| XS1810806635 - BO.UBS LONDON 0,625% VT.23/01/23(C12/22) | EUR | 15.128 | 0,65 | 12.144 | 0,54 |
| XS2149270477 - BO.UBS LONDON 0,75% VT.21/04/23(C03/23) | EUR | 15.007 | 0,65 | 15.071 | 0,67 |
| FR0013394681 - BO.VEOLIA ENV 0,892% VT.14/1/24 (C10/23) | EUR | 11.682 | 0,50 | 6.959 | 0,31 |
| XS1806457211 - BO.VOLKSWAGEN FINAN 0,875% VT.12/04/2023 | EUR | 1.000 | 0,04 | 1.005 | 0,04 |
| XS1893631330 - BO.VOLKSWAGEN FINAN 1,375% VT.16/10/2023 | EUR | 5.970 | 0,26 | 6.039 | 0,27 |
| XS2152058868 - BO.VOLKSWAGEN FINAN 2,5% VT.06/04/2023 | EUR | 18.507 | 0,80 | 18.572 | 0,82 |
| XS2282093769 - BO.VOLKSWAGEN LEASING 0% VT.12/07/2023 | EUR | 7.812 | 0,34 | 7.882 | 0,35 |
| XS1865186321 - BO.VOLKSWAGEN LEASING 1% VT.16/02/2023 | EUR | 15.136 | 0,65 | 15.158 | 0,67 |
| XS2115085230 - BO.VOLVO TREASURY 0% VT.11/02/23 | EUR | 2.984 | 0,13 | 2.993 | 0,13 |
| XS2054209320 - BO.WINTERSHALL 0,452% VT.25/9/23(C6/23) | EUR | 4.840 | 0,21 | 4.885 | 0,22 |
| XS0937858271 - OB.ABN AMRO BANK 2,5% VT.29/1/23 | EUR | 10.038 | 0,43 | 5.108 | 0,23 |
| XS1087831688 - OB.ACEA SPA 2,625% VT.15/07/24 (C4/24) | EUR | 1.974 | 0,08 | 0 | 0,00 |
| XS0809847667 - OB.AKZO NOBEL SW 2,625% VT.27/07/22 | EUR | 0 | 0,00 | 2.086 | 0,09 |
| XS1550134602 - OB.AMER HONDA FIN 0,75% VT.17/01/2024 | EUR | 12.616 | 0,54 | 0 | 0,00 |
| XS1288342659 - OB.AMER HONDA FIN 1,375% VT.10/11/2022 | EUR | 3.596 | 0,15 | 3.593 | 0,16 |
| XS1411404855 - OB.ASTRAZENECA 0,75% VT.12/05/24 (C2/24) | EUR | 964 | 0,04 | 988 | 0,04 |
| XS1196373507 - OB.AT&T 1,3% VT.05/09/2023 (C06/23) | EUR | 11.928 | 0,51 | 10.080 | 0,45 |
| XS1076018131 - OB.AT&T 2,4% VT.15/03/2024 (C12/23) | EUR | 5.949 | 0,26 | 4.047 | 0,18 |
| XS0903433513 - OB.AT&T INC 2,5% VT.15/03/2023 (C12/22) | EUR | 15.509 | 0,67 | 15.511 | 0,69 |
| FR0011694033 - OB.AUTOR SUD FR 2,95% VT.17/1/24(C10/23) | EUR | 5.007 | 0,22 | 0 | 0,00 |
| XS1811433983 - OB.BANK AMERICA %VAR VT.25/04/24(C4/23) | EUR | 15.016 | 0,65 | 14.985 | 0,66 |
| XS1458405898 - OB.BANK OF AMERICA 0,75% VT.26/07/2023 | EUR | 21.844 | 0,94 | 21.974 | 0,98 |
| XS1290850707 - OB.BANK OF AMERICA 1,625% VT.14/09/2022 | EUR | 0 | 0,00 | 20.664 | 0,92 |
| XS099775837 - OB.BANQUE FED CRED 3% VT.28/11/2023 | EUR | 2.031 | 0,09 | 2.059 | 0,09 |
| XS1045553812 - OB.BANQUE FED CRED MUT 2,625% VT.18/3/24 | EUR | 6.504 | 0,28 | 6.622 | 0,29 |

| Descripción de la inversión y emisor | Divisa | Periodo actual | | Periodo anterior | |
|---|--------|------------------|------|------------------|------|
| | | Valor de mercado | % | Valor de mercado | % |
| XS1531174388 - OB.BARCLAYS BK 1,875% VT.08/12/2023 | EUR | 2.005 | 0,09 | 2.028 | 0,09 |
| DE000A1R0XG3 - OB.BASF SE 2% VT.05/12/2022 | EUR | 2.085 | 0,09 | 2.087 | 0,09 |
| FR0011390921 - OB.BCPE SA 2,875% VT.16/01/2024 | EUR | 9.027 | 0,39 | 5.142 | 0,23 |
| XS1139688268 - OB.BG ENERGY C 1,25% VT.21/11/22 | EUR | 10.205 | 0,44 | 10.189 | 0,45 |
| XS1396261338 - OB.BMW FINANCE NV 0,75% VT.15/04/2024 | EUR | 969 | 0,04 | 985 | 0,04 |
| XS1105276759 - OB.BMW FINANCE NV 1,25% VT.05/09/2022 | EUR | 0 | 0,00 | 10.247 | 0,45 |
| XS1015217703 - OB.BMW FINANCE NV 2,625% VT.17/01/2024 | EUR | 3.026 | 0,13 | 1.036 | 0,05 |
| XS1345331299 - OB.BNP PARIBAS 1,125% VT.15/01/2023 | EUR | 10.236 | 0,44 | 10.244 | 0,45 |
| XS0895249620 - OB.BNP PARIBAS SA 2,875% VT.26/09/23 | EUR | 20.149 | 0,87 | 5.148 | 0,23 |
| XS0606704558 - OB.BNP PARIBAS SA 4,5% VT.21/3/2023 | EUR | 509 | 0,02 | 0 | 0,00 |
| XS1527126772 - OB.BP CAPITAL 1,117% VT.25/01/24(C10/23) | EUR | 9.747 | 0,42 | 9.912 | 0,44 |
| FR0013204476 - OB.BPCE SA 0,375% VT.05/10/2023 | EUR | 12.695 | 0,55 | 11.355 | 0,50 |
| XS1677902162 - OB.CARLSBERG BR 0,5% VT.06/09/23 (C6/23) | EUR | 7.875 | 0,34 | 9.925 | 0,44 |
| XS0854746343 - OB.CARLSBERG BREWER 2,625% VT.15/11/22 | EUR | 10.518 | 0,45 | 10.521 | 0,47 |
| IT0005273567 - OB.CASSA DEPOSITI 1,5% VT.21/06/2024 | EUR | 2.923 | 0,13 | 1.997 | 0,09 |
| XS1468525057 - OB.CELLNEX TE 2,375% VT.16/1/24 (C10/23) | EUR | 7.886 | 0,34 | 7.956 | 0,35 |
| XS1265778933 - OB.CELLNEX TELECOM 3,125% VT.27/07/2022 | EUR | 0 | 0,00 | 2.005 | 0,09 |
| XS1457608013 - OB.CITIGROUP IN 0,75% VT.26/10/23(C7/23) | EUR | 14.741 | 0,63 | 14.882 | 0,66 |
| XS1068874970 - OB.CITIGROUP INC 2,375% VT.22/05/24 | EUR | 4.929 | 0,21 | 0 | 0,00 |
| XS0933540527 - OB.CO RABOBANK 2,375% VT.22/05/2023 | EUR | 3.008 | 0,13 | 0 | 0,00 |
| XS1415535340 - OB.COCA-COLA EP 1,125% VT.26/5/24(C2/24) | EUR | 1.937 | 0,08 | 0 | 0,00 |
| XS1069521083 - OB.CREDIT AGRICOLE 2,375% VT.20/05/2024 | EUR | 3.961 | 0,17 | 1.015 | 0,05 |
| XS0953564191 - OB.CREDIT AGRICOLE 3,125% VT.17/07/2023 | EUR | 10.193 | 0,44 | 10.279 | 0,46 |
| FR0011625482 - OB.CREDIT AGRICOLE 3,15% VT.23/12/2023 | EUR | 10.324 | 0,44 | 10.447 | 0,46 |
| DE000A169G15 - OB.DAIMLER AG 1,4% VT.12/01/2024 | EUR | 1.488 | 0,06 | 1.507 | 0,07 |
| DE000A1PGWA5 - OB.DAIMLER AG 2,375% VT.12/09/2022 | EUR | 0 | 0,00 | 4.182 | 0,19 |
| DE000A1R0691 - OB.DAIMLER AG 2,375% VT.08/03/2023 | EUR | 8.606 | 0,37 | 2.596 | 0,12 |
| FR0011527241 - OB.DANONE SA 2,6% VT.28/06/2023 | EUR | 7.023 | 0,30 | 2.034 | 0,09 |
| XS1382792197 - OB.DEUTSCHE TELEK IF 0,625% VT.03/04/23 | EUR | 20.998 | 0,90 | 21.075 | 0,94 |
| XS1557096267 - OB.DEUTSCHE TELEK IF 0,875% VT.30/01/24 | EUR | 4.914 | 0,21 | 4.981 | 0,22 |
| XS1471646965 - OB.EDP FINANCE 1,125% VT.12/02/2024 | EUR | 5.851 | 0,25 | 5.945 | 0,26 |
| XS1558083652 - OB.EDP FINANCE 1,875% VT.29/09/2023 | EUR | 5.048 | 0,22 | 5.110 | 0,23 |
| XS1385395121 - OB.EDP FINANCE 2,375% VT.23/03/2023 | EUR | 13.427 | 0,58 | 13.482 | 0,60 |
| FR0011318658 - OB.ELECTRIC FRANCE 2,75% VT.10/03/2023 | EUR | 10.287 | 0,44 | 10.323 | 0,46 |
| FR0010800540 - OB.ELECTRIC FRANCE 4,625% VT.11/09/2024 | EUR | 2.059 | 0,09 | 0 | 0,00 |
| XS1203859415 - OB.ENAGAS FIN 1% VT.25/03/2023 | EUR | 5.966 | 0,26 | 1.002 | 0,04 |
| XS1550149204 - OB.ENEL FIN INT 1% VT.16/09/2024 | EUR | 960 | 0,04 | 0 | 0,00 |
| XS0842659426 - OB.ENEL FIN INT 4,875% VT.17/04/2023 | EUR | 7.154 | 0,31 | 2.061 | 0,09 |
| XS0192503695 - OB.ENEL SPA 5,25% VT.20/05/2024 | EUR | 521 | 0,02 | 0 | 0,00 |
| XS1326311070 - OB.ENERG POR 2,375% VT.27/11/23 (C8/23) | EUR | 4.953 | 0,21 | 5.013 | 0,22 |
| FR0013245859 - OB.ENGIE 0,875% VT.27/03/24(C12/23) | EUR | 2.908 | 0,13 | 1.979 | 0,09 |
| FR0011261924 - OB.ENGIE 3% VT.01/02/2023 | EUR | 11.560 | 0,50 | 11.566 | 0,51 |
| XS1292988984 - OB.ENI SPA 1,75% VT.18/01/2024 | EUR | 5.448 | 0,23 | 4.035 | 0,18 |
| XS0951565091 - OB.ENI SPA 3,25% VT.10/07/2023 | EUR | 16.522 | 0,71 | 15.641 | 0,69 |
| XS1584122177 - OB.ESSITY 1,125% VT.27/3/24(C12/23) | EUR | 12.621 | 0,54 | 992 | 0,04 |
| XS1315101011 - OB.EUROGR GMBH 1,625% VT.3/11/23 (C8/23) | EUR | 2.464 | 0,11 | 998 | 0,04 |
| XS1732400319 - OB.FERROVIE DELLO S 0,875% VT.07/12/2023 | EUR | 12.779 | 0,55 | 12.941 | 0,57 |
| XS1088515207 - OB.FIAT CHRYSLER FI EU 4,75% VT.15/07/22 | EUR | 0 | 0,00 | 20.024 | 0,89 |
| XS0825855751 - OB.FORTUM OYJ 2,25% VT.06/09/2022 | EUR | 0 | 0,00 | 10.353 | 0,46 |
| XS1691349523 - OB.GOLDMAN SACHS %VAR VT.26/9/23 (C9/22) | EUR | 0 | 0,00 | 10.011 | 0,44 |
| XS1173845436 - OB.GOLDMAN SACHS 1,375% VT.26/07/2022 | EUR | 0 | 0,00 | 13.310 | 0,59 |
| XS1265805090 - OB.GOLDMAN SACHS 2% VT.27/07/2023 | EUR | 13.078 | 0,56 | 13.186 | 0,59 |
| XS0882849507 - OB.GOLDMAN SACHS 3,25% VT.01/02/2023 | EUR | 16.907 | 0,73 | 16.916 | 0,75 |
| XS0758420748 - OB.HEINEKEN NV 3,5% VT.19/03/24 | EUR | 7.169 | 0,31 | 7.272 | 0,32 |
| XS1420337633 - OB.HOLCIM FI 1,375% VT.26/05/23 (C2/23) | EUR | 3.028 | 0,13 | 3.042 | 0,13 |
| XS1366026679 - OB.HONEYWELL INT 1,3% VT.22/02/2023 | EUR | 4.009 | 0,17 | 4.022 | 0,18 |
| XS1917601582 - OB.HSBC HOLDIN FTF %VAR (C4/23) | EUR | 1.948 | 0,08 | 0 | 0,00 |
| XS1527758145 - OB.IBERDROLA FI 1% VT.07/03/24 (C7/23) | EUR | 983 | 0,04 | 998 | 0,04 |
| XS1171541813 - OB.IBERDROLA INTL 1,125% VT.27/01/2023 | EUR | 10.091 | 0,43 | 10.114 | 0,45 |
| XS1291004270 - OB.IBERDROLA INTL 1,75% VT.17/09/23 | EUR | 8.085 | 0,35 | 8.171 | 0,36 |
| XS1057055060 - OB.IBERDROLA INTL 2,5% VT.24/10/22 | EUR | 8.398 | 0,36 | 8.389 | 0,37 |
| XS1143163183 - OB.IBM CORP 1,25% VT.26/05/2023 | EUR | 6.023 | 0,26 | 6.053 | 0,27 |
| XS0982019126 - OB.INNOGY FINAN 3% VT.17/01/2024 | EUR | 1.030 | 0,04 | 1.037 | 0,05 |
| XS1551306951 - OB.INTESA SANPAOLO 1,375% VT.18/01/2024 | EUR | 5.848 | 0,25 | 5.932 | 0,26 |
| XS0986194883 - OB.INTESA SANPAOLO 4% VT.30/10/2023 | EUR | 12.427 | 0,53 | 12.560 | 0,56 |
| XS0883614231 - OB.JP MORGAN CHASE 2,75% VT.01/02/2023 | EUR | 15.680 | 0,67 | 15.690 | 0,70 |
| XS1456422135 - OB.JPMORGAN CH 0,625% VT.25/1/24(C11/23) | EUR | 11.675 | 0,50 | 11.796 | 0,52 |
| XS1310493744 - OB.JPMORGAN CHASE 1,5% VT.26/10/2022 | EUR | 11.314 | 0,49 | 11.318 | 0,50 |
| XS0855167523 - OB.LANXESS AG 2,625% VT.21/11/22 | EUR | 7.297 | 0,31 | 7.300 | 0,32 |
| XS1627782771 - OB.LEONARDO S 1,5% VT.07/06/24(C3/24) | EUR | 569 | 0,02 | 0 | 0,00 |
| DE000A1R07P5 - OB.LINDE FINANCE BV 2% VT.18/04/2023 | EUR | 1.001 | 0,04 | 0 | 0,00 |
| XS1362384262 - OB.LINDE INC 1,2% VT.12/02/2024 | EUR | 4.895 | 0,21 | 3.477 | 0,15 |
| XS1517174626 - OB.LLOYDS BANKING GR 1% VT.09/11/2023 | EUR | 1.962 | 0,08 | 992 | 0,04 |
| XS1749378342 - OB.LLOYDS BK FTF%VAR VT.15/01/24(C01/23) | EUR | 1.990 | 0,09 | 1.995 | 0,09 |

| Descripción de la inversión y emisor | Divisa | Periodo actual | | Periodo anterior | |
|---|--------|------------------|--------------|------------------|--------------|
| | | Valor de mercado | % | Valor de mercado | % |
| XS1725630740 - OB.MCDONALDS 0,625% VT.29/01/24 | EUR | 5.818 | 0,25 | 4.932 | 0,22 |
| XS1403264374 - OB.MCDONALDS 1% VT.15/11/2023 | EUR | 9.891 | 0,43 | 10.019 | 0,44 |
| XS1529838085 - OB.MORGAN STANLEY 1% VT.02/12/2022 | EUR | 25.462 | 1,10 | 25.463 | 1,13 |
| XS1379171140 - OB.MORGAN STANLEY 1,75% VT.11/03/2024 | EUR | 4.923 | 0,21 | 4.988 | 0,22 |
| XS1115208107 - OB.MORGAN STANLEY 1,875% VT.30/03/2023 | EUR | 22.565 | 0,97 | 22.614 | 1,00 |
| XS1590568132 - OB.NATURGY CAP 1,125% VT.11/4/24 (C1/24) | EUR | 9.639 | 0,41 | 9.862 | 0,44 |
| XS0875343757 - OB.NATURGY FIN BV 3,875% VT.17/01/23 | EUR | 4.079 | 0,18 | 1.057 | 0,05 |
| XS1041934800 - OB.NATURGY FINANCE 2,875% VT.11/03/24 | EUR | 9.943 | 0,43 | 5.095 | 0,23 |
| XS1368470156 - OB.NORDEA BANK AB 1% VT.22/02/23 | EUR | 8.991 | 0,39 | 9.021 | 0,40 |
| XS0834367863 - OB.OMV AG 2,625% VT.27/09/2022 | EUR | 0 | 0,00 | 6.299 | 0,28 |
| FR0011560077 - OB.ORANGE 3,125% VT.09/01/2024 | EUR | 13.193 | 0,57 | 5.209 | 0,23 |
| XS1314318301 - OB.PROCTER & GAMBLE 1,125% VT.02/11/2023 | EUR | 4.978 | 0,21 | 5.029 | 0,22 |
| FR0013143997 - OB.SANOFI 0,625% VT.05/04/2024 (C01/24) | EUR | 970 | 0,04 | 986 | 0,04 |
| FR0011625433 - OB.SANOFI 2,5% VT.14/11/2023 (CALL 8/23) | EUR | 10.049 | 0,43 | 6.112 | 0,27 |
| XS1330948818 - OB.SANTANDER INTL DEB 1,375% VT.14/12/22 | EUR | 18.524 | 0,80 | 18.525 | 0,82 |
| FR0012939841 - OB.SCHNEIDER ELEC 1,5% VT.8/9/23 (C6/23) | EUR | 2.973 | 0,13 | 0 | 0,00 |
| XS1418786890 - OB.SOCIETE GENE 0,75% VT.26/05/2023 | EUR | 15.885 | 0,68 | 10.012 | 0,44 |
| BE6282459609 - OB.SOLVAY 1,625% VT.02/12/22 (C9/22) | EUR | 0 | 0,00 | 6.168 | 0,27 |
| XS0858366684 - OB.STATKRAFT 2,5% VT.28/11/2022 | EUR | 7.019 | 0,30 | 0 | 0,00 |
| FR0013153707 - OB.STELLANTIS NV 2,375% VT.14/04/2023 | EUR | 15.277 | 0,66 | 12.324 | 0,55 |
| XS0937853983 - OB.SUMITOMO MITSUI 2,75% VT.24/07/2023 | EUR | 10.220 | 0,44 | 9.285 | 0,41 |
| XS1421827269 - OB.SWISS RE FIN UK 1,375% VT.27/05/2023 | EUR | 15.891 | 0,68 | 1.001 | 0,04 |
| XS0874864860 - OB.TELEFONICA EM 3,987% VT.23/01/2023 | EUR | 13.869 | 0,60 | 13.903 | 0,62 |
| XS0746010908 - OB.TELIASONERA AB 3,625% VT.14/02/2024 | EUR | 5.091 | 0,22 | 5.165 | 0,23 |
| XS0903136736 - OB.TELSTRA CORP 2,5% VT.15/09/2023 | EUR | 8.116 | 0,35 | 7.669 | 0,34 |
| XS1429027375 - OB.THALES SA 0,75% VT.07/06/23 (C03/23) | EUR | 2.970 | 0,13 | 0 | 0,00 |
| XS1443997223 - OB.TOTALENER CAPITAL 0,25% VT.12/07/2023 | EUR | 8.843 | 0,38 | 1.983 | 0,09 |
| XS1171489393 - OB.TOYOTA MOTOR CR 0,75% VT.21/7/22 | EUR | 0 | 0,00 | 11.662 | 0,52 |
| XS0881362502 - OB.TOYOTA MOTOR CR 2,375% VT.1/2/23 | EUR | 2.057 | 0,09 | 2.063 | 0,09 |
| CH0302790123 - OB.UBS GROUP FUND 1,75% VT.16/11/2022 | EUR | 10.376 | 0,45 | 10.366 | 0,46 |
| IT0005199267 - OB.UNICREDIT SPA %VAR VT.30/06/2023 | EUR | 15.011 | 0,65 | 10.003 | 0,44 |
| XS1374865555 - OB.UNICREDIT SPA 2% VT.04/03/2023 | EUR | 19.532 | 0,84 | 18.563 | 0,82 |
| XS1241577490 - OB.UNILEVER NV 1% VT.03/06/2023 | EUR | 1.985 | 0,09 | 0 | 0,00 |
| FR0013230943 - OB.VALEO 0,625% VT.11/01/2023 (C10/22) | EUR | 999 | 0,04 | 996 | 0,04 |
| FR0013210408 - OB.VEOLIA ENVIR 0,314% VT.4/10/23(C7/23) | EUR | 11.247 | 0,48 | 9.902 | 0,44 |
| XS1146282634 - OB.VERIZON COM 1,625% VT.01/03/24 | EUR | 9.825 | 0,42 | 0 | 0,00 |
| XS1492446460 - OB.VF CORP 0,625% VT.20/09/23(C6/23) | EUR | 4.931 | 0,21 | 4.971 | 0,22 |
| XS1499604905 - OB.VODAFONE GR 0,5% VT.30/01/2024 | EUR | 1.947 | 0,08 | 1.974 | 0,09 |
| XS1586555861 - OB.VOLKSWAGEN INT FIN 1,125% VT.02/10/23 | EUR | 3.924 | 0,17 | 3.968 | 0,18 |
| XS0823975585 - OB.VOLKSWAGEN LEASING 2,375% VT.06/09/22 | EUR | 0 | 0,00 | 7.194 | 0,32 |
| XS0995643003 - OB.WPP FINANCE 2013 3% VT.20/11/2023 | EUR | 1.023 | 0,04 | 1.031 | 0,05 |
| Total Renta Fija Privada Cotizada mas de 1 año | | 1.923.451 | 82,74 | 1.723.866 | 76,40 |
| TOTAL RENTA FIJA COTIZADA | | 1.929.564 | 83,03 | 1.731.519 | 76,84 |
| TOTAL RENTA FIJA | | 1.929.564 | 83,03 | 1.731.519 | 76,84 |
| FR0007038138 - PART.AMUNDI EURO LIQ RA-I CAP | EUR | 0 | 0,00 | 202.870 | 9,00 |
| FR0014005XN8 - PART.AMUNDI EURO LIQ RATED SRI-Z | EUR | 183.487 | 7,90 | 0 | 0,00 |
| TOTAL IIC | | 183.487 | 7,90 | 202.870 | 9,00 |
| TOTAL INVERSIONES FINANCIERAS EXTERIOR | | 2.113.051 | 90,93 | 1.934.389 | 85,84 |
| TOTAL INVERSIONES FINANCIERAS | | 2.258.428 | 97,18 | 2.079.614 | 92,29 |

Notas: El período se refiere al final del trimestre o semestre, según sea el caso.

Los productos estructurados suponen un 0,00% de la cartera de inversiones financieras del fondo o compartimento.

11. Información sobre la política de remuneración

Esta información aparecerá cumplimentada en el informe anual.

12. Información sobre las operaciones de financiación de valores, reutilización de las garantías y swaps de rendimiento total (Reglamento UE 2015/2365)

El fondo no ha realizado durante el período operaciones de financiación de valores, reutilización de garantías o swaps de rendimiento total.